

富国低碳新经济混合型证券投资基金

二〇一七年半年度报告

(摘要)

2017年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017年08月24日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国低碳新经济混合
基金主代码	001985
交易代码	001985
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月18日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	408,097,831.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于低碳新经济主题相关股票，通过精选个股和严格风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	田青
	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 8 号 上海国金中心二期 16-17 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年01月01日至2017年06月30日)
本期已实现收益	-4,084,908.85
本期利润	-7,923,354.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0173
本期基金份额净值增长率	-1.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1213
期末基金资产净值	457,604,891.46
期末基金份额净值	1.121

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.56%	0.91%	3.41%	0.38%	2.15%	0.53%
过去三个月	-1.58%	1.08%	1.51%	0.40%	-3.09%	0.68%
过去六个月	-1.23%	0.98%	3.28%	0.37%	-4.51%	0.61%
过去一年	4.67%	0.91%	5.31%	0.43%	-0.64%	0.48%
自基金合同生效日起至今	12.10%	1.23%	-5.35%	0.78%	17.45%	0.45%

注：本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证 800 指数的成份股由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股一起构成。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处

理，1日收益率（benchmark_t）按下列公式计算： $benchmark_t = [中证800指数_t / (中证800指数_{t-1}) - 1] * 60\% + [中债综合指数_t / (中债综合指数_{t-1}) - 1] * 40\%$ ；其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；期间T日收益率（benchmark_T）按下列公式计算： $benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$ 其中， $T = 2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ 表示t日至T日的 $(1 + benchmark_t)$ 数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2017年6月30日。

2、本基金于2015年12月18日成立，建仓期6个月，从2015年12月18日起至2016年6月17日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至2017年6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证

券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金等八十四只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
杨栋	本基金经理兼任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理	2015-12-18	—	6	硕士,自2011年5月至2015年8月在富国基金管理有限公司任助理行业研究员、行业研究员;自2015年8月起任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理;自2015年12月起任富国低碳新经济混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国低碳新经济混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国低碳新经济混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，管理和运用基金资产，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金

经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 2 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金坚持均衡配置，精选个股的操作风格。本基金在二季度初由于持有 PPP、国际工程类股票较多，导致 4 月份回撤较大，随后增加了新能源汽车、消费电子的配置比例。本基金将继续坚持均衡配置，精选个股的风格，重点在新材料、TMT 等领域寻找有竞争力的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.121 元；份额累计净值为 1.121 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-1.23%，同期业绩比较基准收益率为 3.28%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济展现了较强韧性，在诸多领域依然存在较好的投资机会。

上游资源品和中游制造业领域，受益于供给侧改革、环保、技术革新，优势企业的市场份额进一步提高。仅维持中国经济存量的自然需求，即可使优势企业得到较高的盈利。可以预期在坚持供给侧改革、环保政策的背景下，优势企业的高盈利状态可以维持。

由于房地产财富效应和新兴消费的兴起，消费升级趋势日益明显，优质产品、品牌企业的溢价逐步显现。消费电子、物联网、半导体、新材料等领域的技术进步也给予科技公司良好的成长型。

但资金收紧、风险偏好降低等因素也给证券市场带来一定压力。在此背景下，本基金将重点在优质资源品、具备技术壁垒的优质公司以及高增长行业中寻找投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，

提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题,参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况,本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国低碳新经济混合型证券投资基金

报告截止日:2017年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 (2017年06月30日)	上年度末 (2016年12月31日)
资产:		
银行存款	26,798,641.43	55,283,981.66
结算备付金	2,249,092.31	4,430,272.68

