富国天惠精选成长混合型证券投资基金

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：	中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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

场内简称	富国天惠
基金简称	富国天惠成长混合(LOF)
基金主代码	161005
交易代码	前端交易代码:161005 后端交易代码:161006
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	1,457,315,912.24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

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	范伟隽	洪渊
	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

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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55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	2013年
本期已实现收益	2,091,365,850.24	481,004,491.79	546,096,850.68
本期利润	2,144,692,375.69	671,323,028.49	686,656,088.07
加权平均基金份额本期利润	1.3300	0.3462	0.2497
本期基金份额净值增长率	69.23%	25.42%	18.18%
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	1.7455	0.7103	0.5463
期末基金资产净值	4,045,578,730.54	3,127,674,592.06	3,295,807,094.41
期末基金份额净值	2.7760	1.7675	1.5468

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润收入、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	32.05%	2.02%	11.99%	1.17%	20.06%	0.85%
过去六个月	-0.29%	3.23%	-10.42%	1.83%	10.13%	1.40%
过去一年	69.23%	2.76%	7.47%	1.71%	61.76%	1.05%
过去三年	150.82%	1.88%	40.17%	1.23%	110.65%	0.65%
过去五年	99.11%	1.64%	23.03%	1.10%	76.08%	0.54%
自基金合同生效日起至今	962.66%	1.68%	248.83%	1.31%	713.83%	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(benchmark1)按下列公式计算:

benchmark1 =70% *[沪深300指数t/沪深300指数(t-1)-1] +25% *[中债综合全价指数t/中债综合全价指数(t-1)-1]+ 5% * 同业存款利率 / 360 ;

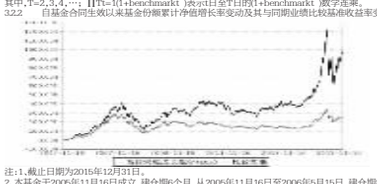
其中,t=1,2,3,…, T,T表示时间截至日;

期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

benchmarkT =[∏Tt=1(+benchmark1)]-1

其中,T=2,3,4,…, [∏Tt=1(+benchmark1)表示1日至T日的(1+benchmark1)数字连乘。

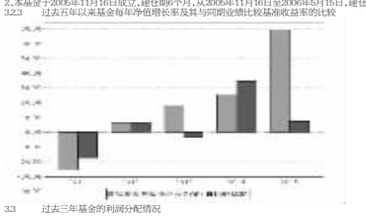
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.截止日期为2015年12月31日。

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。

3.2.3 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	1.400	136,378,393.17	110,449,182.42	246,827,575.59	1次分红
2014年	1.350	167,523,796.63	117,818,726.31	285,342,522.94	1次分红
2013年	-	-	-	-	-
合计	2.750	303,902,189.80	228,267,908.73	532,170,098.53	-

§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,基金管理人共管理富国天惠成长混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪深300增强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、富国趋势通相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、富国新天珠定期开放债券型证券投资基金、富国新能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、富国高端制造行业股票型证券投资基金A、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国新兴消费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、富国中证新能源汽车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、富国国债收益凭证市场基金、富国改益宝货币市场基金、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40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、富国改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		
朱少醒	本基金基金经理兼任副总经理、权益投资部总经理	2005-11-16	-	17年	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2006年8月任富国天益价值证券投资基金基金经理助理，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邻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批不得进行;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、不同产品类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,监管稽核流程情况要求相关当事人做出合理性解释,并按法规要求上报稽区监管机构。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40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,宏观经济全年承受较大的拨现压力。股市经历了大加杠杆、快速去杠杆、常态化的过程。股指剧烈波动,但从全年的维度来看,沪深300和创业板指都有不同程度的上涨。

本基金是成长型风格,且以自下而上的选股投资为主,全年基金维持在九十以上的仓位。本基金在行业和风格资产的配置上相对均衡。在市场出现极端调整情况下,适度均衡是组合流动性的良好保障。

