

富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金  
二〇一二年年度报告  
（摘要）

2012年12月31日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2013年03月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2012 年 9 月 4 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国中国中小盘股票（QDII）
基金主代码	100061
交易代码	前端交易代码：100061 后端交易代码：—
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月04日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,746,423.88份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于香港市场中的中国概念中小盘股票，通过精选个股和风险控制，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	通过积极主动的投资，精选香港市场中具有中国概念的优质股票进行投资，分享中国经济快速成长的成果。中小盘股票成长空间大，且往往存在估值洼地，能够为投资者带来超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 (MSCI China Free SMID Index) 收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率 (Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate) ×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	赵会军
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	—	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited

	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		-	香港九龙深旺道一号, 汇丰中心一座六楼
邮政编码		-	无

## 2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2012年9月4日(基金合同生效日)至 2012年12月31日
本期已实现收益	3,090,336.23
本期利润	7,729,933.10
加权平均基金份额本期利润	0.0647
本期基金份额净值增长率	12.50%
3.1.2 期末数据和指标	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0497
期末基金资产净值	48,105,853.54
期末基金份额净值	1.125

注：本基金合同于2012年9月4日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。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
过去三个月	12.50%	0.63%	14.27%	0.69%	-1.77%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	12.50%	0.55%	19.91%	0.74%	-7.41%	-0.19%

注：

本基金合同于 2012 年 9 月 4 日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 (MSCI China Free SMID Index) 收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率 (Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate) ×20%。

MSCI 中国自由投资中小盘股票指数，是由 MSCI 编制的反映在香港上市的中国内地中小企业整体状况的指数。

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<sub>t</sub>) 按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = [\text{MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 } t / (\text{MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 } t-1) - 1] * 80\% + [\text{香港三个月期银行同业拆借利率} / 365] * 20\%;$$

其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， $T$  表示时间截至日；

期间  $T$  日收益率 (benchmark<sub>T</sub>) 按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2,3,4,\dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  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

