

富国天惠精选成长混合型证券投资基金

二〇一七年半年度报告

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： 中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6	半年度财务报表(未经审计).....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
§7	投资组合报告.....	34
7.1	期末基金资产组合情况.....	34
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	42

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
§8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末上市基金前十名持有人	44
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.4	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	44
§9	开放式基金份额变动	44
§10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
§11	影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
§12	备查文件目录	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天惠精选成长混合型证券投资基金		
基金简称	富国天惠成长混合（LOF）		
场内简称	富国天惠		
基金主代码	161005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005年11月16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	2,062,526,047.91份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2006年2月16日		
下属两级基金的基金简称	富国天惠成长混合 A/B(LOF)	富国天惠成长混合C(LOF)	
下属两级基金场内简称	富国天惠	—	
下属两级基金的交易代码	前端	后端	003494
	161005	161006	
报告期末下属两级基金的份额总额	2,059,653,366.28份	2,872,681.63份	

注：富国基金管理有限公司于2017年3月23日发布公告，对富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）增加收取销售服务费的场外份额——C类份额，并对本基金的《基金合同》做相应修改，C类份额不上市交易。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性且合理定价的股票，在利用金融工程技术控制组合风险的前提下，谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采用主动投资管理策略，基于“快速成长、合理定价”的选股标准精选个股，并在坚持以基本面研究驱动投资的基础上进行适度的选时操作，争取投资收益的最大化。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×25%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于具有良好成长性且合理定价的股票，风险和预期收益匹配，属于风险适中的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长。

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	赵瑛	郭明
	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
注册地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		薛爱东	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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

(1) 富国天惠成长混合 A/B (LOF)

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	85,280,465.75
本期利润	470,570,485.03
加权平均基金份额本期利润	0.2255
本期加权平均净值利润率	12.97%
本期基金份额净值增长率	13.49%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)
期末可供分配利润	1,827,523,437.99
期末可供分配基金份额利润	0.8873
期末基金资产净值	3,887,176,804.27
期末基金份额净值	1.8873
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)
基金份额累计净值增长率	918.72%

(2) 富国天惠成长混合 C(LOF)

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	66,227.13
本期利润	249,939.13
加权平均基金份额本期利润	0.1927
本期加权平均净值利润率	10.73%
本期基金份额净值增长率	6.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)
期末可供分配利润	2,448,285.80
期末可供分配基金份额利润	0.8523
期末基金资产净值	5,427,500.20
期末基金份额净值	1.8893
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)
基金份额累计净值增长率	6.29%

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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

(1) 富国天惠成长混合 A/B(LOF)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

		差②	③	④		
过去一个月	7.88%	0.78%	3.71%	0.47%	4.17%	0.31%
过去三个月	6.69%	0.80%	4.03%	0.44%	2.66%	0.36%
过去六个月	13.49%	0.76%	6.92%	0.40%	6.57%	0.36%
过去一年	11.35%	0.76%	10.30%	0.47%	1.05%	0.29%
过去三年	109.77%	1.97%	47.66%	1.21%	62.11%	0.76%
自基金合同生效日起至今	918.72%	1.66%	243.45%	1.26%	675.27%	0.40%

(2) 富国天惠成长混合 C (LOF)

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	7.86%	0.78%	3.71%	0.47%	4.15%	0.31%
过去三个月	6.81%	0.80%	4.03%	0.44%	2.78%	0.36%
自基金合同生效日起至今	6.29%	0.80%	4.20%	0.43%	2.09%	0.37%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×25%+同业存款利率×5%。沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债综合指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

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：

$$\text{benchmark}_t = 70\% * [\text{沪深300指数}_t / (\text{沪深300指数}_{t-1}) - 1] + 25\% * [\text{中债综合全价指数}_t / (\text{中债综合全价指数}_{t-1}) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360;$$

其中，t=1, 2, 3, ..., 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：

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

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark_t)数学连乘。

本基金C类份额自分级生效日起至本报告期末不足半年，自基金分级生效日起至指2017年3月23日—2017年6月30日。

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

(1) 自基金合同生效以来富国天惠成长混合 A/B (LOF) 基金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2005年11月16日成立，建仓期6个月，从2005年11月16日起至2006年5月15日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国天惠成长混合C(LOF)基金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 2005 年 11 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2005 年 11 月 16 日起至 2006 年 5 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3、本基金于 2017 年 3 月 23 日起增加收取销售服务费的场外份额——C 类份额。

§ 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱少醒	本基金基金经理兼任副总经理、权益投资部总经	2005-11-16	—	17	博士，曾任华夏证券研究所分析师，2000 年 6 月起曾先后担任富国基金管理有限公司分析师、产品开发主管，2004 年 6 月至 2005 年 8 月任富国天益价值证券投资

