天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在盈米财富开通基金转换业务并参与其相关费率优惠活动的公告

为满足广大投资者的理财需求，天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与珠海盈米财富管理有限公司（以下简称“盈米财富”）协商一致，决定自2016年6月22日起在盈米财富指定平台开通本公司旗下部分基金的基金转换业务，同时参与其相关费率优惠活动，详情如下：

一、 适用基金范围

基金名称	基金代码
天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金	C类:001551
天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金	C类:001561
天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金	C类:001553
天弘全指运输指数型发起式证券投资基金	C类:001555
天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金	C类:001557
天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金	C类:001559
天弘创业板指数型发起式证券投资基金	C类:001593
天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金	C类:001600
天弘中证银行指数型发起式证券投资基金	C类:001595
天弘上证50指数型发起式证券投资基金	C类:001549
天弘中证100指数型发起式证券投资基金	C类:001587
天弘中证800指数型发起式证券投资基金	C类:001589
天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金	C类:001591
天弘中证电子指数型发起式证券投资基金	C类:001618
天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金	C类:001630
天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金	C类:001632
天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金	C类:001612

注：1、上述指数基金目前在盈米财富指定平台仅支持办理相互之间的基金转换业务以及与天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金之间的基金转换业务，暂未开通与本公司其他开放式基金之间的基金转换业务。

2、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金以及上述指数基金的A类份额已经在盈米财富指定平台开通基金转换业务，详见本公司于2015年11月10日发布的《?天弘基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告》。

3、上述指数基金中不同基金的A类份额和A类份额、C类份额和C类份额、A类份额和C类份额之间均可以互相转换，但同一基金的不同基金份额类别之间不得互相转换。

二、适用销售机构范围

销售机构	客服电话	网址
珠海盈米财富管理有限公司	020-89629066	www.yingmi.cn

三、优惠活动方案

自6月22日起，上述基金参加盈米财富开展的转换费率优惠活动，活动期间，投资者通过盈米财富指定平台办理上述基金的基金转换业务，转出与转入基金的申购补差费率不设折扣限制。上述基金费率标准详见各基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内，如本公司新增通过盈米财富销售的基金，则自该基金在盈米财富开通基金转换业务当日起，将同时参与上述优惠活动。投资者在盈米财富办理上述业务应遵循盈米财富的具体规定。

四、重要提示

1、本公告仅对上述基金办理基金转换业务的有关事项予以说明。投资者欲了解上述基金的详细情况，可通过本公司网站（www.thfund.com.cn）查阅上述基金相关法律文件。

2、各基金的转换业务规则详见本公司于2014年12月15日、2015年11月10日披露的《天弘基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告》、《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告》中相关内容。

3、基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此有关转出基金和转入基金《基金合同》和《招募说明书》中关于暂停或拒绝申购、赎回等有关规定均适用于基金转换业务。

4、上述基金转换业务的具体规定若发生变化，本公司将另行公告。

5、上述业务的解释权归本公司。

五、风险提示

基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于各基金时应认真阅读各基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇一六年六月二十二日

天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在新浪仓石开通定投业务的公告

为满足广大投资者的理财需求，天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与北京新浪仓石基金销售有限公司（以下简称“新浪仓石”）协商一致，决定自2016年6月22日起在新浪仓石指定平台开通本公司旗下部分基金的定期定额投资（以下简称“定投”）业务。

一、适用基金范围

基金名称	基金代码
天弘精选混合型证券投资基金	420001
天弘永利债券型证券投资基金	A类:420002 B类:420102
天弘永定价值成长混合型证券投资基金	420003
天弘周期策略混合型证券投资基金	420005
天弘现金管家货币市场基金	A类:420006
天弘债券型发起式证券投资基金	A类: 420008 B类: 420108
天弘安康养老混合型证券投资基金	420009
天弘通利混合型证券投资基金	000573
天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金	001030
天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金	001250
天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金	001210

注：投资者通过新浪仓石指定平台进行上述基金定投业务时，原申购费率高于0.6%的，享受4折优惠，但最低优惠至0.6%；原申购费率等于或低于0.6%的或为固定费率的，不享受优惠，按原费率执行。详情请参考本公司于2016年4月15日发布的《天弘基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下基金代销机构以及参加其相关费率优惠活动的公告》。