存出保证金	312,626.47	600,148.55
交易性金融资产	432,753,352.83	503,786,767.03
其中：股票投资	432,753,352.83	503,786,767.03
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	4,372,024.91
应收利息	6,630.81	14,208.92
应收股利	—	—
应收申购款	257,141.45	2,365,801.72
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	462,377,485.30	570,853,205.47
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2017年06月30日)	(2016年12月31日)
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	1,877.05	21,281,723.22
应付赎回款	1,572,434.90	4,194,393.99
应付管理人报酬	575,183.26	692,297.36
应付托管费	95,863.86	115,382.89
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	2,384,561.23	1,820,731.30
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	142,673.54	209,129.27
负债合计	4,772,593.84	28,313,658.03
所有者权益：		
实收基金	408,097,831.53	477,953,169.88
未分配利润	49,507,059.93	64,586,377.56
所有者权益合计	457,604,891.46	542,539,547.44
负债和所有者权益总计	462,377,485.30	570,853,205.47

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.121 元，基金份额总额 408,097,831.53 份。

6.2 利润表

会计主体：富国低碳新经济混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日至 2017年06月30日)	上年度可比期间 (2016年01月01日至 2016年06月30日)
一、收入	3,166,798.28	82,915,687.38
1. 利息收入	179,039.45	1,746,964.28
其中：存款利息收入	173,944.85	897,903.99
债券利息收入	—	1,690.29
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	5,094.60	847,370.00
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	6,327,633.85	15,903,503.63
其中：股票投资收益	3,894,343.66	13,404,058.87
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	2,433,290.19	2,499,444.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,838,445.15	64,282,827.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	498,570.13	982,391.74
减：二、费用	11,090,152.28	23,258,822.30
1. 管理人报酬	3,781,762.41	7,315,681.26
2. 托管费	630,293.72	1,219,280.15
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	6,523,134.61	14,560,058.92
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	154,961.54	163,801.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-7,923,354.00	59,656,865.08
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-7,923,354.00	59,656,865.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国低碳新经济混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日至2017年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	477,953,169.88	64,586,377.56	542,539,547.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-7,923,354.00	-7,923,354.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-69,855,338.35	-7,155,963.63	-77,011,301.98
其中: 1. 基金申购款	124,424,830.83	16,010,809.55	140,435,640.38
2. 基金赎回款	-194,280,169.18	-23,166,773.18	-217,446,942.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	408,097,831.53	49,507,059.93	457,604,891.46
项目	上年度可比期间 (2016年01月01日至2016年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,077,330,023.06	4,056,744.13	1,081,386,767.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	59,656,865.08	59,656,865.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-370,137,659.01	-13,548,000.93	-383,685,659.94
其中: 1. 基金申购款	82,924,963.94	-1,955,942.22	80,969,021.72
2. 基金赎回款	-453,062,622.95	-11,592,058.71	-464,654,681.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	707,192,364.05	50,165,608.28	757,357,972.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署;

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国低碳新经济混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2433号文《关于准予富国低碳新经济混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司作为管理人自2015年11月19日至2015年12月16日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2015）验字第60467606_B26号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年12月18日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,076,895,195.86元，在募集期间产生的存款利息为人民币434,827.20元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,077,330,023.06元，折合1,077,330,023.06份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票）、固定收益类资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产）、衍生工具（权证、股指期货）、以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为60%-95%，其中，投资于低碳新经济主题相关股票不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2017

年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018

年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构

中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
----------------------	--------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2017年01月01日至2017年06月30日)		上年度可比期间(2016年01月01日至2016年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	247,147,119.34	5.73	284,979,171.55	2.92
申万宏源	141,745,665.33	3.29	357,350,241.46	3.66

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2017年01月01日至2017年06月30日)		上年度可比期间(2016年01月01日至2016年06月30日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	—	—	750,000,000.00	35.06
申万宏源	—	—	200,000,000.00	9.35

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2017年01月01日至2017年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
申万宏源	132,007.66	3.34	32,033.48	1.34
海通证券	225,226.35	5.71	77,113.09	3.23
关联方名称	上年度可比期间(2016年01月01日至2016年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
申万宏源	332,800.77	3.73	136,228.44	2.54
海通证券	261,725.07	2.94	185,646.05	3.46

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取

证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年06月30日）	上年度可比期间（2016年01月 01日至2016年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	3,781,762.41	7,315,681.26
其中：支付销售机构的客户维护费	1,403,260.52	4,610,073.36