	理				基金基金经理助理，2008年11月至2010年1月任汉盛证券投资基金基金经理；2005年11月至今任富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，现兼任副总经理、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天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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》、《富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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3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

今年上半年，中国实体经济表现强劲，出口、房地产销售超预期。消费、基建投资也保持了较高的增速。企业盈利回升强劲，带动了优质龙头企业的股价有很好的表现。中小市值的股票受估值回落和盈利不达预期的影响，整体下跌幅度较大。本基金上半年保持了较高的仓位，组合集中在成长型风格资产上。稳健成长类股票超额收益显著，而小盘成长股的估值中枢是向下的，本基金的配置比较均衡。

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A级为1.8873元，C级为1.8893元；份额累计净值A级为4.5753元，C级为1.8893元；本报告期，本基金份额净值增长率A级为13.49%，C级为6.29%，同期业绩比较基准收益率A级为6.92%，C级为4.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为实体经济的回升会有一定的延续性。企业盈利可以保持乐观预期。在去杠杆的大背景下，流动性环境会比上半年偏紧。投资者对企业质地、经营抗风险能力、增长的质量会有更高的要求，优质企业可能在今年全年都能获得溢价。个股选择层面，本基金偏好投资于具有良好“企业基因”，公司治理结构完善、管理层优秀的企业。分享企业自身增长带来的资本市场收益是成长型基金取得收益的最佳途径。

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

本报告期内，本基金托管人在对富国天惠精选成长混合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

本报告期内，富国天惠精选成长混合型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国天惠精选成长混合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，富国天惠精选成长混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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的富国天惠精选成长混合型证券投资基金 2017 年半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。

中国工商银行资产托管部

2017 年 8 月 22 日

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天惠精选成长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	210,866,131.62	205,645,474.88
结算备付金	6,602,017.69	5,886,587.84
存出保证金	865,623.96	674,406.02
交易性金融资产	3,673,683,833.77	3,466,340,681.87
其中：股票投资	3,673,390,285.97	3,466,340,681.87
基金投资	—	—
债券投资	293,547.80	—
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	13,315,180.77	—
应收利息	42,301.01	49,744.44
应收股利	—	—
应收申购款	5,903,153.41	2,873,256.25
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	3,911,278,242.23	3,681,470,151.30
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	—	13,252.19
应付赎回款	9,176,455.49	44,270,357.95
应付管理人报酬	4,608,824.52	4,756,118.78
应付托管费	768,137.43	792,686.46
应付销售服务费	2,368.89	—
应付交易费用	3,851,464.13	3,183,683.35
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	266,687.30	368,573.27
负债合计	18,673,937.76	53,384,672.00
所有者权益：		
实收基金	2,062,526,047.91	2,181,612,107.49
未分配利润	1,830,078,256.56	1,446,473,371.81
所有者权益合计	3,892,604,304.47	3,628,085,479.30
负债和所有者权益总计	3,911,278,242.23	3,681,470,151.30

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8873 元，基金份额总额 2,062,526,047.91 份。其中：富国天惠成长混合 A/B(LOF)份额净值 1.8873 元，份额总额 2,059,653,366.28 份；富国天惠成长混合 C(LOF)份额净值 1.8893 元，份额总额 2,872,681.63 份。

6.2 利润表

会计主体：富国天惠精选成长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	516,089,202.80	-426,405,864.15
1. 利息收入	874,672.86	1,290,785.43
其中：存款利息收入	850,862.46	879,652.48
债券利息收入	518.99	411,132.95
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	23,291.41	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	128,617,251.04	-320,037,424.20
其中：股票投资收益	108,888,485.96	-336,945,196.01
基金投资收益	—	—
债券投资收益	144,532.73	143,968.12
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	19,584,232.35	16,763,803.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	385,473,731.28	-108,503,465.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,123,547.62	844,239.99
减：二、费用	45,268,778.64	46,165,447.68
1. 管理人报酬	26,950,550.84	26,723,630.96
2. 托管费	4,491,758.45	4,453,938.50
3. 销售服务费	4,940.99	—
4. 交易费用	13,583,148.30	14,749,022.83
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	238,380.06	238,855.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	470,820,424.16	-472,571,311.83
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	470,820,424.16	-472,571,311.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天惠精选成长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）	2,181,612,107.49	1,446,473,371.81	3,628,085,479.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	470,820,424.16	470,820,424.16
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）	-119,086,059.58	-87,215,539.41	-206,301,598.99
其中：1. 基金申购款	395,831,792.99	299,092,945.40	694,924,738.39
2. 基金赎回款	-514,917,852.57	-386,308,484.81	-901,226,337.38
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）	2,062,526,047.91	1,830,078,256.56	3,892,604,304.47
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）	1,457,315,912.24	2,588,262,818.30	4,045,578,730.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-472,571,311.83	-472,571,311.83
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）	828,405,246.02	739,627,658.70	1,568,032,904.72
其中：1. 基金申购款	1,245,182,322.97	1,001,202,326.08	2,246,384,649.05
2. 基金赎回款	-416,777,076.95	-261,574,667.38	-678,351,744.33
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）	—	-1,266,641,529.16	-1,266,641,529.16
五、期末所有者权益（基金净值）	2,285,721,158.26	1,588,677,636.01	3,874,398,794.27

