富国富钱包货币市场基金

2015 年度报告摘要

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中信银行股份有限公司
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一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
基金托管人中信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	富国富钱包货币
基金主代码	000638
交易代码	000638
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年05月07日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,827,935,252.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内，在控制利率风险，尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 在投资管理过程中，基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	方翀
	联系电话	021-20361858	010-89936330
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95558
传真		021-20361634	010-85230024

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 中信银行股份有限公司 北京市东城区朝阳门北大街9号

§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5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日
本期已实现收益	67,606,679.65	17,907,148.92
本期利润	67,606,679.65	17,907,148.92
本期净值收益率	4.1176%	3.3354%
3.1.2期末数据和指标	2015年12月31日	2014年12月31日
期末基金资产净值	1,827,935,252.56	989,129,353.13
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注：所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

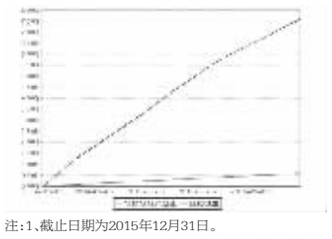
3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8644%	0.0042%	0.0894%	0.0000%	0.7750%	0.0042%
过去六个月	1.7372%	0.0034%	0.1789%	0.0000%	1.5583%	0.0034%
过去一年	4.1176%	0.0043%	0.3549%	0.0000%	3.7627%	0.0043%
自成立以来	7.5903%	0.0039%	0.5872%	0.0000%	7.0031%	0.0039%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

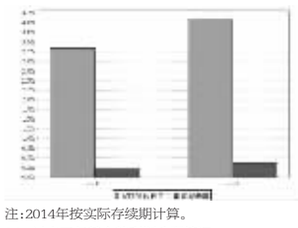
自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：1、截止日期为2015年12月31日。

2、本基金于2014年5月7日成立，建仓期6个月，即从2014年5月7日起至2014年11月6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自基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2014年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年	67,606,679.65	-	-	67,606,679.65	-
2014年	17,907,148.92	-	-	17,907,148.92	-
合计	85,513,828.57	-	-	85,513,828.57	-

注：本基金于2014年5月7日成立

§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		
王晓亮	本基金经理兼任富国收益宝货币市场基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理	2015-04-27	-	5年	硕士，曾任上海国利货币经纪有限公司经纪人，自2010年9月至2013年7月在富国基金管理有限公司任交易员；2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2014年8月起任富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年4月起任富国恒利分级债券型证券投资基金、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基金经理，2015年11月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理，2015年12月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
万莉	本基金经理兼任富国天时货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理	2015-10-09	-	9年	硕士，自2006年2月至2008年6月在广州银行任债券交易员；自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作，历任债券交易员、基金经理助理、基金经理；自2013年7月至2014年6月中融基金（原道富基金）管理有限公司工作，任现金管理投资总监；自2014年6月加入富国基金管理有限公司，2014年6月至2015年10月任固定收益投资部现金管理主管，2015年10月起任富国天时货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年12月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理、现任固定收益投资部现金投资总监兼基金经理。具有基金从业资格。
刘凌云	本基金前任基金经理	2014-08-05	2015-04-27	8年	硕士，自2007年7月至2013年6月在光大证券股份有限公司任债券交易员；自2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年4月任富国富钱包货币市场基金和富国天时货币市场基金基金经理。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富钱包货币市场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》、《富国富钱包货币市场基金基金合同》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未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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，全年国内生产总值676708亿元，按可比价格计算，比上年增长6.9%，较2014年增幅7.4%有所下降。在此环境下，央行采取一系列宽松的货币政策释放流动性，借 以引导实体经济利率下行，分别于2月5日、4月20日、9月6日、10月24日进行了四次降准，共降低存款准备金率250bp，并针对符合审慎经营要求且“三农”或小微企业贷款达到一定比例的银行进行了额外降准。在3月1日、5月11日、6月28日、8月26日、10月24日进行了五次降息， 一年期贷款基准利率从5.50%下降至4.25%， 一年期存款基准利率从2.75%下降至1.5%。央行还通过公开市场操作、SLO、SLF、MLF等货币宏观调节工具降低货币市场利率。

在此基础上，一年期AAA短融收益率一季度4.5%至4.8%之间短暂调整后，于二季度上旬出现明显下跌，跌幅约100bp左右，之后由于半年底冲击有所反弹， 6 月均值在 3.45%左右。三季度收益率维持在3.3%附近，并于四季度下降至3%附近。

2015年全年，基金管理人严格按照基金合同进行投资管理，在利率波动的环境中，兼顾了基金资产的流动性、安全性和收益性。灵活进行了短期债券的操作，充分赚取骑乘和票息收益，根据市场情况调整协议存款和回购等现金类配置比例，从而较大的提高了基金抵御流动性压力的能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金每万份基金净收益为0.7571元，7日年化收益率 （按日结转）为2.938%。本报告期内，本基金净值收益率为4.1176%，同期业绩比较基准收益率为0.3549%。

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，在人民币加入SDR货币篮子之后，海外机构投资者对人民币资产产生配置需求，其中主要将对债券配置有需求，所以中长期看，利率还有进一步下行空间，但需要把握短期利率波动风险。在2015年发生多笔信用违约的情况下，预计2016年债券信用违约风险依旧会有发生。

基金管理人将继续保持谨慎操作的态度，在保证安全性和流动性的前提下，积极把握市场利率市场波动，合理配置短期债券、协议存款、回购等配置比例，尽量创造更多额外收益性。

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

本基金本报告期已按《基金合同》的约定：“1、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；2、本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并全部分配，且每日进行支付”的条款进行收益分配。