二、适用销售机构范围

销售机构	客服电话	网址
北京新浪仓石基金销售有限公司	010-62675369	www.xincai.com

三、重要提示

1、投资者欲了解各基金的详细情况，请仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

2、上述相关业务的办理流程、时间、方式以及优惠活动的具体内容请以新浪仓石的规定、公告或通知为准。

3、本公告的解释权归本公司所有。

四、风险提示

基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于各基金时应认真阅读各基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇一六年六月二十二日

证券简称：安徽水利 证券代码：600502 编号：2016-084

安徽水利开发股份有限公司非公开发行限售股上市流通公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

重要内容提示：

●本次限售股上市流通数量为50,966,168股

●本次限售股上市流通日期为2016年6月27日（原定上市流通日 2016年 6月 25 日为非交易日，则顺延至下一交易日）

一、本次限售股上市类型

2015 年 6 月 2 日，中国证监会会核发了《关于核准安徽水利开发股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2015]1001 号），核准公司非公开发行不超过 87,206,900 股新股。2015 年 6 月 25 日，公司完成了非公开发行，共计发行人民币普通股（A 股）29,980,099 股，并在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕登记托管手续，股权登记日为2015 年 6 月 25 日。本次发行新增股份为有限售条件流通股，发行对象认购的股份自发行结束之日起十二个月不得转让。

二、本次限售股形成后至今公司股本数量变化情况

2016年6月3日，本公司实施完成了2015年度利润分配及资本公积金转增股本方案事宜。方案为：以总股本531,910,099股为基数，每10股送2股，分配现金红利0.6元（含税），资本公积金每10股转增5股；共送股 106,382,020 股，转增265,955,049 股，合计送股转增 372,337,069 股，实施后公司总股本由531,910,099 股变更为904,247,168 股。

方案实施完成后，本公司限售股数量同比例增加70%。具体如下：

单位:股	方案实施完成前	变动数				方案实施完成后
		送股	转增	合计	同比变动比例	
有限售条件的流通股份	29,980,099	5,996,020	14,990,049	20,986,069	增加70%	50,966,168

三、本次限售股上市流通的有关承诺

本次申请上市的限售股持有人无上市特别承诺。

四、控股股东及其关联方资金占用情况

公司不存在控股股东及其关联方占用资金情况。

五、中介机构核查意见

华泰联合证券有限责任公司（以下简称“华泰联合”）作为公司本次非公开发行股票的保荐机构，原指定金巍锋、王锋为本项目的保荐代表人，负责保荐工作，因王锋离职，不能继续担任本项目的保荐代表人，经华泰联合与本公司协商，决定更换保荐代表人，由华泰联合保荐代表人李金虎接替王锋负责本公司持续督导期的保荐工作。变更后，公司本次非公开发行股票的保荐代表人为李金虎和金巍锋。

华泰联合就公司本次非公开发行限售股份上市流通发表核查意见如下：

本次限售股份解除限售数量、上市流通时间符合有关法律、行政法规、部门规章、有关规则和股东承诺。本次有限售条件的流通股解禁申请符合相关规定，公司与本次限售股份相关的信息披露真实、准确、完整。本保荐机构同意安徽水利本次解除限售股份上市流通。

六、本次限售股上市流通情况

本次限售股上市流通数量为50,966,168股。

本次限售股上市流通日期为2016年6月27日（原定上市流通日 2016年 6月 25 日为非交易日，则顺延至下一交易日），本次解除的限售股股东共5名，解除限售股份50,966,168股，占公司股本总额的5.64%，具体情况如下：

序号	股东名称	持有限售股数量（股）	持有限售股占公司总股本比例	本次上市流通数量（股）	剩余限售股数量
1	泰达宏利基金管理有限公司	12,686,566	1.40%	12,686,566	0
2	国泓资产管理有限公司	10,318,407	1.14%	10,318,407	0
3	安徽国贸联创投资有限公司	5,497,511	0.61%	5,497,511	0
4	上银瑞金资本管理有限公司	9,895,522	1.09%	9,895,522	0
5	财通基金管理有限公司	12,568,163	1.39%	12,568,163	0
合计		50,966,168	5.64%	50,966,168	0

七、股本变动结构表

单位：股

股份类别		本次上市前	变动数	本次上市后
有限售条件的流通股份	其他境内法人持有股份	50,966,168	-50,966,168	0
	有限售条件的流通股份合计	50,966,168	-50,966,168	0
无限售条件的流通股份	A股	853,281,000	50,966,168	904,247,168
	无限售条件的流通股份合计	853,281,000	50,966,168	904,247,168
股份总额	-	904,247,168	0	904,247,168