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2.7760元,份额累计净值为4.8140元。本报告期内,本基金份额净值增长率为69.23%,同期业绩比较基准收益率为27.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年的中国宏观经济下行的挑战依然严峻,期间不排除出现对通缩的担忧。出口复苏情况,投资的持续性都是我们需要密切关注的中短期数据,包括还需要保持高度警惕的位用风险事件爆发的可能性。投资者对本轮的经济调整需要做更长时间的心理准备。系统的一面是,货币政策在可预见的一段时期内将保持宽松,财政政策也更为积极。市场上行的机会可能在于流动性的持续宽松和投资者重新将注意力投向在改革带来的长期替代红利的逐步释放上。无风险利率中枢的长期下行在未来是较大概率事情。但去年策略中预期的投资长期风险偏好上升在经历剧变后应该得不确定。

16年市场的机会或许更多会是优质个股的阶段法机会以及政府推动力足够强的主题性机会和产业格局变迁带来的新兴行业兴起的机会。从大类资产比较来看,资产荒将第下权益资产具有相对吸引力,以较长的时间区间来看,当期价值下依然能找到足够数量的个股去追求企业成长带来的回报。本基金的核心在位将继续以合理的估值持有具有长期竞争力的公司,分享企业目身成长带来的价值。个股选择层面,本基金偏好投资于具有因好“企业基因”、公司治理结构完善、管理层优秀的企业。分享企业目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原则,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1月16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1.40元,共计派发红利26827575.59元。

本基金于2016年2月19日公告对2015年报告期内利润进行收益分配,每10份基金份额派发红利6.50元,共计派发红利126664529.16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

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对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为246,827,575.59元。

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2015年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

2016年3月24日

§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:富国天惠精选成长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

姓名		
资 产:		
银行存款		
结算备付金		
存出保证金		
交易性金融资产		
其中:股票投资		
基金投资		
债券投资		
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		
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计		
负债和所有者权益		
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		
应付赎回款		
应付管理人报酬		
应付托管费		
应付销售服务费		
应付交易费用		
应交税费		
应付利息		
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计		
所有者权益:		
实收基金		
未分配利润		
所有者权益合计		
负债和所有者权益总计		4,073,459,360.32

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.7760元,基金份额总额1,457,315,912.24份。

7.2 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:2015年01月01日至2015年12月31日

单位:人民币元

姓名		
一、收入		
1.利息收入		
其中:存款利息收入		
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入		
其他利息收入		
2.投资收益(损失以“-”填列)		
其中:股票投资收益		
基金投资收益		
债券投资收益		
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)		
减:二、费用		
1. 管理人报酬		
2. 托管费		
3. 销售服务费		
4. 交易费用		
5. 利息支出		
其中:卖出回购金融资产支出		
6. 其他费用		
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		
减:所得税费用		
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,144,692,375.69

7.3 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: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)	1,769,554,943.97	1,358,119,648.09	3,127,674,592.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,144,692,375.69	2,144,692,375.69
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)	-312,239,031.73	-667,721,629.89	-979,960,661.62
其中:1.基金申购款	1,521,325,141.46	2,193,969,470.28	3,715,294,611.74
2.基金赎回款	-1,833,564,173.19	-2,861,691,100.17	-4,695,255,273.36
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)	-	-246,827,575.59	-246,827,575.59
五、期末所有者权益(基金净值)	1,457,315,912.24	2,588,262,818.30	4,045,578,730.54
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)	2,130,666,437.18	1,165,140,657.23	3,295,807,094.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	671,323,028.49	671,323,028.49
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)	-361,111,493.21	-193,001,514.69	-554,113,007.90
其中:1.基金申购款	774,146,966.21	416,889,628.80	1,191,036,595.01
2.基金赎回款	-1,135,258,459.42	-609,891,143.49	-1,745,149,602.91
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)	-	-285,342,522.94	-285,342,522.94
五、期末所有者权益(基金净值)	1,769,554,943.97	1,358,119,648.09	3,127,674,592.06