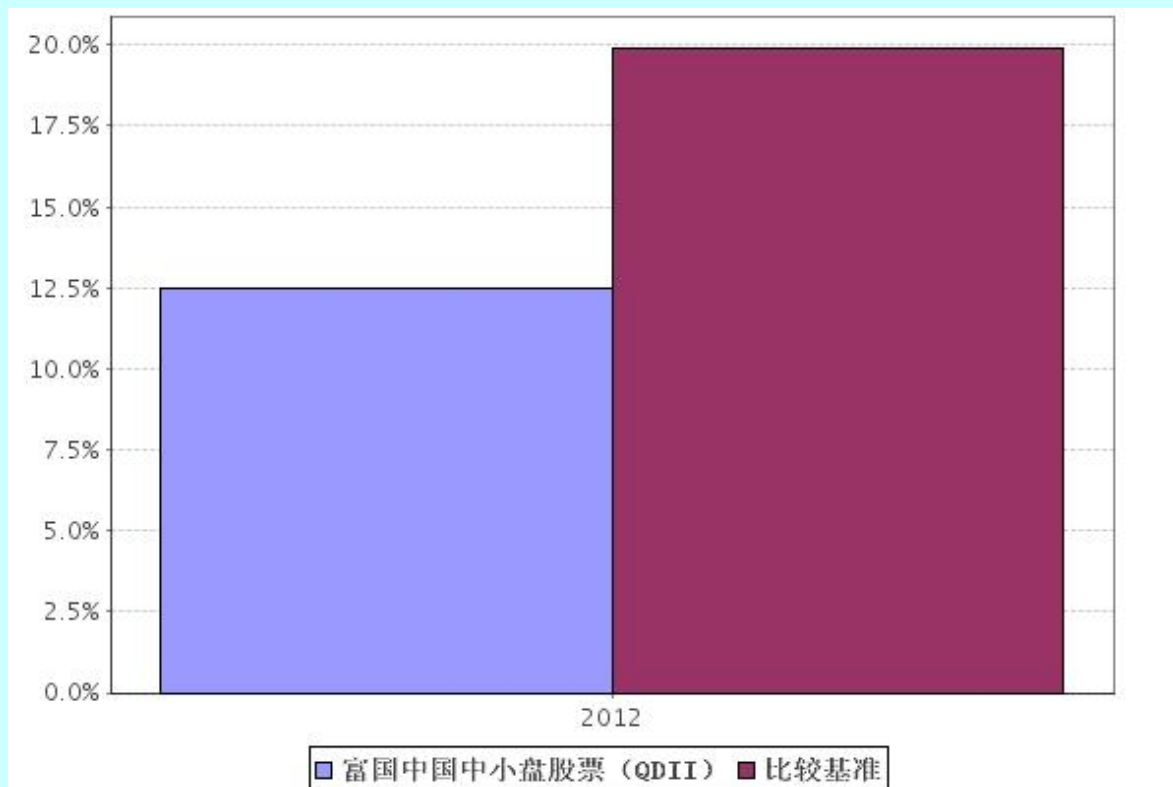


注：截止日期为 2012 年 12 月 31 日。

本基金合同生效日为 2012 年 9 月 4 日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期 6 个月，即从 2012 年 9 月 4 日起至 2013 年 3 月 3 日，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2012年9月4日，2012年净值增长率按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 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。截止2012年12月31日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天源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、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、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、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股票型证券投资基金、富国汇利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、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、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、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金三十二只证券投资基金。

#### 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张峰	本基金基金经理兼任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理	2012-09-04	—	11年	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券股票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，2011年4月至2012年12月起任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月起任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国香港。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中国中小盘（香港上市）股票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》、《富国中国中小盘（香港上市）股票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，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管



理和运用基金资产，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

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，未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。

##### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

##### 4.4.3 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未出现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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经过一年多的筹备，本基金在 12 年 9 月中募集结束后，进入建仓期。在比较短的时间内，我们根据市场在四季度整体向好的实际情况，加快配置，提前完成了建仓。获取了市场向上的收益。展望未来，我们继续看好 2013 年股票市场和香港中资中小盘股票的表现。

在 12 年四季度，香港股票市场开始企稳，但整体经济数据仍然不乐观。本基金 10 月初开始逐步建仓，当时主要思路是寻找业绩确定性好，防御性强的个股，主要集中在医药和消费等防御性强的领域。比如中生制药，中国燃气，同仁堂，科龙电器，海尔电器等。这些股票为组合贡献了较好的收益。

10 月底，中国经济出现企稳反弹迹象。这时，也开始有海外资金流入香港。我们也相应开始调整策略，增加了业绩稳定性高，估值低廉的地产和金融等。其中金融股我们加了重庆农商行，地产股增加了建业，融创等比较绩优股。

随着海外资本的持续流入，和中国宏观数据的持续向好，我们在 12 月继续调整策略。在继续调高金融地产股票的同时，开始对组合里加入弹性高的周期性股票，比如制造和原材料类股票。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.125 元，份额累计净值为 1.125 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 12.50%，同期业绩比较基准收益率为 19.91%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们继续看好 13 年的香港中资中小盘股票。在大的宏观层面，随着美国房产的反弹，欧洲金融债务市场的稳定，困扰全球金融市场达 2-3 年之久的美国房屋次债危机和欧债危机开始明显缓解。中国通胀得到较好控制，经济在去年三季度见底回升，我们感到 2013 年全球经济在恢复增长。在这个大的宏观背景下，我们看好中资银行证券和地产股票，结合经济走势，我们会逐步增加业绩反弹力度大的周期类股票的配置，继续持有一些有长期增长潜力的消费和医药股票。

年初，中国证监会主席郭树清在香港发表讲话，中国正在研究 QDII2，也就是逐步放开个人海外投资。如果在年内有进展，香港中小盘基金将是主要受益者。香港中资中小盘是中国的增长，低于成熟市场的估值。过去几年盈利增长都在 20%左右，目前估值还只有 2013 年 10 倍市盈率。

高成长和低估值，是我们对香港中资中小盘未来表现的信心所在。

## 4.7 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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金《基金合同》约定，本基金本期不进行收益分配。

### **§ 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**

2012年，本基金托管人在对富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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**

2012年，富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国全球顶级消费品股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国全球顶级消费品股票型证券投资基金未进行利润分配。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部  
2013年3月22日

### **§ 6 审计报告**

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。  
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