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年06月30日）	上年度可比期间（2016年01月 01日至2016年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	630,293.72	1,219,280.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）		上年度可比期间（2016年01月01日至2016年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	26,798,641.43	144,535.80	61,050,680.54	812,690.94

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	—
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股认购	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	—
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	—
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	—
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	—

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002596	海南瑞泽	2017-05-22	重大事项停牌	8.29	—	—	1,093,145	9,995,297.31	9,062,172.05	—
300340	科恒股份	2017-06-05	重大事项停牌	40.11	—	—	7,438	452,948.47	298,338.18	—

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2017年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2017年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币423,340,182.09元，属于第二层次的余额为人民币9,413,170.74元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	432,753,352.83	93.59
	其中：股票	432,753,352.83	93.59
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资	—	—

	产		
6	银行存款和结算备付金合计	29,047,733.74	6.28
7	其他各项资产	576,398.73	0.12
8	合计	462,377,485.30	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	63,135,622.57	13.80
C	制造业	254,993,454.12	55.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,447,934.50	2.06
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	27,536,368.46	6.02
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,867,657.27	6.09
J	金融业	2,540,613.49	0.56
K	房地产业	22,831,534.70	4.99
L	租赁和商务服务业	41,847.12	0.01
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	11,277.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	24,347,043.00	5.32
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	432,753,352.83	94.57

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600338	西藏珠峰	1,071,643	40,711,717.57	8.90
2	603377	东方时尚	647,700	24,347,043.00	5.32
3	002050	三花智控	1,410,049	23,011,999.68	5.03
4	600622	嘉宝集团	1,402,102	22,826,220.56	4.99
5	600406	国电南瑞	1,283,101	22,646,732.65	4.95

6	002008	大族激光	595,662	20,633,731.68	4.51
7	300274	阳光电源	1,426,426	15,819,064.34	3.46
8	002831	裕同科技	205,248	15,393,600.00	3.36
9	002640	跨境通	679,656	14,442,690.00	3.16
10	300121	阳谷华泰	1,042,499	14,386,486.20	3.14

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600338	西藏珠峰	40,371,619.06	7.44
2	300522	世名科技	35,260,731.56	6.50
3	300335	迪森股份	34,694,454.81	6.39
4	002596	海南瑞泽	33,703,292.72	6.21
5	002466	天齐锂业	31,894,543.07	5.88
6	002008	大族激光	31,754,340.61	5.85
7	300097	智云股份	30,081,140.57	5.54
8	603377	东方时尚	27,812,305.09	5.13
9	002050	三花智控	25,802,782.90	4.76
10	300068	南都电源	24,963,131.56	4.60
11	601668	中国建筑	24,878,640.00	4.59
12	300274	阳光电源	23,035,578.49	4.25
13	600406	国电南瑞	21,875,297.35	4.03
14	000050	深天马 A	21,543,468.90	3.97
15	002564	天沃科技	21,388,033.13	3.94
16	601688	华泰证券	21,249,149.98	3.92
17	600089	特变电工	20,879,325.10	3.85
18	601225	陕西煤业	20,712,309.18	3.82
19	002273	水晶光电	19,858,694.80	3.66
20	601318	中国平安	19,789,242.00	3.65
21	600110	诺德股份	19,339,369.40	3.56
22	002036	联创电子	19,248,273.98	3.55
23	600622	嘉宝集团	18,637,483.02	3.44
24	601117	中国化学	18,468,594.00	3.40
25	300476	胜宏科技	18,367,978.50	3.39
26	002205	国统股份	17,835,915.99	3.29
27	300323	华灿光电	17,672,968.86	3.26
28	000400	许继电气	17,508,016.10	3.23

