

富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

二〇一五年年度报告

(摘要)

2015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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

## 1.2

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国天源沪港深
基金主代码	100016
交易代码	前端交易代码：100016 后端交易代码：100017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年08月16日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	640,988,498.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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。本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	本基金采用“证券市场平均收益率”作为衡量本基金操作水平的比较基准。 证券市场平均收益率=沪深300指数收益率×65%+中债综合全价指数收益率×30%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券和货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	范伟隽	林葛
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	95105686、4008880688	95599
传真	021-20361616	010-68121816

## 2.4 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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

## § 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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	468,829,787.86	193,054,986.78	148,397,076.97
本期利润	548,958,863.77	168,068,591.92	167,515,903.30
加权平均基金份额本期利润	0.8250	0.1626	0.1766
本期基金份额净值增长率	73.14%	15.39%	20.17%
3.1.2 期末数据和指标	2015年12月31日	2014年12月31日	2013年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.7561	0.1733	0.1030
期末基金资产净值	1,125,666,123.83	956,245,088.40	1,098,683,446.98
期末基金份额净值	1.7561	1.1733	1.1030

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。

### 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	44.57%	2.01%	11.25%	1.08%	33.32%	0.93%

过去六个月	4.91%	2.11%	-9.55%	1.70%	14.46%	0.41%
过去一年	73.14%	1.93%	7.40%	1.59%	65.74%	0.34%
过去三年	140.07%	1.36%	38.27%	1.14%	101.80%	0.22%
过去五年	111.57%	1.20%	23.29%	1.03%	88.28%	0.17%
自基金合同生效日起至今	531.79%	1.15%	148.92%	1.14%	382.87%	0.01%

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×65%+中债综合全价指数收益率×30%+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（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 65\% * [\text{沪深 300 指数 t} / (\text{沪深 300 指数 t-1}) - 1] + 30\% * [\text{中债综合全价指数 t} / (\text{中债综合全价指数 t-1}) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360 ;$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

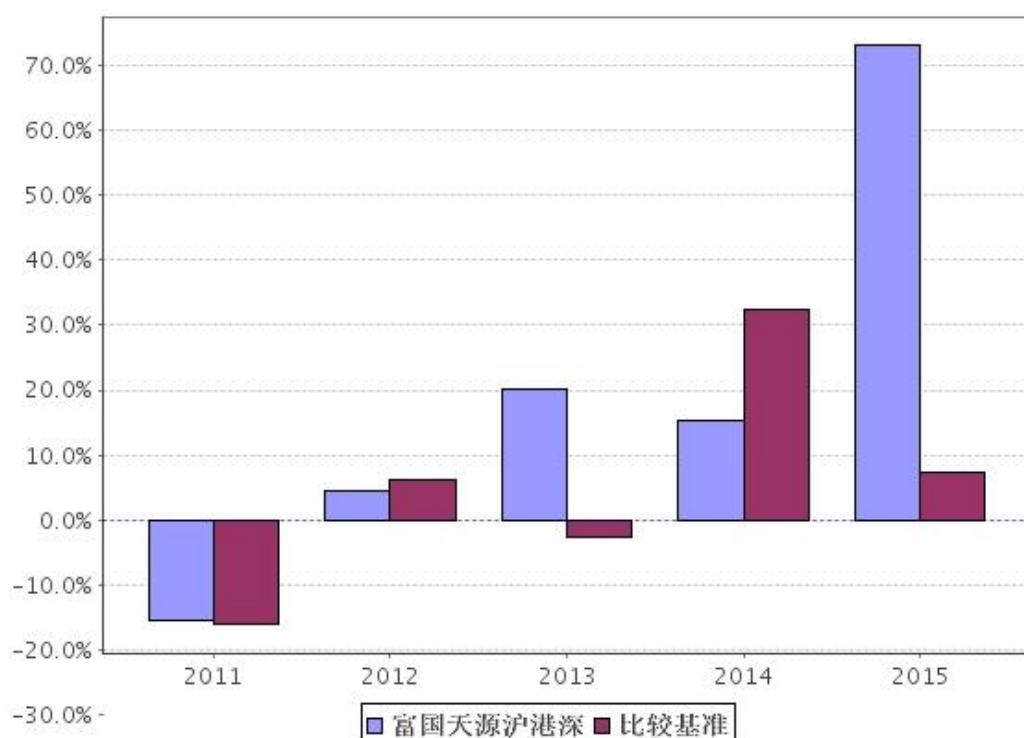
其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$  表示 t 日至 T 日的 (1+benchmarkt) 数学连乘。

### 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：1、截止日期为2015年12月31日止。  
2、本基金于2002年8月16日成立，建仓期6个月，从2002年8月16日至2003年2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。

### 3.2.3 过去五年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



### 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
2015年	1.640	86,640,616.38	44,215,199.85	130,855,816.23	1次分红
2014年	0.850	64,008,230.69	27,474,978.29	91,483,208.98	1次分红
2013年	—	—	—	—	—
合计	2.490	150,648,847.07	71,690,178.14	222,339,025.21	—

## § 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2015年12月31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（原富国信用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、富国收益宝货币市场基金、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等六十七只证券投资基金。