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

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

富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）（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”）证监基金字[2005]143号文《关于同意富国天惠精选成长混合型证券投资基金募集的批复》、基金字[2005]152号《关于同意富国天惠精选成长混合型证券投资基金变更为上市开放式基金（LOF）的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2005年11月16日正式生效，首次设立募集规模为584,312,553.76份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中债券部分包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）以及中国证监会允许基金投资的其他债券。基金股票部分主要投资于具有良好成长性且合理定价的上市公司股票。本基金投资组合中的股票投资比例浮动范围为：50%-95%；债券和短期金融工具的投资比例浮动范围为：5%-50%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%。投资于具有良好成长性且合理定价的上市公司股票的比例不低于基金股票投资的80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×25%+同业存款利率×5%。

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

本基金本期未发生重大会计差错，无需更正。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2017 年 06 月 30 日）
活期存款	210,866,131.62
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计	210,866,131.62

6.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2017年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,154,653,990.67	3,673,390,285.97	518,736,295.30
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	293,547.80	39,547.80
	银行间市场	—	—
	合计	293,547.80	39,547.80
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	3,154,907,990.67	3,673,683,833.77	518,775,843.10

6.4.7.3衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2017年06月30日）
应收活期存款利息	39,195.93
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,673.81
应收债券利息	80.72
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	350.55
合计	42,301.01

6.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2017年06月30日）
交易所市场应付交易费用	3,851,464.13
银行间市场应付交易费用	—

合计	3,851,464.13
----	--------------

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2017年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	38,580.24
预提上市年费	29,752.78
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	148,765.71
合计	266,687.30

6.4.7.9实收基金

富国天惠成长混合 A/B(LOF)：

金额单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,181,612,107.49	2,181,612,107.49
本期申购	391,625,949.44	391,625,949.44
本期赎回（以“-”号填列）	-513,584,690.65	-513,584,690.65
本期末	2,059,653,366.28	2,059,653,366.28

富国天惠成长混合 C(LOF)：

金额单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	4,205,843.55	4,205,843.55
本期赎回（以“-”号填列）	-1,333,161.92	-1,333,161.92
本期末	2,872,681.63	2,872,681.63

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

富国天惠成长混合 A/B(LOF)：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,044,710,875.01	-598,237,503.20	1,446,473,371.81
本期利润	85,280,465.75	385,290,019.28	470,570,485.03
本期基金份额交易产生的变动数	-109,395,412.35	19,874,993.50	-89,520,418.85
其中：基金申购款	371,365,821.65	-75,653,949.31	295,711,872.34
基金赎回款	-480,761,234.00	95,528,942.81	-385,232,291.19

本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,020,595,928.41	-193,072,490.42	1,827,523,437.99

富国天惠成长混合 C(L0F):

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	66,227.13	183,712.00	249,939.13
本期基金份额交易产生的变动数	2,382,058.67	-77,179.23	2,304,879.44
其中: 基金申购款	3,494,187.29	-113,114.23	3,381,073.06
基金赎回款	-1,112,128.62	35,935.00	-1,076,193.62
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,448,285.80	106,532.77	2,554,818.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 (2017年01月01日至2017年06月30日)
活期存款利息收入	776,284.52
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	57,721.14
其他	16,856.80
合计	850,862.46

6.4.7.12 股票投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 (2017年01月01日至2017年06月30日)
卖出股票成交总额	4,613,352,272.10
减: 卖出股票成本总额	4,504,463,786.14
买卖股票差价收入	108,888,485.96

6.4.7.13 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 (2017年01月01日至2017年06月30日)
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	5,143,971.00
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	4,999,000.00
减: 应收利息总额	438.27
买卖债券差价收入	144,532.73

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）
股票投资产生的股利收益	19,584,232.35
基金投资产生的股利收益	—
合计	19,584,232.35

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）
1. 交易性金融资产	385,473,731.28
股票投资	385,434,183.48
债券投资	39,547.80
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	385,473,731.28

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）
基金赎回费收入	1,109,247.19
转换费	14,300.43
合计	1,123,547.62

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）
交易所市场交易费用	13,583,148.30
银行间市场交易费用	—
合计	13,583,148.30

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	1,273.00
账户维护费	9,000.00
上市费	29,752.78
合计	238,380.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除6.4.6 税项中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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	1,018,902,859.91	11.40	2,129,910,521.78	21.55
申万宏源	296,393,280.99	3.32	69,326,632.15	0.70