29	300471	厚普股份	17,460,793.90	3.22
30	600060	海信电器	17,389,713.88	3.21
31	000538	云南白药	17,180,949.90	3.17
32	300346	南大光电	17,132,029.00	3.16
33	002831	裕同科技	17,105,823.68	3.15
34	000807	云铝股份	16,742,323.45	3.09
35	600563	法拉电子	16,171,156.46	2.98
36	603799	华友钴业	15,398,702.36	2.84
37	002384	东山精密	15,375,146.63	2.83
38	002756	永兴特钢	15,241,727.42	2.81
39	600528	中铁工业	15,137,472.00	2.79
40	600021	上海电力	14,842,184.00	2.74
41	300567	精测电子	14,680,395.28	2.71
42	600104	上汽集团	14,361,540.92	2.65
43	300121	阳谷华泰	14,054,352.32	2.59
44	603006	联明股份	13,655,322.20	2.52
45	600884	杉杉股份	13,348,775.00	2.46
46	600614	鹏起科技	13,335,061.96	2.46
47	601766	中国中车	13,322,191.00	2.46
48	600030	中信证券	13,293,442.00	2.45
49	300435	中泰股份	13,128,026.00	2.42
50	002640	跨境通	12,731,632.18	2.35
51	002497	雅化集团	12,585,092.00	2.32
52	600602	云赛智联	12,496,105.94	2.30
53	600546	山煤国际	12,251,744.00	2.26
54	601179	中国西电	12,089,232.00	2.23
55	000639	西王食品	11,764,351.00	2.17
56	002686	亿利达	11,622,735.45	2.14
57	601933	永辉超市	11,518,478.69	2.12
58	600309	万华化学	11,250,266.54	2.07

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002564	天沃科技	59,664,699.03	11.00
2	300401	花园生物	46,916,576.71	8.65
3	600093	易见股份	38,308,835.78	7.06
4	300169	天晟新材	37,946,521.18	6.99
5	300522	世名科技	33,969,062.12	6.26
6	002202	金风科技	32,777,418.30	6.04
7	000608	阳光股份	29,714,925.97	5.48
8	000018	神州长城	28,095,028.78	5.18

9	300097	智云股份	27,587,778.26	5.08
10	601117	中国化学	25,619,109.10	4.72
11	300335	迪森股份	24,238,110.61	4.47
12	601668	中国建筑	23,944,775.98	4.41
13	000921	海信科龙	23,063,126.89	4.25
14	000630	铜陵有色	22,161,140.02	4.08
15	300323	华灿光电	22,048,777.11	4.06
16	002596	海南瑞泽	21,814,928.72	4.02
17	601318	中国平安	21,676,283.77	4.00
18	600338	西藏珠峰	21,662,465.37	3.99
19	601688	华泰证券	21,422,682.59	3.95
20	002466	天齐锂业	21,322,943.84	3.93
21	600089	特变电工	20,823,167.84	3.84
22	300471	厚普股份	20,125,559.82	3.71
23	002036	联创电子	19,438,083.75	3.58
24	600110	诺德股份	18,286,796.20	3.37
25	002180	纳思达	18,062,232.31	3.33
26	000050	深天马 A	18,014,838.43	3.32
27	002273	水晶光电	17,991,396.24	3.32
28	000538	云南白药	17,951,056.79	3.31
29	000400	许继电气	17,558,718.26	3.24
30	000928	中钢国际	17,314,626.53	3.19
31	002384	东山精密	17,270,769.85	3.18
32	000807	云铝股份	16,754,579.45	3.09
33	600060	海信电器	16,710,743.15	3.08
34	002205	国统股份	16,680,763.80	3.07
35	002559	亚威股份	16,188,796.66	2.98
36	600563	法拉电子	16,039,249.49	2.96
37	300567	精测电子	15,907,537.92	2.93
38	300476	胜宏科技	15,673,767.40	2.89
39	002008	大族激光	15,405,045.46	2.84
40	300346	南大光电	15,227,565.63	2.81
41	600104	上汽集团	15,177,095.45	2.80
42	600021	上海电力	14,941,614.40	2.75
43	002511	中顺洁柔	14,848,888.05	2.74
44	300068	南都电源	14,066,839.70	2.59
45	600614	鹏起科技	14,065,682.91	2.59
46	002756	永兴特钢	13,951,472.51	2.57
47	002414	高德红外	13,781,844.45	2.54
48	603006	黎明股份	13,508,427.76	2.49
49	603799	华友钴业	13,459,367.25	2.48