### **§ 7 年度财务报表**

#### **7.1 资产负债表**

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2012年12月31日)
<b>资 产:</b>	
银行存款	3,905,928.83
结算备付金	463,636.36
存出保证金	—
交易性金融资产	44,512,743.54
其中：股票投资	44,512,743.54
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	1,021,895.65
应收利息	1,139.93
应收股利	13,073.95
应收申购款	2,221,534.68
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	52,139,952.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2012年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>	
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	—
应付赎回款	3,773,909.02
应付管理人报酬	72,393.48
应付托管费	13,573.76
应付销售服务费	—
应付交易费用	—
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	174,223.14
负债合计	4,034,099.40
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	42,746,423.88
未分配利润	5,359,429.66
所有者权益合计	48,105,853.54

负债和所有者权益总计	52,139,952.94
------------	---------------

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.125元，基金份额总额42,746,423.88份。

本基金合同于2012年9月4日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金

本报告期：2012年09月04日（基金合同生效日）至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012 年12月31日
<b>一、收入</b>	8,950,448.60
1. 利息收入	640,678.02
其中：存款利息收入	114,447.89
债券利息收入	—
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	526,230.13
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,272,203.75
其中：股票投资收益	3,189,726.13
基金投资收益	-2,312.70
债券投资收益	—
资产支持证券投资收益	—
衍生工具投资收益	—
股利收益	84,790.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,639,596.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	130,041.66
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	267,928.30
<b>减：二、费用</b>	1,220,515.50
1. 管理人报酬	644,851.64
2. 托管费	120,909.65
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	292,772.71
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 其他费用	161,981.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	7,729,933.10
减：所得税费用	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	7,729,933.10

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金

本报告期：2012年09月04日（基金合同生效日）至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31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）	249,999,292.07	—	249,999,292.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	—	7,729,933.10	7,729,933.10
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）	-207,252,868.19	-2,370,503.44	-209,623,371.63
其中：1. 基金申购款	4,358,812.00	359,182.25	4,717,994.25
2. 基金赎回款	-211,611,680.19	-2,729,685.69	-214,341,365.88
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）	42,746,423.88	5,359,429.66	48,105,853.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

竇玉明

林志松

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金（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[2012]955号文《关于核准富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人于2012年8月13日至2012年8月31日向社会公开募集，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（2012）验字第60467606\_B07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2012年9月4日生效。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 249,984,421.82 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 14,870.25 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 249,999,292.07 元，折合 249,999,292.07 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司（The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited）。

本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含 ETF）、债券、货币市场工具、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关要求）。

本基金为股票型基金，投资于股票及其他权益类资产的比例不低于基金资产的 60%。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将以不低于股票资产的 80%投资于在香港证券市场交易的中小盘中国概念股。

本基金的业绩基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 (MSCI China Free SMID Index) 收益率  $\times$  80% + 香港三个月期银行同业拆借利率 (Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate)  $\times$  20%。

#### 7.4.2 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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指南指引》、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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 9 月 4 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2012年9月4日（基金合同生效日）起至2012年12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资和基金投资；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基



金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

本基金持有的基金投资和股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；
- (2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值；
- (3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；
- (2) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；
- (3) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

- (4) 基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认,并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账;
- (5) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;
- (6) 股票股利收益于除息日确认,并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账;基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认;
- (7) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;
- (8) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.60%的年费率逐日计提;
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.30%的年费率逐日计提;
- (3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%,若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- (2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- (3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
- (4) 每一基金份额享有同等分配权;
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税；
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收营业税和企业所得税；
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司(“汇丰银行”)	基金境外托管行
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
申银万国证券股份有限公司(“申银万国”)	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
香港上海汇丰银行有限公司	43,938,382.21	24.83

#### 7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.3 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券股份有限公司	248,200,000.00	13.73
申银万国证券股份有限公司	319,900,000.00	17.70

#### 7.4.8.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
香港上海汇丰银行有限公司	448,334.37	24.94

#### 7.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31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(%)
香港上海汇丰银行有限公司	17,754.58	17.88	—	—

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	644,851.64
其中：支付销售机构的客户维护费	176,302.21

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.60%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.60\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	120,909.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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于本报告期末未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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	
	2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,038,062.34	103,380.85
香港上海汇丰银行有限公司	867,866.49	—

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金自2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。



### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期无需要说明的其他事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	44,512,743.54	85.37
	其中：普通股	44,512,743.54	85.37
	存托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
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	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,369,565.19	8.38
8	其他各项资产	3,257,644.21	6.25
9	合计	52,139,952.94	100.00

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	44,512,743.54	92.53

合计	44,512,743.54	92.53
----	---------------	-------

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	13,724,124.38	28.53
金融	11,110,996.46	23.10
医疗保健	6,365,748.20	13.23
材料	3,673,024.84	7.64
公用事业	3,675,315.48	7.64
工业	3,219,844.82	6.69
必需消费品	1,264,804.37	2.63
能源	823,880.36	1.71
信息技术	655,004.63	1.36
合计	44,512,743.54	92.53

### 8.4 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	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允 价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	HISENSE KELON ELEC HLD-H	海信科龙	921 HK	香港交易所	中国香港	1384000	3,736,980.61	7.77
2	SINO BIOPHARMACEU TICAL	中国生物制药	1177 HK	香港交易所	中国香港	752000	2,256,109.04	4.69
3	LIJUN INTL PHARMACETL HLDG	利君国际	2005 HK	香港交易所	中国香港	1086000	2,025,341.13	4.21
4	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港交易所	中国香港	476000	1,956,840.52	4.07
5	CHINA MINSHENG BANKING-H	民生银行	1988 HK	香港交易所	中国香港	227000	1,649,204.03	3.43
6	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业银行	3618 HK	香港交易所	中国香港	452000	1,553,977.81	3.23
7	LE SAUNDA HOLDINGS	利信达集团	738 HK	香港交易所	中国香港	662000	1,368,795.89	2.85
8	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港交易所	中国香港	172000	1,242,643.84	2.58

9	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	建业地产	832 HK	香港交易所	中国香港	517000	1,148,633.89	2.39
10	TONG REN TANG TECHNOLOGIES -H	同仁堂科技	1666 HK	香港交易所	中国香港	82000	1,138,303.66	2.37

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年度报告正文

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	CHINA MINSHENG BANKING-H	1988 HK	4,270,173.44	8.88
2	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	3,643,112.56	7.57
3	HISENSE KELON ELEC HLD-H	921 HK	3,340,005.88	6.94
4	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	2,727,884.52	5.67
5	MINTH GROUP LTD	425 HK	2,726,321.62	5.67
6	CPMC HOLDINGS LTD	906 HK	2,723,467.07	5.66
7	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	1910 HK	2,636,635.16	5.48
8	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	2,531,281.45	5.26
9	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	2,526,076.36	5.25
10	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	2,351,433.38	4.89
11	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	2,318,811.51	4.82
12	SINO BIOPHARMACEUTICA L	1177 HK	2,313,250.46	4.81
13	LIJUN INTL PHARMACETL HLDG	2005 HK	2,065,189.19	4.29
14	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	1666 HK	2,019,205.54	4.20
15	LE SAUNDA HOLDINGS	738 HK	1,937,480.30	4.03



16	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	1,905,974.35	3.96
17	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	1,890,823.02	3.93
18	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	178 HK	1,746,799.42	3.63
19	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	1,742,243.40	3.62
20	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1169 HK	1,692,898.81	3.52
21	DONGYUE GROUP	189 HK	1,600,853.12	3.33
22	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	1,536,566.98	3.19
23	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	1,464,654.25	3.04
24	TOWNGAS CHINA CO LTD	1083 HK	1,448,790.34	3.01
25	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	3998 HK	1,317,678.33	2.74
26	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	1,310,743.80	2.72
27	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	1,285,536.31	2.67
28	FRANSHION PROPERTIES	817 HK	1,281,942.39	2.66
29	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	1086 HK	1,250,172.47	2.60
30	LONKING HOLDINGS LTD	3339 HK	1,244,473.22	2.59
31	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	832 HK	1,199,339.19	2.49
32	MONGOLIAN MINING CORP	975 HK	1,093,418.55	2.27
33	TIANJIN JINRAN PUBLIC UTIL-H	1265 HK	1,037,829.65	2.16
34	COSCO PACIFIC LTD	1199 HK	1,037,391.09	2.16
35	BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY	963 HK	993,522.72	2.07
36	BEIJING JINGKELONG CO LTD-H	814 HK	988,686.37	2.06