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.5 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（%）
海通证券	930,318.36	11.37	127,396.97	3.31
申万宏源	276,032.18	3.37	56,775.58	1.47
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（%）
海通证券	1,952,631.85	21.52	1,602,768.38	35.24
申万宏源	64,563.47	0.71	20,170.66	0.44

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	26,950,550.84	26,723,630.96
其中：支付销售机构的客户维护费	3,337,885.46	4,256,427.72

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至	上年度可比期间（2016年01月
----	-----------------	------------------

	2017年06月30日)	01日至2016年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	4,491,758.45	4,453,938.50

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2017年01月01日至2017年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	4,673.86	4,673.86
中国工商银行	—	267.13	267.13
合计	—	4,940.99	4,940.99

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2016年01月01日至2016年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	—	0.00
合计	—	—	0.00

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年率为0.80%，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.8%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

销售服务费每日计提，逐累至月末，按月支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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
中国工商银行股份有限公司	210,866,131.62	776,284.52	217,238,060.19	718,498.54

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 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
002640	跨境通	2016-09-14	2017-09-19	非公开发行股票	14.81	19.77	678,596	10,050,006.76	13,415,842.92	—
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	—
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	—
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	—
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	—

6.4.12.2 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
000034	神州数码	2017-03-21	重大事项停牌	23.09	2017-07-18	22.01	1,000,000	24,943,989.40	23,090,000.00	—
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项停牌	12.08	2017-07-06	12.61	5,000,000	59,314,036.58	60,400,000.00	—
002464	金利科技	2017-01-23	重大事项停牌	40.09	2017-	38.82	222,240	9,547,536.61	8,909,601.60	—

					07-26					
002694	顾地科技	2017-05-25	重大事项停牌	21.81	—	—	601,912	13,144,869.98	13,127,700.72	—
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项停牌	24.49	2017-07-06	23.07	150,000	3,733,928.00	3,673,500.00	—
300271	华宇软件	2017-06-22	重大事项停牌	16.59	2017-07-04	16.80	80,000	1,572,394.00	1,327,200.00	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2017年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	210,866,131.62	—	—	—	—	—	210,866,131.62
结算备付金	6,602,017.69	—	—	—	—	—	6,602,017.69
存出保证金	865,623.96	—	—	—	—	—	865,623.96
交易性金融资产	—	—	293,547.80	—	—	3,673,390,285.97	3,673,683,833.77
应收证券清算款	—	—	—	—	—	13,315,180.77	13,315,180.77
应收利息	—	—	—	—	—	42,301.01	42,301.01
应收申购款	265,834.64	—	—	—	—	5,637,318.77	5,903,153.41
资产总计	218,599,607.91	—	293,547.80	—	—	3,692,385,086.52	3,911,278,242.23
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	—	—	9,176,455.49	9,176,455.49
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,608,824.52	4,608,824.52
应付托管费	—	—	—	—	—	768,137.43	768,137.43
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,368.89	2,368.89
应付交易费用	—	—	—	—	—	3,851,464.13	3,851,464.13
其他负债	—	—	—	—	—	266,687.30	266,687.30
负债总计	—	—	—	—	—	18,673,937.76	18,673,937.76
利率敏感度缺口	218,599,607.91	—	293,547.80	—	—	3,673,711,148.76	3,892,604,304.47
上年度末（2016年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	205,645,474.88	—	—	—	—	—	205,645,474.88
结算备付金	5,886,587.84	—	—	—	—	—	5,886,587.84
存出保证金	674,406.02	—	—	—	—	—	674,406.02
交易性金融资产	—	—	—	—	—	3,466,340,681.87	3,466,340,681.87
应收利息	—	—	—	—	—	49,744.44	49,744.44
应收申购款	127,569.32	—	—	—	—	2,745,686.93	2,873,256.25
资产总计	212,334,038.06	—	—	—	—	3,469,136,113.24	3,681,470,151.30
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	—	—	13,252.19	13,252.19
应付赎回款	—	—	—	—	—	44,270,357.95	44,270,357.95
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,756,118.78	4,756,118.78
应付托管费	—	—	—	—	—	792,686.46	792,686.46
应付交易费用	—	—	—	—	—	3,183,683.35	3,183,683.35
其他负债	—	—	—	—	—	368,573.27	368,573.27
负债总计	—	—	—	—	—	53,384,672.00	53,384,672.00
利率敏感度缺口	212,334,038.06	—	—	—	—	3,415,751,441.24	3,628,085,479.30

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 50%-95%；债券和短期金融工具为 5%-50%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于 5%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2017年06月30日）		上年度末（2016年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,673,390,285.97	94.37	3,466,340,681.87	95.54
交易性金融资产—债券投资	293,547.80	0.01	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,673,683,833.77	94.38	3,466,340,681.87	95.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2017年06月30日）	上年度末（2016年12月31日）