#### 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		
曹晋	本基金基金经理兼富国中小盘精选混合型证券投资基金基金经理	2015-10-27	—	7年	硕士，曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理研究员、研究员、基金经理助理、基金经理；2014年6月加入富国基金管理有限公司，2014年10月至2015年10月任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理，2015年1月起任富国中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，2015年10月起任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金经理。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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天源沪港深平衡混合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》、《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》（原《富国天源平衡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。

#### 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，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。

#### **4.3.2 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（1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。

#### **4.3.3 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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现15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**

2015年，在稳增长、低利率的宽松货币政策护航下，宏观风险相对可控，市场上半年表现强势；三季度受清查场外配资的影响，股市出现剧烈调整；进入四季度，随着管理层的一系列救市政策相继出炉，市场开始反弹企稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.7561 元，份额累计净值为 3.4687 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 73.14%，同期业绩比较基准收益率为 7.40%。

#### 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 2016 年，宏观的不确定性逐步加大；注册制的推出以及 IPO 重启发行都将加大股票的供给；大小非开放减持解禁也将加大市场的压力；汇率的波动以及外汇占款的外流加大对流动性的担忧。下半年，随着全球宏观经济的不确定增加，以及流动性宽松的边际效应递减，市场风险逐步加大。对于公募基金而言，我们认为 2016 年的机会来自于不断的结构性优化，寻找穿越牛熊的品种。天源平衡基金将更多的发挥平衡基金的优势，在股债中调整结构，精选个股，为持有人取得超额收益。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2015 年 01 月 15 日公告对 2014 年报告期内利润进行收益分配，每 10 份基金份额派发红利 1.64 元，共计派发红利 130855816.23 元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2015年12月31日)	上年度末 (2014年12月31日)
<b>资产：</b>		
银行存款	51,888,735.28	71,472,909.94
结算备付金	8,667,372.14	10,134,022.08
存出保证金	2,744,529.31	833,066.06
交易性金融资产	1,051,521,438.29	952,030,341.38
其中：股票投资	766,917,338.29	621,838,341.38
基金投资	—	—
债券投资	284,604,100.00	330,192,000.00
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	10,576,074.85	12,148,126.82
应收利息	4,561,345.16	4,489,341.88
应收股利	—	—

应收申购款	7,503,857.11	745,445.84
递延所得税资产	—	—
其他资产	547.03	547.03
资产总计	1,137,463,899.17	1,051,853,801.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2015年12月31日)</b>	<b>(2014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	2,026,221.21	43,243,435.59
应付赎回款	3,845,594.49	46,077,992.98
应付管理人报酬	1,331,775.56	1,350,820.26
应付托管费	221,962.57	225,136.71
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	4,223,715.35	4,300,936.72
应交税费	34,926.80	34,926.80
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	113,579.36	375,463.57
负债合计	11,797,775.34	95,608,712.63
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	640,988,498.85	815,014,727.68
未分配利润	484,677,624.98	141,230,360.72
所有者权益合计	1,125,666,123.83	956,245,088.40
负债和所有者权益总计	1,137,463,899.17	1,051,853,801.03

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7561 元，基金份额总额 640,988,498.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2015年01月01日至 2015年12月31日)	上年度可比期间 (2014年01月01日至 2014年12月31日)
<b>一、收入</b>	598,351,407.22	205,375,534.15
1. 利息收入	11,612,473.30	14,737,511.02
其中：存款利息收入	599,440.65	444,880.04
债券利息收入	10,827,467.51	14,147,289.20

资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	185,565.14	145,341.78
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	505,640,511.26	214,926,921.47
其中：股票投资收益	508,583,550.98	206,850,089.13
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-7,254,845.52	726,472.20
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	4,311,805.80	7,350,360.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	80,129,075.91	-24,986,394.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	969,346.75	697,496.52
<b>减：二、费用</b>	49,392,543.45	37,306,942.23
1. 管理人报酬	14,373,294.40	16,511,284.47
2. 托管费	2,395,549.03	2,751,880.74
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	32,038,989.41	17,715,600.47
5. 利息支出	281,803.01	99,921.03
其中：卖出回购金融资产支出	281,803.01	99,921.03
6. 其他费用	302,907.60	228,255.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	548,958,863.77	168,068,591.92
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	548,958,863.77	168,068,591.92

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2015年01月01日至2015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）	815,014,727.68	141,230,360.72	956,245,088.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	548,958,863.77	548,958,863.77
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）	-174,026,228.83	-74,655,783.28	-248,682,012.11
其中：1. 基金申购款	609,548,172.81	276,897,230.16	886,445,402.97

2. 基金赎回款	-783,574,401.64	-351,553,013.44	-1,135,127,415.08
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）	—	-130,855,816.23	-130,855,816.23
五、期末所有者权益（基金净值）	640,988,498.85	484,677,624.98	1,125,666,123.83
项目	上年度可比期间 (2014年01月01日至2014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）	996,084,203.64	102,599,243.34	1,098,683,446.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	168,068,591.92	168,068,591.92
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）	-181,069,475.96	-37,954,265.56	-219,023,741.52
其中：1. 基金申购款	554,057,827.60	27,900,508.35	581,958,335.95
2. 基金赎回款	-735,127,303.56	-65,854,773.91	-800,982,077.47
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）	—	-91,483,208.98	-91,483,208.98
五、期末所有者权益（基金净值）	815,014,727.68	141,230,360.72	956,245,088.40

