

## 富国城镇发展股票型证券投资基金

2016 第一季度报告

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		249,419,223.74	6.06
7	其他资产		92,796,754.92	2.26
	合计		4,113,340,093.62	100.00
6.2报告期内按行业分类的股票投资组合				
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		93,880,000.00	2.30
B	采矿业		-	-

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	118,760,623.74	2.91
E	建筑业	802,620,000.00	2.02
F	批发和零售业	153,158,602.36	3.76
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	520,657,400.00	12.75
J	金融业	--	--
K	房地产业	2652.08	6.43
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
合计		3,771,143,030.96	92.94

③报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002366	台湾核电	6,300,065	315,822,288.46	7.71
2	002153	石基信息	2,620,000	286,407,480.00	6.96
3	300286	国星光电	8,160,000	253,746,000.00	6.10
4	000001	平安银行	16,000,000	320,000,000.00	7.70

4	5	002464	金利科技	3,000,047	194,352,898.15	4
	6	301159	新研股份	13,000,000	182,780,000.00	4
	7	002563	森马服饰	15,560,002	170,500,002.00	4
	8	600685	海曙水泥	9,700,000	163,833,000.00	4
	9	300056	惠胜医疗	5,000,000	159,050,000.00	4
	10	000920	南宁建工	8,500,031	156,906,572.57	4
4.8 报告期内未投公债和可转债类的前五名债券投资组合						
注：本基金报告期内未持有债券。						
4.9 报告期内未投公募基金类的前五名资产净值比例大于等于 0.5% 的前五名债券投资组合						
注：本基金报告期内未持有债券。						
4.10 报告期内未投公募基金类的前五名资产净值比例大于等于 0.5% 的前五名资产支持证券投资组合						
注：本基金报告期内未持有资产支持证券。						
4.11 报告期内未投公募基金类的前五名资产净值比例大于等于 0.5% 的前五名贵金属投资组合						
注：本基金报告期内未持有贵金属投资。						
4.12 报告期内未投公募基金类的前五名资产净值比例大于等于 0.5% 的前五名权证投资组合						
注：本基金报告期内未持有权证。						
4.13 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明						
4.13.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓收益及损益明细						
公允价值变动已计入公允价值变动损益						
报告期内投资衍生品公允价值变动(元)						
报告期内投资衍生品公允价值变动(元)						

9.0.2 本基金投资于股指期货的投资策略

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，降低股票仓位大幅波动对投资组合收益造成的冲击。

6.10 股指期货在基金投资策略中的使用风险说明

6.10.1 市场流动性风险说明

6.10.1.1 股指期货合约无法平仓的风险

本基金按照基金合同约定的期限，不允许使用股指期货。

6.10.2 股指期货对本基金投资的股指期货持仓价值和损益影响

	公允价值变动已确认合计(元)	--
股指期货投资净成本或收入(元)	--	
股指期货投资净成本或收入公允价值变动(元)	--	

注：本基金本报告期末未使用股指期货。

6.10.3 股指期货期货投资评价

6.10.3.1 股指期货未实现损益情况

6.11 股指期货套期保值

6.11.1 目前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、处罚的情况

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前的一年内受到公开谴责、处罚。

6.11.2 目前本基金投资的前十名股票是否属于基金合同规定的备选股票范围

报告期内本基金投资的前十名股票没有发生在备选股票库之外的情况。

6.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,382,868.67
2	应收证券清算款	74,039,042.42
3	应收股利	--

5	应收申购款		15,301,603.00
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8	其他		
9	合计		92,798,764.00

6.11.4 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。

6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末持有该股票的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300285	国联医药	263,776,000.00	6.24	筹划重大事项
2	000020	南方交通	156,996,572.67	3.91	筹划重大事项