	1. 业绩比较基准增加 1%	52, 253, 591. 14	58, 574, 813. 13
	2. 业绩比较基准减少 1%	-52, 253, 591. 14	-58, 574, 813. 13

6.4.14 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 3, 549, 381, 839. 47 元，属于第二层次的余额为人民币 124, 301, 994. 30 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	3, 673, 390, 285. 97	93. 92

	其中：股票	3,673,390,285.97	93.92
2	固定收益投资	293,547.80	0.01
	其中：债券	293,547.80	0.01
	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	217,468,149.31	5.56
7	其他各项资产	20,126,259.15	0.51
8	合计	3,911,278,242.23	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	10,771,300.00	0.28
C	制造业	2,877,778,714.28	73.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	958,500.00	0.02
E	建筑业	14,084,351.10	0.36
F	批发和零售业	319,572,300.14	8.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,681,500.00	0.04
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,003,525.53	6.09
J	金融业	69,818,070.00	1.79
K	房地产业	20,259,570.32	0.52
L	租赁和商务服务业	66,686,000.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	926,000.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	45,850,000.00	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,172,808.00	0.03
Q	卫生和社会工作	1,867,824.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	4,959,822.60	0.13
S	综合	—	—
	合计	3,673,390,285.97	94.37

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002366	台海核电	7,200,000	337,752,000.00	8.68
2	000858	五粮液	5,000,000	278,300,000.00	7.15
3	300285	国瓷材料	13,004,361	256,185,911.70	6.58
4	002271	东方雨虹	6,000,903	222,633,501.30	5.72
5	002572	索菲亚	5,000,000	205,000,000.00	5.27
6	300136	信维通信	4,207,885	168,399,557.70	4.33
7	002117	东港股份	6,050,000	156,574,000.00	4.02
8	000423	东阿阿胶	2,000,000	143,780,000.00	3.69
9	002640	跨境通	5,484,135	115,533,546.67	2.97
10	600887	伊利股份	5,300,000	114,427,000.00	2.94
11	300310	宜通世纪	7,003,345	92,584,220.90	2.38
12	002511	中顺洁柔	6,557,617	86,757,272.91	2.23
13	600521	华海药业	4,004,278	84,250,009.12	2.16
14	300226	上海钢联	2,000,000	74,400,000.00	1.91
15	000651	格力电器	1,699,972	69,987,847.24	1.80
16	002508	老板电器	1,527,110	66,398,742.80	1.71
17	002103	广博股份	5,000,342	66,204,528.08	1.70
18	601933	永辉超市	8,800,000	62,304,000.00	1.60
19	600276	恒瑞医药	1,200,000	60,708,000.00	1.56
20	002127	南极电商	5,000,000	60,400,000.00	1.55
21	600309	万华化学	1,800,000	51,552,000.00	1.32
22	000596	古井贡酒	1,000,000	50,950,000.00	1.31
23	600519	贵州茅台	100,000	47,185,000.00	1.21
24	002153	石基信息	2,009,917	45,685,413.41	1.17
25	002120	韵达股份	820,000	42,312,000.00	1.09
26	002043	兔宝宝	3,000,000	41,520,000.00	1.07
27	601318	中国平安	800,000	39,688,000.00	1.02
28	600693	东百集团	3,193,902	39,348,872.64	1.01
29	300070	碧水源	2,000,000	37,300,000.00	0.96
30	002466	天齐锂业	660,940	35,922,089.00	0.92
31	300159	新研股份	2,000,000	26,480,000.00	0.68
32	300424	航新科技	549,833	25,935,622.61	0.67
33	600990	四创电子	373,282	23,139,751.18	0.59
34	000034	神州数码	1,000,000	23,090,000.00	0.59
35	600337	美克家居	3,807,679	21,513,386.35	0.55
36	000581	威孚高科	803,658	20,814,742.20	0.53
37	600151	航天机电	2,507,700	20,638,371.00	0.53
38	000759	中百集团	2,000,000	17,560,000.00	0.45