八、上网公告附件

（一）《华泰联合证券有限责任公司关于安徽水利开发股份有限公司非公开发行限售股份上市流通事项的核查意见》

特此公告。

安徽水利开发股份有限公司

董事会

二〇一六年六月二十一日

证券代码：002524 证券简称：光正集团 公告编号：2016-037

光正集团股份有限公司关于终止重大资产重组暨公司股票复牌的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

光正集团股份有限公司（以下简称"公司"或"光正集团"）因筹划重大事项，经深圳证券交易所同意，自2016年3月17日开市起停牌。停牌公告详见巨潮资讯网《光正集团股份有限公司关于筹划重大事项的停牌公告》（公告编号：2016-006号）。2016年3月23日，公司发布了《关于筹划重大资产重组停牌公告》(公告编号：2016-007号)，公司因筹划重大资产重组事项，股票自2016年3月23日开市起按照重大资产重组事项停牌；2016年3月30日、2016年4月6日、2016年4月13日公司发布了《关于筹划重大资产重组的进展公告》(公告编号：2016-008号、2016-009号、2016-010号)。2016年4月15日公司发布了《关于重大资产重组延期复牌的公告》(公告编号：2016-012号)，2016年4月22日、2016年4月29日、2016年5月9日、2016年5月16日、2016年5月23日、2016年5月31日、2016年6月6日、2016年6月14日公司发布了《关于重大资产重组的进展公告》(公告编号：2016-021号、 2016-024号、2016-025号、2016-028号、2016-030号、2016-033号、2016-034号、2016-036号)。

一、公司在推进重大资产重组期间所做的主要工作：

停牌期间，公司严格按照中国证券监督管理委员会和深圳证券交易所的有关规定，积极推进本次重大资产重组事项涉及的各项工作。严格按照《上市公司重大资产重组管理办法》及其他有关规定，认真履行保密义务，严格控制内幕知情人范围，及时履行信息披露义务。

停牌期间，公司及时履行信息披露义务，每五个交易日发布一次重大资产重组进展情况公告。

二、终止筹划本次重大资产重组的原因：

自进入筹划本次重大资产重组程序以来，公司实际控制人与潜在标的公司的实际控制人就公司收购标的公司事项进行了洽谈，相关各方也积极推动本次重大资产重组事项，同时公司与交易对方就交易方案与具体交易条款进行了更为深入详尽的商谈，然而公司与交易对方最终无法就重要交易条款达成一致，公司无法按期披露重大资产重组预案或报告书。经认真听取各方意见，并与相关各方充分沟通后，从保护上市公司全体股东及公司利益的角度出发，决定终止筹划本次重大资产重组，公司股票恢复交易。

三、承诺

根据《上市公司重大资产重组管理办法》等法律、法规及规范性文件的规定，公司承诺在披露本公告之日起6个月内不再筹划重大资产重组事项。

四、股票及其衍生品种复牌安排

经向深圳证券交易所申请，公司股票将于2016年6月22日（星期三）开市起复牌交易。

公司对本次停牌给广大投资者造成的不便深表歉意，并对广大投资者长期以来对公司的关注和支持表示感谢。公司指定的信息披露媒体为《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公司所有信息均以在上述指定媒体刊登。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

光正集团股份有限公司董事会

二〇一六年六月二十一日

招商安裕保本混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2016年6月22日

1. 公告基本信息

基金名称	招商安裕保本混合型证券投资基金	
基金简称	招商安裕保本混合	
基金主代码	002657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月20日	
基金管理人名称	招商基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司	
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《招商安裕保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)、《招商安裕保本混合型证券投资基金招募说明书》	
下属分级基金的基金简称	招商安裕保本A	招商安裕保本C
下属分级基金的交易代码	002657	002658

注：自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号	证监许可[2016]666号		
基金募集期间	自 2016年5月30日 至 2016年6月16日 止		
验资机构名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）		
募集资金划入基金托管专户的日期	2016年6月20日		
募集有效认购总户数（单位：户）	12,310		
份额级别	招商安裕保本A	招商安裕保本C	合计
募集期间净认购金额（单位：人民币元）	2,640,012,160.51	346,454,984.08	2,986,467,144.59
认购资金在募集期间产生的利息（单位：人民币元）	745,047.68	149,748.26	894,795.94
募集份额（单位：份）	有效认购份额	2,640,012,160.51	346,454,984.08	2,986,467,144.59
	利息结转的份额	745,047.68	149,748.26	894,795.94
	合计	2,640,757,208.19	346,604,732.34	2,987,361,940.53
募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	-	-	-
	占基金总份额比例	-	-	-
	其他需要说明的事项	-	-	-
募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	10.88	10	20.88
	占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%	0.0000%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是		
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2016年6月20日		