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：

陈戈

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 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。

### 7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.3 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
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

山东省国际信托股份有限公司（原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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：（1）关联方申万宏源证券有限公司是由原关联方申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）与宏源证券股份有限公司于2015年1月16日合并组建而成。

（2）2015年7月，原山东省国际信托有限公司更名为山东省国际信托股份有限公司。

（3）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2015年01月01日至2015年12月31日）		上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31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	5,576,154,395.97	26.41	1,332,817,724.53	11.45
申万宏源	3,156,837,007.92	14.95	—	—
申银万国	—	—	1,634,530,703.15	14.05

###### 7.4.4.1.2 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。

###### 7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2015年01月01日至2015年12月31日）		上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31日）	
	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（%）
申万宏源	68,606,863.80	22.23	—	—
申银万国	—	—	2,997,900.00	6.90

###### 7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2015年01月01日至2015年12月31日）		上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
申万宏源	1,385,400,000.00	41.57	—	—

###### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2015年01月01日至2015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（%）
海通证券	5,006,602.17	26.29	1,083,764.63	25.66
申万宏源	2,888,519.05	15.17	761,362.97	18.03
关联方名称	上年度可比期间（2014年01月01日至2014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（%）
申银万国	1,468,512.85	14.11	1,083,138.05	25.19
海通证券	1,179,411.58	11.33	731,190.26	17.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2015年01月01日至2015年12月31日）	上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	14,373,294.40	16,511,284.47
其中：支付销售机构的客户维护费	3,692,020.58	1,272,877.16

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。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2015年01月01日至2015年12月31日）	上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	2,395,549.03	2,751,880.74

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。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期（2015年01月01日至2015年12月31日）			
银行间市场交易	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购



的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	—	—	—	—	314,000,000.00	226,942.23
上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	—	—	—	—	50,000,000.00	99,726.03

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金合同生效日为2015年6月24日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.4.4.2 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未投资本基金，本基金合同生效日为2015年6月24日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.4.5 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（2015年01月01日至2015年12月31日）		上年度可比期间（2014年01月01日至2014年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	51,888,735.28	400,106.98	71,472,909.94	358,120.09

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.5 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项停牌	30.62	—	—	10	125.00	306.20	—
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项停牌	49.96	2016-01-22	44.96	661,900	29,724,756.30	33,068,524.00	—

300349	金卡股份	2015-11-20	重大事项停牌	37.75	—	—	1	55.83	37.75	—
300431	暴风科技	2015-10-27	重大事项停牌	95.83	—	—	2	221.27	191.66	—
600271	航天信息	2015-10-12	重大事项停牌	71.46	—	—	68,900	3,548,124.00	4,923,594.00	—

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 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 728,924,684.68 元，属于第二层次的余额为人民币 322,596,753.61 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2014 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 570,974,324.02 元，属于第二层次的余额为人民币 381,056,017.36 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

###### 7.4.14.1.2.2 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 23 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

###### 7.4.14.1.2.3 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。

##### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

## § 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	766,917,338.29	67.42
	其中：股票	766,917,338.29	67.42
2	固定收益投资	284,604,100.00	25.02
	其中：债券	284,604,100.00	25.02
	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	60,556,107.42	5.32
7	其他各项资产	25,386,353.46	2.23
8	合计	1,137,463,899.17	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	32,584,658.40	2.89
B	采矿业	—	—
C	制造业	529,575,080.65	47.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	50.62	0.00
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	81,012,702.96	7.20
J	金融业	—	—
K	房地产业	20,465,412.00	1.82
L	租赁和商务服务业	15.46	0.00
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	103,279,418.20	9.17
S	综合	—	—
	合计	766,917,338.29	68.13

### 8.3 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	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	002329	皇氏集团	3,000,000	83,700,000.00	7.44
2	002094	青岛金王	1,691,294	52,683,808.10	4.68
3	600136	道博股份	836,745	52,179,418.20	4.64
4	002445	中南重工	1,838,388	51,566,783.40	4.58
5	002699	美盛文化	1,000,000	51,100,000.00	4.54
6	002494	华斯股份	1,807,900	47,909,350.00	4.26
7	002292	奥飞动漫	883,501	45,685,836.71	4.06
8	300310	宜通世纪	672,800	41,935,624.00	3.73
9	600678	四川金顶	1,292,900	35,800,401.00	3.18
10	300242	明家科技	661,900	33,068,524.00	2.94

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

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	601988	中国银行	169,494,827.58	17.73
2	002329	皇氏集团	144,634,843.08	15.13
3	000002	万科 A	135,387,195.64	14.16
4	601166	兴业银行	134,876,131.13	14.10
5	002405	四维图新	114,582,090.82	11.98
6	300043	互动娱乐	105,976,167.92	11.08
7	002599	盛通股份	101,071,312.57	10.57
8	002445	中南重工	86,612,185.58	9.06
9	002363	隆基机械	86,607,152.04	9.06
10	002292	奥飞动漫	81,194,200.68	8.49
11	600048	保利地产	80,861,928.95	8.46
12	000333	美的集团	80,101,563.38	8.38
13	002494	华斯股份	79,883,371.91	8.35
14	300144	宋城演艺	79,124,584.58	8.27
15	601599	鹿港科技	76,205,211.63	7.97