39	000963	华东医药	300,000	14,910,000.00	0.38
40	600487	亨通光电	500,000	14,025,000.00	0.36
41	002694	顾地科技	601,912	13,127,700.72	0.34
42	000661	长春高新	100,000	12,911,000.00	0.33
43	600622	嘉宝集团	748,800	12,190,464.00	0.31
44	600036	招商银行	500,000	11,955,000.00	0.31
45	300207	欣旺达	1,000,000	11,790,000.00	0.30
46	600491	龙元建设	1,000,070	10,730,751.10	0.28
47	002464	金利科技	222,240	8,909,601.60	0.23
48	600054	黄山旅游	500,000	8,550,000.00	0.22
49	600562	国睿科技	309,950	8,536,023.00	0.22
50	603108	润达医疗	530,500	8,450,865.00	0.22
51	002250	联化科技	550,000	7,865,000.00	0.20
52	600338	西藏珠峰	200,000	7,598,000.00	0.20
53	600998	九州通	330,000	7,114,800.00	0.18
54	600426	华鲁恒升	600,046	7,044,540.04	0.18
55	000712	锦龙股份	411,000	6,728,070.00	0.17
56	300166	东方国信	500,000	6,715,000.00	0.17
57	600703	三安光电	299,940	5,908,818.00	0.15
58	002024	苏宁云商	500,000	5,625,000.00	0.14
59	600176	中国巨石	500,000	5,490,000.00	0.14
60	002262	恩华药业	320,000	4,841,600.00	0.12
61	002139	拓邦股份	445,325	4,796,150.25	0.12
62	000915	山大华特	130,000	4,793,100.00	0.12
63	000951	中国重汽	299,919	4,585,761.51	0.12
64	600066	宇通客车	200,000	4,394,000.00	0.11
65	002027	分众传媒	300,000	4,128,000.00	0.11
66	603986	兆易创新	50,000	3,890,500.00	0.10
67	002142	宁波银行	200,000	3,860,000.00	0.10
68	002343	慈文传媒	100,000	3,786,000.00	0.10
69	300065	海兰信	150,000	3,673,500.00	0.09
70	300059	东方财富	300,000	3,606,000.00	0.09
71	002008	大族激光	100,000	3,464,000.00	0.09
72	601166	兴业银行	200,000	3,372,000.00	0.09
73	002475	立讯精密	100,000	2,924,000.00	0.08
74	601607	上海医药	100,000	2,888,000.00	0.07
75	601336	新华保险	50,000	2,570,000.00	0.07
76	300212	易华录	100,000	2,523,000.00	0.06
77	002051	中工国际	120,000	2,487,600.00	0.06
78	000910	大亚圣象	100,000	2,484,000.00	0.06
79	300142	沃森生物	200,000	2,472,000.00	0.06

80	603898	好莱客	70,000	2,446,500.00	0.06
81	002035	华帝股份	100,000	2,420,000.00	0.06
82	002450	康得新	100,000	2,252,000.00	0.06
83	000807	云铝股份	300,000	2,166,000.00	0.06
84	600848	上海临港	100,094	2,158,026.64	0.06
85	002712	思美传媒	100,000	2,158,000.00	0.06
86	001979	招商蛇口	100,088	2,137,879.68	0.05
87	002273	水晶光电	100,000	2,063,000.00	0.05
88	002037	久联发展	149,960	2,027,459.20	0.05
89	300436	广生堂	50,000	1,880,500.00	0.05
90	002044	美年健康	109,872	1,867,824.00	0.05
91	000869	张裕 A	50,000	1,860,000.00	0.05
92	601155	新城控股	100,000	1,854,000.00	0.05
93	603027	千禾味业	100,000	1,849,000.00	0.05
94	600436	片仔癀	30,000	1,831,200.00	0.05
95	600343	航天动力	100,000	1,734,000.00	0.04
96	601021	春秋航空	50,000	1,681,500.00	0.04
97	002422	科伦药业	100,000	1,652,000.00	0.04
98	600055	万东医疗	119,756	1,508,925.60	0.04
99	600325	华发股份	180,000	1,503,000.00	0.04
100	600686	金龙汽车	107,100	1,424,430.00	0.04
101	601225	陕西煤业	200,000	1,414,000.00	0.04
102	300271	华宇软件	80,000	1,327,200.00	0.03
103	002216	三全食品	150,000	1,291,500.00	0.03
104	002384	东山精密	50,000	1,235,000.00	0.03
105	000501	鄂武商 A	66,838	1,233,829.48	0.03
106	603377	东方时尚	31,200	1,172,808.00	0.03
107	300133	华策影视	100,000	1,120,000.00	0.03
108	600867	通化东宝	60,000	1,094,400.00	0.03
109	002223	鱼跃医疗	45,000	1,065,600.00	0.03
110	300335	迪森股份	50,000	958,500.00	0.02
111	300012	华测检测	200,000	926,000.00	0.02
112	002460	赣锋锂业	20,000	925,000.00	0.02
113	600038	中直股份	20,000	915,400.00	0.02
114	000983	西山煤电	100,000	877,000.00	0.02
115	000976	春晖股份	100,000	865,000.00	0.02
116	000333	美的集团	20,000	860,800.00	0.02
117	002215	诺普信	100,000	846,000.00	0.02
118	300357	我武生物	20,000	824,000.00	0.02
119	002519	银河电子	100,000	787,000.00	0.02
120	600060	海信电器	50,000	758,500.00	0.02