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

在托管富国富钱包货币市场基金的过程中，本基金托管人公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国富钱包货币市场基金》的约定，对富国富钱包货币市场基金2015年度基金的投资运作，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遵规守信、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富国富钱包货币市场基金的投资运作、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富国富钱包货币市场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：富国富钱包货币市场基金

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）
资 产：		
银行存款	900,532,306.30	466,928,800.69
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,098,553,909.39	419,804,379.09
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,098,553,909.39	419,804,379.09
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	-	169,851,014.78
应收证券清算款	-	-
应收利息	25,038,507.85	10,828,644.63
应收股利	-	-
应收申购款	20,918,115.05	4,852,428.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,045,042,838.59	1,072,265,267.61
负债和所有者权益	本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014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	215,999,572.00	82,499,476.25
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	419,283.05	188,312.05
应付托管费	77,645.03	34,872.56
应付销售服务费	388,225.11	174,363.02
应付交易费用	36,430.08	23,236.44
应交税费	-	-
应付利息	13,235.77	17,427.90
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	173,194.99	198,226.26
负债合计	217,107,586.03	83,135,914.48
所有者权益：		
实收基金	1,827,935,252.56	989,129,353.13
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,827,935,252.56	989,129,353.13
负债和所有者权益总计	2,045,042,838.59	1,072,265,267.61

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,827,935,252.56份。

7.2 利润表

会计主体：富国富钱包货币市场基金

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5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日)
一、收入	82,424,658.57	21,030,008.45
1.利息收入	76,898,708.08	20,696,147.96
其中：存款利息收入	44,367,293.19	13,913,706.42
债券利息收入	28,571,936.86	5,224,422.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,959,478.03	1,558,018.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	5,513,785.77	333,860.49
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,513,785.77	333,860.49
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	12,164.72	-
减：二、费用	14,817,978.92	3,122,859.53
1. 管理人报酬	4,698,130.18	980,323.12
2. 托管费	870,024.09	181,541.28
3. 销售服务费	4,350,120.51	907,706.60
4. 交易费用	-120.00	165.00
5. 利息支出	4,654,982.39	871,699.57
其中：卖出回购金融资产支出	4,654,982.39	871,699.57
6. 其他费用	244,841.75	181,423.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	67,606,679.65	17,907,148.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	67,606,679.65	17,907,148.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国富钱包货币市场基金

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）	989,129,353.13	-	989,129,353.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,606,679.65	67,606,679.65
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）	838,805,899.43	-	838,805,899.43
其中：1.基金申购款	18,077,370,840.71	-	18,077,370,840.71
2.基金赎回款	-17,238,564,941.28	-	-17,238,564,941.28
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）	-	-67,606,679.65	-67,606,679.65
五、期末所有者权益（基金净值）	1,827,935,252.56	-	1,827,935,252.56
项目	上年度可比期间(2014年5月7日(基金合同生效日)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）	209,624,376.19	-	209,624,376.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,907,148.92	17,907,148.92
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）	779,504,976.94	-	779,504,976.94
其中：1.基金申购款	2,823,297,082.99	-	2,823,297,082.99
2.基金赎回款	-2,043,792,106.05	-	-2,043,792,106.05
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）	-	-17,907,148.92	-17,907,148.92
五、期末所有者权益（基金净值）	989,129,353.13	-	989,129,353.13

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

基金管理公司负责人 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、基金销售机构、注册登记机构
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
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
中信银行股份有限公司	基金托管人

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 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。

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有应支付的关联方佣金。

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5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	4,698,130.18	980,323.12
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H = E × 0.27% ÷ 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5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	870,024.09	181,541.28

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H = E × 0.05% ÷ 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。

7.4.4.2.3 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（2015年01月01日至2015年12月31日）
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	合计
富国基金管理有限公司	435012.51
合计	435012.51

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(2014年5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日)
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	合计
富国基金管理有限公司	806,680.01
海通证券	77,619.61
合计	884,299.62

注：本基金的年销售服务费率为0.25%，若将来本基金增加基金份额类别的，本基金各类份额的年销售服务费率最高为0.25%，各类基金份额的销售服务费计提的计算公式具体如下：

H = E × 年销售服务费率 ÷ 当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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
中信银行	99,891,200.00	-	-	-	-	-
上年度可比期间(2014年5月7日(基金合同生效日)至2014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
-	-	-	-	-	-	-

注：本基金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。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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5月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日)
基金合同生效日（2014年05月07日）持有的基金份额	200,000,000.00	200,000,000.00
期初持有的基金份额	-	200,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	1,658,731.95
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	201,658,731.95
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1.本基金管理人认购/申购本基金份额的费率按照本基金发售公告的条款执行，不存在费率优惠的情况。本基金管理人本期投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

2.期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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及上年度末均未投资本基金。

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5月7日(基金合同生效日)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
中信银行股份有限公司	200,532,306.30	2,479,618.68	928,800.69	1,904,620.16

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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末2015年12月31日止，基金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为人民币215,999,572.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
011599712	15山钢SCP006	2016-01-04	99.97	400,000	39,988,208.53
150202	15国开02	2016-01-04	100.09	600,000	60,054,221.23
150311	15进出11	2016-01-04	99.92	1,000,000	99,918,701.95
150419	15农发19	2016-01-04	99.94	160,000	15,990,159.84
合计				2,160,000	215,951,291.55

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0.00元，属于第二层次的余额为人民币1,098,553,909.39元，属于第三层次余额为人民币0.00元。(于2014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级的余额为人民币0.00元，属于第二层级的余额为人民币419,804,379.09元，属于第三层级余额为人民币0.00元。)

7.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融