16	601398	工商银行	76,143,661.94	7.96
17	300016	北陆药业	74,859,936.48	7.83
18	300253	卫宁软件	74,602,793.27	7.80
19	002458	益生股份	74,407,585.15	7.78
20	600415	小商品城	71,732,715.51	7.50
21	002153	石基信息	71,455,889.75	7.47
22	300133	华策影视	70,648,962.57	7.39
23	002312	三泰控股	67,927,172.35	7.10
24	002699	美盛文化	67,708,018.43	7.08
25	300005	探路者	67,126,946.42	7.02
26	600358	国旅联合	66,230,271.09	6.93
27	000100	TCL 集团	66,208,783.28	6.92
28	002714	牧原股份	63,876,154.37	6.68
29	600208	新湖中宝	63,745,389.16	6.67
30	002318	久立特材	63,728,804.79	6.66
31	300104	乐视网	63,697,303.75	6.66
32	300147	香雪制药	62,323,816.96	6.52
33	600690	青岛海尔	61,425,527.88	6.42
34	002308	威创股份	61,296,839.83	6.41
35	600571	信雅达	61,110,040.70	6.39
36	000732	泰禾集团	60,989,378.35	6.38
37	601818	光大银行	60,787,221.14	6.36
38	300113	顺网科技	60,545,163.90	6.33
39	300171	东富龙	60,459,927.81	6.32
40	600694	大商股份	59,575,782.17	6.23
41	000802	北京文化	59,202,019.31	6.19
42	300356	光一科技	58,388,491.61	6.11
43	300295	三六五网	57,299,277.00	5.99
44	000831	五矿稀土	56,983,541.53	5.96
45	300336	新文化	56,798,723.43	5.94
46	600409	三友化工	56,302,865.32	5.89
47	600058	五矿发展	56,180,073.00	5.88
48	002456	欧菲光	56,016,358.94	5.86
49	002466	天齐锂业	52,674,959.65	5.51
50	000901	航天科技	52,410,108.75	5.48
51	002074	国轩高科	52,228,167.77	5.46
52	002642	荣之联	51,326,767.81	5.37
53	600136	道博股份	50,673,993.84	5.30
54	002094	青岛金王	50,228,803.81	5.25
55	600325	华发股份	49,299,152.55	5.16
56	601801	皖新传媒	49,152,684.00	5.14

57	600109	国金证券	49,058,076.00	5.13
58	300130	新国都	48,887,250.10	5.11
59	300226	上海钢联	47,003,831.18	4.92
60	002659	中泰桥梁	46,150,777.40	4.83
61	000768	中航飞机	46,121,474.05	4.82
62	300242	明家科技	46,037,461.05	4.81
63	300352	北信源	45,793,619.02	4.79
64	600654	中安消	45,133,756.32	4.72
65	000024	招商地产	44,541,072.02	4.66
66	002343	禾欣股份	42,098,054.40	4.40
67	300018	中元华电	41,440,230.99	4.33
68	002304	洋河股份	41,357,588.59	4.32
69	600663	陆家嘴	40,090,694.25	4.19
70	601998	中信银行	39,936,170.15	4.18
71	300347	泰格医药	39,718,914.46	4.15
72	002221	东华能源	39,471,545.99	4.13
73	002251	步步高	38,903,711.52	4.07
74	300100	双林股份	38,650,394.08	4.04
75	600054	黄山旅游	38,346,896.41	4.01
76	600518	康美药业	38,321,740.52	4.01
77	600999	招商证券	38,262,344.28	4.00
78	601318	中国平安	38,161,259.49	3.99
79	600118	中国卫星	38,073,404.08	3.98
80	300430	诚益通	37,640,424.32	3.94
81	600536	中国软件	37,572,857.78	3.93
82	002044	江苏三友	37,090,840.65	3.88
83	000967	上风高科	36,889,742.42	3.86
84	600876	洛阳玻璃	36,798,874.42	3.85
85	601688	华泰证券	36,623,858.88	3.83
86	300291	华录百纳	36,616,128.46	3.83
87	002425	凯撒股份	36,587,345.12	3.83
88	002612	朗姿股份	36,367,254.60	3.80
89	300146	汤臣倍健	36,030,156.86	3.77
90	002477	雏鹰农牧	35,862,692.53	3.75
91	601555	东吴证券	34,713,835.04	3.63
92	300364	中文在线	34,238,132.60	3.58
93	601628	中国人寿	34,223,333.64	3.58
94	002029	七匹狼	34,172,483.18	3.57
95	300271	华宇软件	34,132,615.75	3.57
96	000607	华媒控股	33,616,624.90	3.52
97	601799	星宇股份	33,488,076.14	3.50