121	300253	卫宁健康	95,000	741,950.00	0.02
122	300545	联得装备	10,000	723,000.00	0.02
123	600803	新奥股份	50,000	687,000.00	0.02
124	601689	拓普集团	20,000	669,800.00	0.02
125	300197	铁汉生态	50,000	664,000.00	0.02
126	600699	均胜电子	20,000	641,800.00	0.02
127	600420	现代制药	40,000	627,600.00	0.02
128	002053	云南能投	50,000	627,500.00	0.02
129	601939	建设银行	100,000	615,000.00	0.02
130	600028	中国石化	100,000	593,000.00	0.02
131	601128	常熟银行	50,000	556,500.00	0.01
132	300124	汇川技术	20,000	510,800.00	0.01
133	300050	世纪鼎利	50,000	503,500.00	0.01
134	000783	长江证券	50,000	473,500.00	0.01
135	600486	扬农化工	10,000	422,100.00	0.01
136	600007	中国国贸	20,000	416,200.00	0.01
137	000786	北新建材	20,000	316,800.00	0.01
138	600547	山东黄金	10,000	289,300.00	0.01
139	000630	铜陵有色	100,000	284,000.00	0.01
140	300236	上海新阳	10,000	281,800.00	0.01
141	600585	海螺水泥	10,000	227,300.00	0.01
142	600820	隧道股份	20,000	202,000.00	0.01
143	603096	新经典	1,270	53,822.60	0.00
144	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
145	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
146	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
147	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
148	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
149	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
150	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
151	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
152	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
153	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
154	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
155	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
156	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
157	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
158	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
159	300558	贝达药业	72	4,294.08	0.00

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	002366	台海核电	245,888,939.26	6.78
2	002271	东方雨虹	190,313,990.96	5.25
3	002043	兔宝宝	149,961,588.21	4.13
4	300136	信维通信	135,914,176.51	3.75
5	300070	碧水源	135,119,100.57	3.72
6	000596	古井贡酒	133,930,340.55	3.69
7	002127	南极电商	123,580,912.15	3.41
8	300310	宜通世纪	116,799,280.94	3.22
9	300159	新研股份	113,333,030.54	3.12
10	600887	伊利股份	104,799,303.60	2.89
11	002572	索菲亚	103,852,939.14	2.86
12	002573	清新环境	103,054,576.05	2.84
13	600521	华海药业	99,053,617.27	2.73
14	002640	跨境通	98,157,681.37	2.71
15	000423	东阿阿胶	98,058,157.15	2.70
16	600990	四创电子	92,482,457.70	2.55
17	300017	网宿科技	91,120,267.23	2.51
18	002120	韵达股份	82,864,505.65	2.28
19	002103	广博股份	77,496,491.34	2.14
20	300226	上海钢联	76,782,401.66	2.12
21	000581	威孚高科	74,620,757.45	2.06

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	600887	伊利股份	189,898,902.25	5.23
2	000596	古井贡酒	169,629,030.81	4.68
3	000423	东阿阿胶	161,375,815.54	4.45
4	002366	台海核电	152,332,371.60	4.20
5	300017	网宿科技	147,157,023.60	4.06
6	600519	贵州茅台	145,584,632.98	4.01
7	002153	石基信息	137,164,365.12	3.78
8	300159	新研股份	124,679,480.83	3.44
9	002043	兔宝宝	119,066,056.44	3.28
10	002271	东方雨虹	113,824,245.86	3.14
11	002573	清新环境	105,011,296.72	2.89
12	600990	四创电子	101,084,128.52	2.79

13	601933	永辉超市	100,557,187.09	2.77
14	600276	恒瑞医药	92,081,235.75	2.54
15	300070	碧水源	90,244,195.72	2.49
16	002250	联化科技	88,496,740.82	2.44
17	600309	万华化学	86,242,839.72	2.38
18	600521	华海药业	82,827,234.19	2.28
19	000581	威孚高科	78,786,101.65	2.17
20	002475	立讯精密	69,338,450.41	1.91

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	4,326,079,206.76
卖出股票收入（成交）总额	4,613,352,272.10

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	293,547.80	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	293,547.80	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127004	模塑转债	2,540	293,547.80	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

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	865,623.96
2	应收证券清算款	13,315,180.77
3	应收股利	—

4	应收利息	42,301.01
5	应收申购款	5,903,153.41
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,126,259.15

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002640	跨境通	13,415,842.92	0.34	非公开发行股票

注：本基金报告期末持有跨境通(股票代码：002640)公允价值为115,533,546.67元，其中非公开发行部分公允价值为13,415,842.92元，剩余部分为正常流通股股票。

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

份额级别	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(%)
富国天惠成长混合A/B(LOF)	170,349	12,090.79	419,392,815.10	20.36	1,640,260,551.18	79.64
富国天惠成长混合C(LOF)	355	8,092.06	—	—	2,872,681.63	100.00
合计	170,704	12,082.47	419,392,815.10	20.33	1,643,133,232.81	79.67