6.11.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的金额和比例

因持仓人原因,投资组合中持仓占净值比例0.6%之和与合计可能存在尾差。

6.12 开放式基金份额变动

报告期间期初基金份额总额	1,729,134,615.00
报告期间净基金总申购份额	568,764,468.00
减:报告期间净基金总赎回份额	546,474,364.00
报告期间基金总申购份额减少额(份额减少以“-”填列)	
报告期间期末基金份额总额	1,772,414,718.00

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期间期初管理人持有的基金份额	
报告期间净买入/申购总份额	
报告期间净卖出/赎回总份额	

报告期间卖出/赎回总份额

报告期末持有人持有的基金份额

报告期末基金份额的净值/基金份额比例(%)

2.基金管理人运用基金资产买卖本基金关联方

注:本报告期末基金的管理人未运用基金资产购买或卖出本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

4.中国证监会核准设立国联国诚股权投资有限责任公司基金的文件

5.国联国诚股权投资有限责任公司基金合同

6.国联国诚股权投资有限责任公司基金托管协议

4.中国证监会核准设立国联基金资产管理有限公司的文件

5.国联基金资产管理有限公司基金合同

6.国联基金在指定境内上市的所有公告

8.2 存放地点

深圳市福田区世纪大道3号上海国金中心二一六-17层

8.3 查阅方式

投资者可至本报告如有疑问,可至香港基金管理人国联基金资产管理有限公司。

咨询电话:95105688, 4008888881 (全国统一, 免长话费)

公司网址: <http://www.tlfguo.com.cn>

国联基金管理有限公司  
2016年

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

6.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明		
6.10.1 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)		--
股指期货投资占基金公允价值变动比例		--
注:本基金本报告期末未投资股指期货。		
6.10.2 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。		
6.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明		
6.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细		
6.11.2 报告期末本基金投资的国债期货收益(元)		--
6.11.3 报告期末本基金投资的国债期货投资占基金公允价值变动比例		--
注:本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。		
6.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细		
6.12.1 国债期货投资总额合计(元)		--
国债期货投资本期收益(元)		--
国债期货投资占基金公允价值变动比例(%)		--
注:本基金本报告期末未投资国债期货。		
6.12.2 本报告期国债期货投资政策		
本基金本报告期末未投资国债期货。		
6.12.3 国债期货投资报告日期		
6.12.4 中国国债期货的资产中,名义金额为衍生工具,是否因存在被广泛用于平仓,或存在被编自前一年一年内到期可公开		

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  
本基金投资的前十名证券是否属于基金合同规定的备选股票范围  
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有发生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

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,075,364.94
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	190,387.01
5	应收申购款	117,441,273.23
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	120,606,025.18

5.12.4 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债券。

5.12.4.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

6.12.2.1 前十大指数投资前五只股票中存在受境外处罚影响的说明					金额单位
序号	股票代码	股票名称	流通受限期间的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	亿联网络	360,214,278.06	4.67	筹划重大事项

6.12.2.2 前十大指数投资前五只股票中不存在受境外处罚影响的说明

注：本基金本报告期末持有的前十大指数投资股票中不存在受境外处罚影响的股票。

6.12.2.3 报告期末持有的前十大股票中文标题如下：

因符合五人原则，投资组合报告中文标题中市值占净值之和与合计内容存在误差。

报告期间买入/申购总份额

报告期间卖出/赎回总份额

报告期间管理人认/申购基金份额

报告期间未支付的本基金金额占基金总资产比例(%)

72基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申报及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国创业板分级证券投资基金的文件

2、中国证监会批准分级证券投资基金合同

3、中国证监会批准分级证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准富国基金管理有限公司的文件

5、富国创业板分级证券投资基金临时募集说明书及附注

6、报告期内在指定报纸上披露的各项公告

8.2存放地点

上海市浦东新区世纪大道2号上海国金中心二期16-17层

8.3查阅方式

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金的投资者关系管理小组,咨询电话:021-60663698, 4006880888(全国统一,免长途话费)。

富国基金管理有限公司  
2016年