

富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金二〇一

六年第 4 季度报告

2016-12-31

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

报告送出日期：2017-01-21

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

本报告期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

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

期末积极投资按行业分类的权益投资组合

报告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及存托凭证投资明细

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告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

报告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

报告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

报告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

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分
开放式基金份额变动
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

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 2017 年 1 月 19 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

富国中国中小盘混合（QDII）

场内简称

基金主代码

100061

前端交易主代码

100061

后端交易代码

000162

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2012-09-04

报告期末基金份额总额

1,093,142,129.13

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。

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

境外资产托管人

英文名称：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited

中文名称：香港上海汇丰银行有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期（2016-10-01 至 2016-12-31）

本期已实现收益

31,110,569.07

本期利润

-8,016,583.94

加权平均基金份额本期利润

-0.0073

期末基金资产净值

1,849,130,190.51

期末基金份额净值

1.692

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。

基金净值表现

本报告期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

净值增长率①

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

-0.64%

0.70%

-1.35%

0.67%

0.71%

0.03%

注：过去三个月指 2016 年 10 月 1 日—2016 年 12 月 31 日。

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

注：1、截止日期为 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2012 年 9 月 4 日成立，建仓期 6 个月，从 2012 年 9 月 4 日起至 2013 年 3 月 3 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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海外权益投资部总经理、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理

2012-09-04

-

15

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混合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）混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月起任兼任海外权益投资部总经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；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。

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名

在境外投资顾问所任职务

证券从业年限

说明

注：本基金无境外投资顾问。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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)混合型证券投资基金的管理人按照《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)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，以尽可能减少和分散投资风险、确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，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

公平交易专项说明

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。

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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无需要说明的相关情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

序号
项目
金额（元）
占基金总资产的比例（%）

1

权益投资

1,581,501,438.86

84.65

其中：普通股

1,581,501,438.86

84.65

存托凭证

-

-

2

基金投资

0.00

0.00

3

固定收益投资

0.00

0.00

其中：债券

0.00

0.00

资产支持证券

0.00

0.00

4

金融衍生品投资

0.00

0.00

其中：远期

0.00

0.00

期货

-

-

期权

-

0.00

权证

0.00

0.00

5

买入返售金融资产

0.00

0.00

其中：买断式回购的买入返售金融资产

0.00

0.00

6

货币市场工具

-

0.00

7

银行存款和结算备付金合计

257,004,240.82

13.76

8

其他各项资产

29,795,839.03

1.59

9

合计

1,868,301,518.71

100.00

注：{{BGQMJJZCZHQKBeiZhu_QM)!}}

报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

中国香港

1,496,556,854.11

80.93

美国

84,944,584.75

4.59

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

非日常生活消费品

452,864,626.32

24.49

工业

337,768,042.13

18.27

金融
247,558,378.86
13.39
信息技术
139,856,685.34
7.56
原材料
123,960,837.84
6.70
医疗保健
83,356,613.94
4.51
房地产
74,115,556.34
4.01
公用事业
63,647,197.12
3.44
能源
45,055,052.13
2.44
日常消费品
9,530,109.54
0.52
电信业务
3,788,339.30
0.20
合计
1,581,501,438.86
85.53

报告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及存托凭证投资明细

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT

吉利汽车

175 HK

香港交易所

中国香港

7,795,000.00

51,667,747.38

2.79

2

BEIJING URBAN CONSTRUCTION-H

城建集团

1599 HK

香港交易所

中国香港

11,611,000.00

49,853,546.93

2.70

3

DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H

东江环保

895 HK

香港交易所

中国香港

3,797,025.00

45,852,437.24

2.48

4

CHINASOFT INTERNATIONAL LTD

中国软件国际

354 HK

香港交易所

中国香港

13,502,000.00

43,962,733.43

2.38

5

POLY CULTURE GROUP CORP-H

保利文化

3636 HK

香港交易所

中国香港

2,452,400.00

41,504,734.45

2.24

6

GUANGDONG YUEYUN TRANSPORTAT

南粤物流

3399 HK

香港交易所

中国香港

10,997,000.00

41,413,460.44

2.24

7

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H

福耀玻璃

3606 HK

香港交易所

中国香港

1,888,800.00

40,633,689.24

2.20

8

HOPEFLUENT GROUP HLDGS LTD

合富辉煌

733 HK

香港交易所

中国香港

19,686,000.00

37,860,046.30

2.05

9

DAWNRAYS PHARMACEUTICAL HOLD

东瑞制药

2348 HK

香港交易所

中国香港

8,960,000.00

37,349,012.74

2.02

10

MINTH GROUP LTD

敏实集团

425 HK

香港交易所

中国香港

1,448,000.00

31,280,299.10

1.69

报告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。

报告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
序号

债券代码

债券名称

数量

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

报告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。

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。

报告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

序号

基金名称

基金类型

运作方式

管理人

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有基金。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

1,898,779.87

2

应收证券清算款

17,886,773.12

3

应收股利

127,287.16

4

应收利息

40,250.98

5

应收申购款

9,842,747.90

6

其他应收款

0.00

7

待摊费用

0.00

9

其他

0.00

10

合计

29,795,839.03

报告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。

报告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。

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。

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

1,050,064,611.28

报告期期间基金总申购份额

321,034,892.41

减：报告期期间基金总赎回份额

277,957,374.56

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

0.00

报告期期末基金份额总额

1,093,142,129.13

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

注：本报告期本基金的管理人未运用自有资金申赎及买卖本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金的文件
- 2、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金基金合同
- 3、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>