50	600030	中信证券	13,197,387.00	2.43
51	601766	中国中车	13,144,764.25	2.42
52	601933	永辉超市	12,953,931.51	2.39
53	002497	雅化集团	12,537,017.24	2.31
54	300223	北京君正	12,284,577.95	2.26
55	300429	强力新材	12,169,280.64	2.24
56	002686	亿利达	12,004,281.52	2.21
57	000059	华锦股份	11,923,346.51	2.20
58	600703	三安光电	11,817,527.25	2.18
59	601179	中国西电	11,636,801.45	2.14
60	600602	云赛智联	11,517,628.85	2.12
61	300435	中泰股份	11,509,560.03	2.12
62	002024	苏宁云商	11,504,086.47	2.12
63	000639	西王食品	10,986,825.40	2.03

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,121,704,904.97
卖出股票收入（成交）总额	2,192,794,217.68

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	312,626.47
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	6,630.81
5	应收申购款	257,141.45
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	576,398.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
16,022	25,471.09	38,064,592.40	9.33	370,033,239.13	90.67

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	282,181.74	0.0691

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年12月18日)基金份额总额	1,077,330,023.06
报告期期初基金份额总额	477,953,169.88

本报告期基金总申购份额	124,424,830.83
减：本报告期基金总赎回份额	194,280,169.18
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	408,097,831.53

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于 2017 年 4 月 20 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，范伟隽先生不再担任本公司督察长，由赵瑛女士出任公司督察长。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	163,963,787.32	3.80	—	—	—	—	—	—	150,118.27	3.80	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	2	747,718,192.12	17.34	—	—	10,500,000.00	47.95	—	—	681,396.46	17.26	—
东北证券	2	30,930,342.00	0.72	—	—	6,200,000.00	28.31	—	—	28,187.03	0.71	—
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
光大证券	2	314,410,555.53	7.29	—	—	—	—	—	—	286,522.86	7.26	—
广发证券	2	77,651,678.25	1.80	—	—	—	—	—	—	70,763.96	1.79	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	346,356,110.58	8.03	—	—	—	—	—	—	319,525.74	8.09	—
国信证券	1	266,800,738.17	6.19	—	—	—	—	—	—	243,137.09	6.16	—
海通证券	2	247,147,119.34	5.73	—	—	—	—	—	—	225,226.35	5.71	—
华泰证券	1	121,910,025.99	2.83	—	—	—	—	—	—	111,096.78	2.81	—
华信证券	2	637,712,351.40	14.79	—	—	—	—	—	—	581,146.97	14.72	—
瑞银证券	2	9,566,379.72	0.22	—	—	—	—	—	—	8,717.74	0.22	—

上海证券	1	52,934,627.28	1.23	—	—	—	—	—	—	49,298.17	1.25	—
申万宏源	1	141,745,665.33	3.29	—	—	—	—	—	—	132,007.66	3.34	—
太平洋证券	2	19,121,388.45	0.44	—	—	5,200,000.00	23.74	—	—	17,425.29	0.44	—
天风证券	2	89,577,744.39	2.08	—	—	—	—	—	—	81,631.52	2.07	—
西藏东财证券	2	272,642,123.05	6.32	—	—	—	—	—	—	248,458.03	6.29	—
西南证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	195,127,351.84	4.53	—	—	—	—	—	—	177,819.90	4.50	—
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	74,733,289.93	1.73	—	—	—	—	—	—	68,105.89	1.73	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	501,735,645.76	11.64	—	—	—	—	—	—	467,266.70	11.84	—
中信证券（山东）	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中银国际	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：瑞银证券 38166，瑞银证券 004183，天风证券 38652，天风证券 003793，平安证券 002294，平安证券 38173。本报告期本基金退租券商交易单元：德邦证券 24228。其余租用券商交易单元未发生变动。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。