98	600887	伊利股份	33,278,698.05	3.48
99	601021	春秋航空	33,267,132.69	3.48
100	600703	三安光电	33,197,474.02	3.47
101	002400	省广股份	32,673,137.47	3.42
102	000523	广州浪奇	32,530,069.31	3.40
103	603555	贵人鸟	32,374,404.11	3.39
104	002049	同方国芯	32,370,552.80	3.39
105	300075	数字政通	32,305,109.38	3.38
106	300166	东方国信	32,193,248.80	3.37
107	002439	启明星辰	32,040,135.27	3.35
108	002063	远光软件	31,577,498.21	3.30
109	300065	海兰信	31,452,439.91	3.29
110	600678	四川金顶	31,406,552.89	3.28
111	300186	大华龙	31,314,886.10	3.27
112	601888	中国国旅	30,924,062.66	3.23
113	000651	格力电器	30,715,617.80	3.21
114	000829	天音控股	30,462,544.96	3.19
115	600115	东方航空	30,266,052.97	3.17
116	600271	航天信息	30,210,911.88	3.16
117	300332	天壕环境	30,207,317.36	3.16
118	600038	中直股份	30,032,449.68	3.14
119	000561	烽火电子	29,866,926.96	3.12
120	601857	中国石油	29,778,789.00	3.11
121	600958	东方证券	29,167,485.76	3.05
122	002712	思美传媒	29,032,717.93	3.04
123	002030	达安基因	28,989,847.35	3.03
124	002339	积成电子	28,981,795.10	3.03
125	002179	中航光电	28,706,359.68	3.00
126	002047	宝鹰股份	28,490,949.82	2.98
127	000078	海王生物	28,322,350.05	2.96
128	000796	凯撒旅游	28,149,762.05	2.94
129	000835	长城动漫	27,980,479.31	2.93
130	300101	振芯科技	27,965,239.22	2.92
131	600009	上海机场	27,703,083.73	2.90
132	300349	金卡股份	27,225,462.95	2.85
133	002024	苏宁云商	27,100,164.17	2.83
134	002260	德奥通航	26,956,748.15	2.82
135	002070	众和股份	26,709,448.76	2.79
136	300059	东方财富	26,651,491.67	2.79
137	300302	同有科技	26,619,588.61	2.78
138	002462	嘉事堂	26,449,528.35	2.77

139	002589	瑞康医药	26,193,069.97	2.74
140	002390	信邦制药	26,137,112.62	2.73
141	002197	证通电子	26,124,944.08	2.73
142	600547	山东黄金	26,061,903.14	2.73
143	002004	华邦健康	26,023,922.83	2.72
144	300207	欣旺达	26,009,092.55	2.72
145	300038	梅泰诺	25,960,696.93	2.71
146	000001	平安银行	25,879,907.57	2.71
147	300310	宜通世纪	25,866,563.00	2.71
148	600588	用友网络	25,730,926.90	2.69
149	002376	新北洋	25,422,866.60	2.66
150	600651	飞乐音响	25,228,331.68	2.64
151	002664	信质电机	25,006,945.90	2.62
152	002572	索菲亚	24,791,926.97	2.59
153	002354	天神娱乐	24,603,734.00	2.57
154	002384	东山精密	24,095,780.04	2.52
155	600862	南通科技	24,095,663.69	2.52
156	600491	龙元建设	23,931,896.58	2.50
157	002223	鱼跃医疗	23,758,348.64	2.48
158	600570	恒生电子	23,177,436.28	2.42
159	002311	海大集团	22,848,429.68	2.39
160	600343	航天动力	22,695,768.92	2.37
161	600893	中航动力	22,693,344.55	2.37
162	600760	中航黑豹	22,598,924.36	2.36
163	000777	中核科技	22,132,417.20	2.31
164	300333	兆日科技	21,880,864.00	2.29
165	002766	索菱股份	21,863,252.80	2.29
166	600650	锦江投资	21,836,320.05	2.28
167	002590	万安科技	21,749,891.20	2.27
168	000596	古井贡酒	21,528,648.15	2.25
169	600699	均胜电子	21,504,391.95	2.25
170	002236	大华股份	21,436,504.38	2.24
171	002464	金利科技	21,432,064.00	2.24
172	300257	开山股份	21,397,789.96	2.24
173	000547	航天发展	21,325,423.07	2.23
174	002123	荣信股份	21,212,306.08	2.22
175	600745	中茵股份	21,008,695.00	2.20
176	000888	峨眉山 A	20,919,983.44	2.19
177	300248	新开普	20,882,026.40	2.18
178	600697	欧亚集团	20,746,892.77	2.17
179	300264	佳创视讯	20,565,013.00	2.15



180	000697	炼石有色	20,378,016.04	2.13
181	600826	兰生股份	20,341,016.26	2.13
182	300188	美亚柏科	20,321,770.70	2.13
183	300265	通光线缆	20,288,133.90	2.12
184	300031	宝通科技	20,195,613.63	2.11
185	600511	国药股份	20,139,429.00	2.11
186	300259	新天科技	20,024,571.67	2.09
187	002661	克明面业	19,906,748.16	2.08
188	000633	合金投资	19,803,975.81	2.07
189	600701	工大高新	19,729,497.40	2.06
190	600037	歌华有线	19,589,703.77	2.05
191	002392	北京利尔	19,552,388.73	2.04
192	601918	国投新集	19,522,039.84	2.04
193	300183	东软载波	19,507,163.39	2.04
194	600098	广州发展	19,418,165.72	2.03
195	002011	盾安环境	19,220,885.73	2.01