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

本基金本期未发生重大会计差错,无需更正。

7.4.3 关联方关系

项目	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	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
中国工商银行股份有限公司	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中银万国证券股份有限公司(“中银万国”)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,原山东省国际信托股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	4,480,587,101.81	13.91	1,874,916,139.35	12.02
申万宏源	1,466,709,084.89	4.55	-	-
中银万国	-	-	1,026,463,769.15	6.58

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(%)
海通证券	101,588.50	100.00	3,062,566.71	2.97
中银万国	-	-	5,400,069.00	5.24

7.4.4.1.4 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。

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	4,039,950.28	13.88	1,623,419.74	16.58
申万宏源	1,348,696.13	4.63	581,966.74	5.94
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(%)
海通证券	1,667,410.33	11.95	964,551.37	17.92
申银万国	934,492.06	6.70	657,089.01	12.21

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司席位费用后的净额列示。海通证券除基金买卖证券交易外,还为其提供投资顾问服务、证券经纪业务等服务,故其交易对价还包括相关服务内容。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	58,122,611.89	43,189,752.73
其中:支付销售机构的客户维护费	9,230,474.47	5,691,407.23

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×1.50%/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	9,687,102.07	7,198,292.13

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×0.25%/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

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。

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

注:本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末(2015年31日)		上期末(2014年12月31日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
富国资产管理(香港)有限公司-客户资金(交易所)	-	-	28,858,500.75	1.63

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
中国工商银行股份有限公司	149,259,924.45	1,341,543.54	46,050,224.55	487,310.14

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

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
000002	万科A	2015-12-18	重大事项停牌	24.43	-	-	600,000	8,872,300.73	14,658,000.00	-
000796	凯撒旅游	2015-11-09	重大事项停牌	27.46	-	-	1,402,612	35,509,890.80	38,515,725.52	-
002044	美年健康	2015-08-31	重大事项停牌	30.87	-	-	12,400	395,676.28	382,788.00	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项停牌	17.40	-	-	50,000	878,498.49	870,000.00	-
002053	云南盐化	2015-11-19	重大事项停牌	25.84	2016-03-14	23.26	50,000	930,702.10	1,292,000.00	-
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项停牌	42.69	2016-01-18	38.42	100,000	4,039,792.00	4,269,000.00	-
300049	福瑞股份	2015-11-30	重大事项停牌	31.00	2016-01-04	30.95	50,000	1,409,591.21	1,550,000.00	-
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项停牌	58.80	-	-	30,000	1,415,491.87	1,764,000.00	-
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项停牌	49.96	2016-01-22	44.96	100,000	4,903,000.00	4,996,000.00	-
300431	暴风科技	2015-10-27	重大事项停牌	95.83	-	-	10,000	585,932.39	958,300.00	-
600153	建发股份	2015-06-29	重大事项停牌	14.73	-	-	20,000	289,131.14	294,600.00	-
600420	现代制药	2015-10-21	重大事项停牌	37.15	2016-03-23	33.44	31,000	1,158,687.87	1,151,650.00	-
600682	南京新百	2015-07-01	重大事项停牌	32.98	2016-01-27	33.78	100,000	4,471,398.32	3,298,000.00	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项停牌	31.25	2016-03-10	29.00	10,000	323,409.38	312,500.00	-
600749	西藏旅游	2015-11-30	重大事项停牌	23.62	-	-	500,000	9,967,326.11	11,810,000.00	-
600990	四创电子	2015-08-31	重大事项停牌	62.75	2016-03-25	69.03	10,000	820,033.00	627,500.00	-

注:公司名称“江苏三友集团股份有限公司”(简称“江苏三友”)于2016年1月8日起变更为“美年大健康产业控股股份有限公司”(简称“美年健康”)。

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