注：1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金，本基金的基金经理未持有本基金；

2、本次基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费等费用由基金管理人承担，不另从基金资产支付。

3. 其他需要提示的事项

1、基金份额持有人可以到销售机构的网点进行交易确认单的查询和打印，也可以通过本基金管理人的网站（http://www.cmfchina.com）或客户服务电话（400-887-9555）查询交易确认情况。

2、本基金的日常申购、赎回自基金合同生效后不超过三个月开始办理，具体业务办理时间，本基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

招商基金管理有限公司

2016年6月22日

（上接B81版）

联系人员：李晓明

客服电话：4000-178-000

公司网站：www.lingxianfund.com

（91）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法人代表：郭坚

联系电话：021-20665952

传真电话：021-22066653

联系人员：宁博宇

客服电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

（92）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法人代表：肖雯

联系电话：020-89629099

传真电话：020-89629011

联系人员：吴煜浩

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构：富国基金管理有限公司

名称：富国基金管理有限公司

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层

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

总经理：陈戈

成立日期：1999年4月13日

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：雷青松

（三）出具法律意见书的律师事务所（基金募集时）

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：黎明、吴军敏

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国中证红利指数增强型证券投资基金

（2012年4月16日“富国天惠中证红利指数增强型证券投资基金”更名为“富国中证红利指数增强型证券投资基金”）

五、基金的类型

指数型

六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金，其在遵循“程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理”原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证红利指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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。

八、基金的投资策略

本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资策略，在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。

1、指数化投资为主：

本基金主要采用完全复制目标指数策略，按照成份股在目标指数中的基准权重来构建股票投资组合，从而有效跟踪目标指数，控制跟踪误差，防止出现相对于目标指数的大幅度偏离。

2、主动性投资为辅：

在指数化投资过程中，由于交易成本的存在，完全复制策略可能很难有效达到拟合目标指数的目的。因此，本基金将主要采用有限度(“有限度”包含两层含义：成份股内被调整股票的数量和投资比例的调整幅度是有限度的；非成份股被选定的数量和投资比例是有限度的。)个股调整策略（主动性投资）对指数化投资进行修正，以求降低由于交易成本导致的对指数跟踪技术的影响，并力争适度超越指数，获取超额收益。

（1）在成份股内进行有限度调整。

本基金在充分研究的基础上，将目标指数的成份股分成三类——价值被低估的正超额收益预期的成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股以及价值被高估的负超额收益预期的成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，本基金将有限度地增持正超额收益预期成份股的权重以及有限度地减持负超额收益预期成份股的权重。

（2）对非成份股进行有限度调整。

本基金将基于投研团队充分的调研与全面的论证，进行以下三种具体操作：

[1] 合理替代部分流动性缺失的成份股。因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得本基金无法依照目标指数权重购买某成份股。因此，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入相关的替代性股票。

[2] 前瞻性纳入部分备选成份股。如果预期目标指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股。

[3] 精选部分蓝合价值的非成份股。本基金管理人将采用数量化分析与基本面判断相结合的研究方法，根据当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入部分蓝合投资价值、具有增长潜力的非成份股。

此外，本基金还将及时把握一级市场上新股申购与增发的盈利机会，并适度进行成份股与相应可转换债券之间的套利操作，以求提高资金运用效率。同时，本基金也可能审慎使用金融衍生产品，以对冲某些成分股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

3、对目标指数的跟踪调整：

（1）定期调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数委员会原则上每半年审核一次中证红利指数成份股。本基金将按照中证红利指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

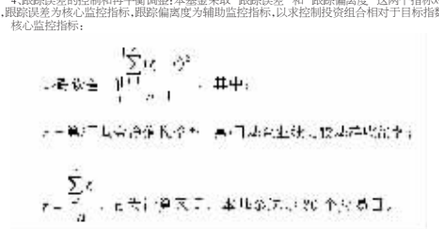
（2）不定期调整

根据指数编制规则，当中证红利指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

调整期间原则上定为：中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

4、跟踪误差的控制和再平衡调整：本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

核心监控指标：



辅助监控指标：

上述跟踪误差指标的最大容忍值设定为0.5%（相应折算的年跟踪误差约为7.75%）。本基金每周计算上述跟踪误差。如果该指标接近或者超过0.5%，并且跟踪偏离度小于0，则本基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源，并在适当的时机进行再平衡调整操作，使得跟踪误差回复到最大容忍值以下。