#### 8.4.2 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	300253	卫宁软件	167,903,983.53	17.56
2	601988	中国银行	165,482,825.77	17.31
3	601166	兴业银行	153,607,440.39	16.06
4	600415	小商品城	149,906,908.39	15.68
5	000002	万科 A	145,651,279.99	15.23
6	002329	皇氏集团	122,541,763.65	12.81
7	002405	四维图新	117,968,402.83	12.34
8	002363	隆基机械	110,635,925.19	11.57
9	601599	鹿港科技	104,245,034.02	10.90
10	300043	互动娱乐	102,205,952.34	10.69
11	002318	久立特材	96,664,292.76	10.11
12	000732	泰禾集团	95,742,496.41	10.01
13	300016	北陆药业	86,677,304.43	9.06
14	600048	保利地产	85,986,784.11	8.99
15	002599	盛通股份	85,821,739.39	8.97
16	002153	石基信息	85,346,667.12	8.93
17	300171	东富龙	80,572,817.29	8.43
18	000333	美的集团	80,372,861.10	8.41
19	002312	三泰控股	79,069,687.06	8.27
20	300133	华策影视	77,489,193.32	8.10
21	300226	上海钢联	77,472,293.75	8.10
22	002642	荣之联	74,163,469.33	7.76

23	000100	TCL 集团	73,264,329.61	7.66
24	601398	工商银行	72,926,963.91	7.63
25	300113	顺网科技	72,512,722.79	7.58
26	300336	新文化	72,437,291.91	7.58
27	002466	天齐锂业	71,629,065.79	7.49
28	600358	国旅联合	69,953,338.49	7.32
29	300144	宋城演艺	69,927,489.01	7.31
30	601318	中国平安	68,894,990.00	7.20
31	300005	探路者	67,910,737.92	7.10
32	000802	北京文化	67,318,536.99	7.04
33	300038	梅泰诺	66,212,805.99	6.92
34	300104	乐视网	65,989,206.55	6.90
35	600208	新湖中宝	65,836,419.41	6.88
36	300295	三六五网	65,615,856.97	6.86
37	300147	香雪制药	62,572,744.77	6.54
38	002456	欧菲光	61,336,948.18	6.41
39	300356	光一科技	60,751,221.54	6.35
40	300352	北信源	60,057,095.00	6.28
41	601818	光大银行	59,730,296.74	6.25
42	002445	中南重工	57,695,447.77	6.03
43	600409	三友化工	57,632,005.88	6.03
44	300364	中文在线	57,466,121.26	6.01
45	000712	锦龙股份	56,815,967.95	5.94
46	600690	青岛海尔	56,450,549.47	5.90
47	600694	大商股份	56,049,659.06	5.86
48	000831	五矿稀土	54,123,546.65	5.66
49	600654	中安消	51,971,661.33	5.43
50	600999	招商证券	51,086,374.86	5.34
51	002714	牧原股份	50,780,083.14	5.31
52	600571	信雅达	50,672,058.92	5.30
53	002070	众和股份	50,383,776.26	5.27
54	600109	国金证券	50,368,566.44	5.27
55	300059	东方财富	49,998,448.63	5.23
56	002074	国轩高科	49,986,878.26	5.23
57	000901	航天科技	49,657,912.05	5.19
58	601801	皖新传媒	47,876,489.44	5.01
59	601555	东吴证券	46,841,145.47	4.90
60	600703	三安光电	46,585,154.52	4.87
61	002292	奥飞动漫	46,434,051.20	4.86
62	600058	五矿发展	46,093,627.14	4.82
63	300430	诚益通	45,991,186.00	4.81