8.2 期末上市基金前十名持有人

富国天惠成长混合 A/B(LOF)

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	季占柱	1,837,378	3.84
2	张红	963,833	2.02
3	杨静洪	408,317	0.85
4	段小军	400,000	0.84
5	饶小燕	367,970	0.77
6	贾福安	367,018	0.77
7	陈彩琴	366,731	0.77
8	崔志莹	357,200	0.75
9	倪刚	322,112	0.67
10	陈俊民	312,500	0.65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富国天惠成长混合 A/B(LOF)	3,042,725.31	0.1477
	富国天惠成长混合 C(LOF)	1,101.43	0.0383
	合计	3,043,826.74	0.1476

8.4 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	份额级别	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	富国天惠成长混合 A/B(LOF)	10~50
	富国天惠成长混合 C(LOF)	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国天惠成长混合 A/B(LOF)	0
	富国天惠成长混合 C(LOF)	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国天惠成长混合 A/B(LOF)	富国天惠成长混合 C(LOF)

基金合同生效日(2005年11月16日)基金份额总额	584,312,553.76	—
报告期期初基金份额总额	2,181,612,107.49	—
本报告期基金总申购份额	391,625,949.44	4,205,843.55
减：本报告期基金总赎回份额	513,584,690.65	1,333,161.92
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	2,059,653,366.28	2,872,681.63

§ 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	38,326,057.29	0.43	—	—	—	—	—	—	35,493.67	0.43	—
东北证券	2	321,142,649.88	3.59	—	—	—	—	—	—	292,654.40	3.58	—
东吴证券	2	541,825,382.26	6.06	—	—	—	—	—	—	493,765.87	6.04	—
东兴证券	2	295,954,545.90	3.31	—	—	—	—	—	—	271,834.03	3.32	—
方正证券	2	130,115,098.22	1.46	—	—	—	—	—	—	118,573.13	1.45	—
广发证券	2	522,835,146.96	5.85	—	—	—	—	—	—	481,424.91	5.89	—
国开证券	1	276,965,309.29	3.10	—	—	—	—	—	—	252,399.18	3.09	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	2	296,393,958.59	3.32	—	—	—	—	—	—	275,664.37	3.37	—
海通证券	2	1,018,902,859.91	11.40	—	—	—	—	—	—	930,318.36	11.37	—
华创证券	2	501,274,523.42	5.61	—	—	—	—	—	—	458,565.84	5.61	—
华金证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	2	45,832,420.02	0.51	—	—	—	—	—	—	42,683.41	0.52	—
民生证券	2	242,146,321.90	2.71	5,143,971.00	100.00	—	—	—	—	225,508.37	2.76	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

申万宏源	3	296,393,280.99	3.32	—	—	—	—	—	—	276,032.18	3.37	—
天风证券	2	1,494,276,731.65	16.72	—	—	—	—	—	—	1,361,738.77	16.65	—
西南证券	2	341,747,991.77	3.82	—	—	—	—	—	—	311,434.88	3.81	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	103,253,656.55	1.16	—	—	—	—	—	—	96,160.11	1.18	—
银河证券	1	776,773,595.68	8.69	—	—	—	—	—	—	707,875.18	8.66	—
英大证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	397,993,751.94	4.45	—	—	—	—	—	—	362,691.94	4.43	—
中泰证券	2	851,490,325.20	9.53	—	—	—	—	—	—	775,963.62	9.49	—
中投证券	1	28,584,377.33	0.32	—	—	30,000,000.00	27.27	—	—	26,620.46	0.33	—
中信建投	2	181,582,949.94	2.03	—	—	—	—	—	—	165,476.73	2.02	—
中信证券	1	231,788,952.71	2.59	—	—	80,000,000.00	72.73	—	—	215,865.51	2.64	—

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：方正证券 003773，方正证券 23334，国泰君安证券 003966，国泰君安证券 38615。其余租用券商交易单元未发生变动。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年01月07日
2	富国基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更单笔申购最低金额、追加申购单笔最低金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年01月14日
3	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年01月17日
4	富国基金管理有限公司关于旗下所有采取后端收费模式的基金份额暂停通过直销系统办理申购、转换及转托管业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年02月13日
5	富国基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡基金电子直销交易业务并实行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年02月14日
6	关于富国天惠精选成长混合型证券投资基金LOF增加C类份额并修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年03月23日
7	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年04月20日
8	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年04月20日
9	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年04月25日
10	富国天惠精选成长混合型证券投资基金C类份额在直销机构开通转换业务的	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年04月27日

	公告		
11	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年05月08日
12	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年05月24日
13	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回转认申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年06月13日

§ 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。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）的文件	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	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
2、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同		
3、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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		
-------------------------	--	--