### 8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	CHINA MINSHENG BANKING-H	1988 HK	3,053,497.34	6.35
2	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	2,506,771.61	5.21
3	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	2,498,424.04	5.19
4	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	2,424,997.74	5.04
5	CPMC HOLDINGS LTD	906 HK	2,323,392.18	4.83
6	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	1910 HK	2,179,379.24	4.53
7	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	2,101,142.39	4.37
8	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	178 HK	2,021,889.57	4.20
9	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	1,912,702.51	3.98
10	MINTH GROUP LTD	425 HK	1,668,007.29	3.47
11	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	1,521,319.92	3.16
12	TOWNGAS CHINA CO LTD	1083 HK	1,439,697.12	2.99
13	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	1,431,172.89	2.98
14	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1169 HK	1,345,606.82	2.80
15	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	1,318,179.59	2.74
16	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	1,240,210.71	2.58
17	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	1666 HK	1,172,869.99	2.44
18	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	1,080,945.05	2.25
19	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	3998 HK	1,047,607.14	2.18
20	COSCO PACIFIC LTD	1199 HK	1,025,402.63	2.13
21	LONKING HOLDINGS LTD	3339 HK	1,015,432.25	2.11
22	WUMART STORES INC-H	1025 HK	982,280.88	2.04
23	DONGYUE GROUP	189 HK	978,001.08	2.03

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	106,802,351.21
卖出收入（成交）总额	70,118,930.67

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.11.2 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。

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 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	—
2	应收证券清算款	1,021,895.65
3	应收股利	13,073.95
4	应收利息	1,139.93
5	应收申购款	2,221,534.68
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,257,644.21

### 8.11.4 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处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 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不存在流通受限情况。

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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(%)
845	50,587.48	9,999,200.00	23.39	32,747,223.88	76.61

### 9.2 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	99,069.01	0.2318

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年09月04日)基金份额总额	249,999,292.07
本报告期(2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)基金总申购份额	4,358,812.00
减：本报告期(2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)基金总赎回份额	211,611,680.19
本报告期(2012年9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	42,746,423.88

注：本基金合同于2012年9月4日生效。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## **11.2 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，基金管理人经中国证监会核准聘任范伟隽先生担任公司督察长，李长伟先生不再担任公司督察长。

## **11.3 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。

## **11.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

## **11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 4 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 10 年。

## **11.6 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、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 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		基金交易		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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
CCB International	—	127,982.81	0.07	—	—	—	—	—	—	—	—	191.97	0.19	—
China Everbright Securities (HK) Limited	—	9,958,407.81	5.63	—	—	—	—	—	—	—	—	11,950.07	12.03	—
DBS Vickers	—	4,071,029.17	2.30	—	—	—	—	—	—	—	—	4,071.04	4.10	—
Goldman Sachs	—	16,896,475.15	9.55	—	—	—	—	—	—	—	—	8,448.28	8.51	—
HSBC	—	43,938,382.21	24.83	—	—	—	—	—	—	448,334.37	24.94	17,754.58	17.88	—
HAITONG INTERNATIONAL	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	—	50,129,796.07	28.33	—	—	—	—	—	—	749,774.04	41.71	25,439.94	25.62	—

UBS Securities Asia Limited	—	27,578,567.21	5.59	—	—	—	—	—	—	—	—	16,547.13	16.66	—
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	—	24,220,641.68	3.69	—	—	—	—	—	—	599,514.21	33.35	14,892.12	15.00	—
安信证券	1	—	—	—	—	8,000,000.00	0.44	—	—	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	269,700,000.00	14.92	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	217,700,000.00	12.04	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	248,200,000.00	13.73	—	—	—	—	—	—	—
宏源证券	1	—	—	—	—	81,000,000.00	4.48	—	—	—	—	—	—	—
红塔证券	1	—	—	—	—	90,000,000.00	4.98	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	572,900,000.00	31.70	—	—	—	—	—	—	—
申银万国	1	—	—	—	—	319,900,000.00	17.70	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：1. 我公司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。

2. 基金债券回购交易与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）共用交易单元。本报告期本基金退租券商交易单元：中邮证券

24977。本报告期本基金新增券商交易单元：广发证券 26138；国信证券 26178；宏源证券 26642。其余租用券商交易单元未发生变动。