64	002458	益生股份	45,951,789.21	4.81
65	600118	中国卫星	45,800,624.75	4.79
66	002439	启明星辰	45,234,485.00	4.73
67	002425	凯撒股份	44,840,153.52	4.69
68	300130	新国都	44,435,113.79	4.65
69	000024	招商地产	44,271,970.14	4.63
70	603555	贵人鸟	43,614,233.70	4.56
71	600536	中国软件	42,122,159.23	4.40
72	600325	华发股份	40,789,563.91	4.27
73	002612	朗姿股份	40,577,062.93	4.24
74	002659	中泰桥梁	40,279,907.67	4.21
75	300332	天壕环境	39,761,268.94	4.16
76	600876	洛阳玻璃	39,471,611.66	4.13
77	002308	威创股份	39,290,123.97	4.11
78	002304	洋河股份	39,196,061.40	4.10
79	601998	中信银行	39,017,314.98	4.08
80	002004	华邦健康	38,829,424.83	4.06
81	600518	康美药业	38,585,292.32	4.04
82	002343	禾欣股份	38,459,677.01	4.02
83	300065	海兰信	38,225,960.75	4.00
84	300075	数字政通	38,097,587.93	3.98
85	002563	森马服饰	37,397,868.00	3.91
86	002221	东华能源	37,217,658.17	3.89
87	600054	黄山旅游	37,178,415.21	3.89
88	600663	陆家嘴	37,168,100.08	3.89
89	000523	广州浪奇	36,538,166.37	3.82
90	300291	华录百纳	36,534,336.40	3.82
91	002712	思美传媒	36,503,466.61	3.82
92	002251	步步高	36,393,292.32	3.81
93	300347	泰格医药	36,226,184.30	3.79
94	601688	华泰证券	36,209,402.68	3.79
95	002339	积成电子	36,143,195.66	3.78
96	601021	春秋航空	36,104,467.50	3.78
97	300146	汤臣倍健	35,637,306.11	3.73
98	002047	宝鹰股份	35,165,274.77	3.68
99	000607	华媒控股	35,034,019.64	3.66
100	300018	中元华电	34,855,637.05	3.65
101	002044	江苏三友	34,738,124.21	3.63
102	601628	中国人寿	33,866,070.06	3.54
103	600887	伊利股份	33,721,867.68	3.53
104	600958	东方证券	33,212,748.53	3.47

105	000078	海王生物	33,172,843.34	3.47
106	002063	远光软件	33,110,121.25	3.46
107	002400	省广股份	32,985,613.30	3.45
108	000967	上风高科	32,954,166.18	3.45
109	601799	星宇股份	32,944,594.09	3.45
110	300271	华宇软件	32,666,241.15	3.42
111	300166	东方国信	31,895,161.89	3.34
112	000651	格力电器	31,883,056.90	3.33
113	000768	中航飞机	31,407,660.48	3.28
114	300248	新开普	31,336,284.56	3.28
115	300338	开元仪器	31,173,186.97	3.26
116	000596	古井贡酒	31,025,901.36	3.24
117	002494	华斯股份	30,903,572.26	3.23
118	002049	同方国芯	30,414,366.14	3.18
119	002030	达安基因	30,048,793.04	3.14
120	002462	嘉事堂	29,636,845.82	3.10
121	000796	凯撒旅游	29,436,212.48	3.08
122	600038	中直股份	29,391,380.30	3.07
123	601857	中国石油	29,260,152.39	3.06
124	002589	瑞康医药	29,201,358.35	3.05
125	600115	东方航空	29,143,714.70	3.05
126	300302	同有科技	29,117,804.69	3.05
127	600697	欧亚集团	28,781,232.18	3.01
128	601888	中国国旅	28,698,873.02	3.00
129	600446	金证股份	28,512,918.09	2.98
130	002260	德奥通航	28,429,409.17	2.97
131	002197	证通电子	28,382,658.13	2.97
132	000829	天音控股	27,841,932.47	2.91
133	000671	阳光城	27,682,284.21	2.89
134	600588	用友网络	27,196,068.37	2.84
135	300207	欣旺达	27,154,382.80	2.84
136	002029	七匹狼	27,006,225.95	2.82
137	002024	苏宁云商	26,756,283.90	2.80
138	002376	新北洋	26,566,356.60	2.78
139	002477	雏鹰农牧	26,558,789.82	2.78
140	000001	平安银行	26,378,232.53	2.76
141	002179	中航光电	26,145,741.32	2.73
142	600009	上海机场	26,002,803.20	2.72
143	002011	盾安环境	25,563,482.63	2.67
144	002384	东山精密	25,432,024.28	2.66
145	002646	青青稞酒	25,395,676.01	2.66

146	300333	兆日科技	25,294,294.30	2.65
147	002354	天神娱乐	25,145,476.43	2.63
148	002390	信邦制药	24,985,328.71	2.61
149	600547	山东黄金	24,629,669.20	2.58
150	600570	恒生电子	24,512,777.57	2.56
151	600271	航天信息	24,419,314.56	2.55
152	002572	索菲亚	24,267,294.53	2.54
153	600893	中航动力	24,181,087.50	2.53
154	300349	金卡股份	24,131,033.75	2.52
155	600650	锦江投资	24,058,517.21	2.52
156	300183	东软载波	23,721,511.24	2.48
157	002311	海大集团	23,573,948.40	2.47
158	600862	南通科技	23,517,585.51	2.46
159	300100	双林股份	23,267,444.79	2.43
160	002344	海宁皮城	23,218,266.93	2.43
161	600699	均胜电子	23,134,238.82	2.42
162	600651	飞乐音响	23,105,026.55	2.42
163	300186	大华农	23,068,744.36	2.41
164	000697	炼石有色	22,874,454.70	2.39
165	002664	信质电机	22,826,341.10	2.39
166	002587	奥拓电子	22,691,555.53	2.37
167	002335	科华恒盛	22,674,974.60	2.37
168	002236	大华股份	22,322,823.66	2.33
169	000777	中核科技	22,319,694.51	2.33
170	600760	中航黑豹	22,146,746.13	2.32
171	002009	天奇股份	22,125,216.69	2.31
172	600754	锦江股份	21,997,964.20	2.30
173	600343	航天动力	21,966,783.18	2.30
174	002699	美盛文化	21,355,764.22	2.23
175	300031	宝通科技	21,205,131.26	2.22
176	600037	歌华有线	21,177,609.24	2.21
177	000547	航天发展	21,146,952.86	2.21
178	600491	龙元建设	20,734,924.05	2.17
179	300257	开山股份	20,717,061.69	2.17
180	002392	北京利尔	20,599,639.02	2.15
181	002766	索菱股份	20,391,078.41	2.13
182	600079	人福医药	20,300,570.14	2.12
183	000888	峨眉山 A	20,110,548.05	2.10
184	600701	工大高新	20,083,860.04	2.10
185	300188	美亚柏科	20,051,360.24	2.10
186	002113	天润控股	20,015,477.45	2.09