当本基金运作发展到一定阶段后，本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪偏离度，具体变化将另行公告。

九、基金的业绩比较基准

基金业绩比较基准=90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率（税后）。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

十一、基金的投资组合报告

1、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	364,020,932.79	90.82
	其中:股票	364,020,932.79	90.82
2	固定收益投资	745,904.50	0.19
	其中:债券	745,904.50	0.19
	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	34,356,849.61	8.57
7	其他资产	1,670,967.24	0.42
8	合计	400,794,654.14	100.00

2、报告期末积极投资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	1,857,345.00	0.46
B	采矿业	780,290.00	0.20
C	制造业	38,662,484.03	9.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,018,986.00	1.51
E	建筑业	2,016,954.48	0.50
F	批发和零售业	184,518.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,901,700.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,191,716.60	0.55
J	金融业	3,886,408.20	0.97
K	房地产业	3,583,408.00	0.90
L	租赁和商务服务业	2,975,093.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	256,556.52	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	134,280.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,992,606.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	67,442,345.83	16.88

3、报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	12,674,269.04	3.17
C	制造业	106,713,603.34	26.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,068,451.75	12.28
E	建筑业	6,686,061.80	1.67
F	批发和零售业	7,227,688.36	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	30,213,400.47	7.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	63,519,274.30	15.90
K	房地产业	20,475,837.90	5.12
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	296,578,586.96	74.23

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（1）报告期末指数投资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

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	600104	上汽集团	428,200	8,589,692.00	2.15
2	600000	浦发银行	435,810	7,814,073.30	1.96
3	601328	交通银行	1,372,250	7,643,432.50	1.91
4	600011	华能国际	912,007	7,268,695.79	1.82
5	600177	雅戈尔	476,615	7,206,418.80	1.80
6	601088	中国神华	497,248	6,991,306.88	1.75
7	600036	招商银行	432,934	6,965,908.06	1.74
8	000488	晨鸣纸业	790,226	6,693,214.22	1.68
9	600741	华域汽车	434,663	6,615,570.86	1.66
10	002372	伟星新材	350,783	6,552,626.44	1.64

（2）报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601888	中国国旅	49,500	2,259,675.00	0.57
2	002267	陕天然气	216,600	2,241,810.00	0.56
3	300145	南方泵业	56,426	2,214,720.50	0.55
4	300144	宋城演艺	68,100	1,992,606.00	0.50
5	002010	传化股份	122,000	1,988,600.00	0.50

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	745,904.50	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	745,904.50	0.19

6、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债券投资明细

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	110035	白云转债	6,050	745,904.50	0.19

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。

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。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（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。

（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。

12、投资组合报告附注

（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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	51,288.76
2	应收证券清算款	1,440,122.52
3	应收股利	-
4	应收利息	7,048.07
5	应收申购款	172,507.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,670,967.24

（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。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限的股票。

（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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国中证红利指数增强型证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2008.11.20-2008.12.31	2.99%	0.43%	-7.82%	1.90%	10.81%	-1.47%
2009.1.1-2009.12.31	67.83%	2.05%	95.27%	2.08%	-27.44%	-0.03%
2010.1.1-2010.12.31	-9.06%	1.42%	-11.60%	1.37%	2.54%	0.05%
2011.1.1-2011.12.31	-15.51%	1.17%	-21.09%	1.12%	5.58%	0.05%
2012.1.1-2012.12.31	10.06%	1.12%	6.85%	1.09%	3.21%	0.03%
2013.1.1-2013.12.31	-6.92%	1.37%	-8.69%	1.34%	1.77%	0.03%
2014.1.1-2014.12.31	48.47%	1.02%	46.14%	1.03%	2.33%	-0.01%
2015.1.1-2015.12.31	30.42%	2.35%	25.12%	2.38%	5.30%	-0.03%
2016.1.1-2016.3.31	-11.36%	2.34%	-11.87%	2.23%	0.51%	0.11%
2008.11.20-2016.3.31	133.52%	1.59%	97.42%	1.60%	36.10%	-0.01%

2、自基金合同生效以来富国中证红利指数增强型证券投资基金累计份额净值增长