187	603993	洛阳钼业	19,727,933.73	2.06
188	600519	贵州茅台	19,652,213.00	2.06
189	600826	兰生股份	19,442,797.26	2.03
190	300086	康芝药业	19,349,178.87	2.02
191	600511	国药股份	19,318,152.86	2.02
192	000153	丰原药业	19,162,208.90	2.00

#### 8.4.3 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	10,337,180,741.86
卖出股票收入（成交）总额	10,780,249,823.63

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。

#### 8.5 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	162,438,100.00	14.43
2	央行票据	—	—
3	金融债券	122,166,000.00	10.85
	其中：政策性金融债	122,166,000.00	10.85
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	284,604,100.00	25.28

#### 8.6 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	150211	15 国开 11	600,000	60,174,000.00	5.35
2	019506	15 国债 06	450,000	45,108,000.00	4.01
3	019509	15 国债 09	400,000	40,088,000.00	3.56
4	110258	11 国开 58	300,000	31,959,000.00	2.84
5	150413	15 农发 13	300,000	30,033,000.00	2.67

#### 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	2,744,529.31
2	应收证券清算款	10,576,074.85
3	应收股利	—
4	应收利息	4,561,345.16
5	应收申购款	7,503,857.11
6	其他应收款	547.03
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	25,386,353.46

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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	300242	明家科技	33,068,524.00	2.94	筹划重大事项

#### 8.12.6 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。

## § 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 (%)
27,402	23,392.03	298,402,771.15	46.55	342,585,727.70	53.45

### 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	57,043.71	0.0089

### 9.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2002年08月16日)基金份额总额	4,616,913,656.00
报告期期初基金份额总额	815,014,727.68
本报告期基金总申购份额	609,548,172.81
减：本报告期基金总赎回份额	783,574,401.64
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	640,988,498.85

## § 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，本基金自2015年9月24日至2015年10月23日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》。本次会议决议于2015年10月26日起生效，会议结果已报中国证券监督管理委员会备案。

本次持有人大会决议生效后，根据本次会议通过的议案及《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书》，自2015年10月27日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效，具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

### 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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，本基金管理人已于2015年1月10日发布公告，李笑薇女士、朱少醒先生自2015年1月9日起担任公司副总经理；本基金管理人已于2015年1月31日发布公告，薛爱东先生自2015年1月30日起担任公司董事长。

### 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 10 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 13 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**

2015 年 7 月 29 日，中国证券监督管理委员会上海监管局向我司下发了《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，主要涉及投资权限管理、异常交易管理及员工行为管理等问题，并要求我司就上述问题于 2015 年 8 月 5 日前予以改正。对此我司高度重视，成立了整改工作小组，梳理相关制度流程，排查现行内控漏洞，针对性的制定了整改执行方案，完善了公司内部控制措施，并已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。

除上述情况外，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。

### 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		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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	4,778,323,722.16	22.63	96,159,023.00	31.16	482,500,000.00	14.48	—	—	4,294,780.96	22.55	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国联证券	2	1,775,763,717.79	8.41	—	—	14,400,000.00	0.43	—	—	1,618,937.75	8.50	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	5,576,154,395.97	26.41	—	—	—	—	—	—	5,006,602.17	26.29	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	4	3,156,837,007.92	14.95	68,606,863.80	22.23	1,385,400,000.00	41.57	—	—	2,888,519.05	15.17	—
兴业证券	2	5,477,051,366.29	25.94	143,847,901.50	46.61	1,319,500,000.00	39.59	—	—	4,915,997.53	25.81	—
华鑫证券	1	352,427,400.04	1.67	—	—	130,700,000.00	3.92	—	—	320,849.81	1.68	—

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：安信证券 31551；安信证券 395965。本报告期内本基金租用的席位齐鲁证券更名为中泰证券。其余租用券商交易单元未发生变动。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、为了保护基金份额持有人的合法权益，以更科学、合理的业绩比较基准评价基金的业绩表现，基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，决定自 2015 年 10 月 1 日起，变更本基金的业绩比较基准，并修改本基金招募说明书相应条款。上述变更事项基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

2、本报告期内，本基金自 2015 年 9 月 24 日至 2015 年 10 月 23 日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》。本次会议决议于 2015 年 10 月 26 日起生效，会议结果已报中国证券监督管理委员会备案。本次持有人大会决议生效后，根据本次会议通过的议案及《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书》，自 2015 年 10 月 27 日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效，具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。