富国中证移动互联网指数分级证券投资基金

【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：	招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	富国中证移动互联网指数分级		
基金主代码	161025		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年09月02日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,837,320,663.00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	2014年9月12日		
下属三级基金的基金简称	互联网A	互联网B	富国中证移动互联网指数分级
下属三级基金场内简称	互联网A	互联网B	移动互联
下属三级基金的交易代码	150194	150195	161025
报告期末下属三级基金的份额总额（单位：份）	746,155,740.00	746,155,740.00	1,345,009,183.00

2.2基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证移动互联网指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证移动互联网指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以报合、跟踪中证移动互联网指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
业绩比较基准	95%×中证移动互联网指数收益率＋5%×银行人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。		
下属三级基金的风险收益特征	富国移动互联网A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	富国移动互联网B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟炜	郭杰
	联系电话	021-20361818	0755-82943666
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	zctg@cmschina.com.cn
客户服务电话		95105686,4008880688	95565
传真		021-20361616	0755-82960794

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楼 招商证券股份有限公司 深圳市福田区益田路江苏大厦 38楼-45楼

§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9月2日(基金合同生效日)至2014年12月31日
本期已实现收益	-2,623,513,096.70	12,058,078.62
本期利润	-2,674,358,794.43	3,266,290.70
加权平均基金份额本期利润	-0.7443	0.0063
本期基金份额净值增长率	28.64%	6.95%
3.1.2期末数据和指标	2015年12月31日	2014年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.4613	0.0159
期末基金资产净值	2,757,233,429.59	983,912,749.23
期末基金份额净值	0.972	1.061

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	32.22%	2.42%	31.79%	2.36%	0.43%	0.06%
过去六个月	-22.39%	3.30%	-11.73%	3.49%	-10.66%	-0.19%
过去一年	28.64%	2.98%	56.88%	3.12%	-28.24%	-0.14%
自基金合同生效日起至今	37.58%	2.65%	81.13%	2.79%	-43.55%	-0.14%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：

95%×中证移动互联网指数收益率＋5%×银行人民币活期存款利率（税后）

由于本基金投资标的指数为中证移动互联网指数，且每个交易日日终在系统投资限资合约需确协的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，因此，本基金将业绩比较基准定为95%×中证移动互联网指数收益率＋5%×银行人民币活期存款利率（税后）。

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（benchmark t）按下列公式计算：

benchmark t =95%*［中证移动互联网指数t/中证移动互联网指数(t-1)-1］+5%*银行人民币活期存款利率（税后）/360;

其中，t=1,2,3,…，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmark T）按下列公式计算：

benchmark T =[∏Tt=1(1+benchmark t)-1

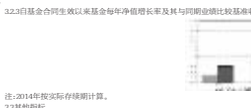
其中，T=2,3,4,…；∏Tt=1(1+benchmark t)表示1日至T日的(1+benchmark t)数字连乘。

3.2.2日基金净值表现与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2014年9月2日成立，建仓期6个月，即从2014年9月2日起至2015年3月1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日基金净值收益率与年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2014年按实际存续期计算。

3.3其他指标

其他指标	本期末（2015年12月31日）
互联网A与互联网B基金份额配比	1:1
期末互联网A份额参考净值	1.002
期末互联网A份额累计参考净值	1.076
期末互联网B份额参考净值	0.942
期末互联网B份额累计参考净值	2.202
富国互联网A的预计年收益率	5.75%

3.4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	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：基金自2014年9月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日未进行利润分配。

§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惠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、富国天瑞强势策略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指数证券投资基金、富国趋势精选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、富国稳添利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、富国国债电信等权指数证券投资基金、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、富国改益宝分期货货币市场基金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
牛志冬	本基金基金经理兼任富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理	2015-05-13	-	8年	硕士，自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员；自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理；自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司投资经理；自2015年5月起任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基金经理。具有基金从业资格。
王保合	本基金基金经理兼任量化投资总监、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金基金经理	2015-04-15	-	9年	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任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基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
章根元	本基金前任基金经理	2014-09-02	2015-05-13	7年	硕士，自2008年7月至2011年5月在建信基金管理有限责任公司任研究员助理，初级研究员、研究员；自2011年5月至2013年12月在富国基金管理有限公司任基金经理助理，自2013年12月至2015年5月任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月至2015年5月任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2014年9月至2015年5月任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2014年12月至2015年5月任富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理，2015年3月至2015年5月任富国中证银行指数分级证券投资基金基金经理，2015年5月任富国中证全指证券公司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、富国中证银行指数分级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中证移动互联网指数分级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》、《富国中证移动互联网指数分级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》，对证券的一级市场中购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、投权、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获取权、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，通过标准化的分公司模式，对交易方审核、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、交易对手库及投权管理，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和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时内隔制行为，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）的净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，分析对象基差分券、年金、北保及专户产品，并建立分析问题组合（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，监察稽核岗按照规定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96%的置信水平下，对同向交易价差进行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次同日反向交易或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年上半年，随着央行连续降息带来流动性宽松，叠加金融改革、经济转型推进降低风险溢价，促使居民的大量资产配置行为发生改变，股市替代房地产，成为居民资产配置的首选。2季度，在场内券商融资及场外配资等杠杆资金的作用下，A股市场迎来加速上涨，但同时剔除波动幅度也明显加大，特别是6月份以后主要热数日超高振幅超过10%。6月中旬以后，随着市场资金去杠杆，同时伴随着人民币贬值等事件的出现，3季度A股出现一轮大幅调整行情，在此期间，以证金公司为代表的国家队积极救市，在一定程度上缓解了场外配资强平带来的流动性风险。从6月中旬的高点，到9月下旬的低点，上证综指、创业板指数等代表性指数跌幅分别超过40%、50%。4季度以来，随着再融金额的快速下降和场外配资的清理进入尾声，市场经过充分调整之后迎来一些积极变化，保险公司的频频举牌带动市场逐步震荡反弹。从全年来看，代表未来经济转型创新方向的创业板上涨幅度较大，2015年创业板指数上涨84.41%，而受经济下行压力的影响，银行、资源品等行业占比较高的上证综指反弹幅度相对较小，2015年上证综指上涨9.41%。其中，2015年中证移动互联指数上涨104.54%。

在投资管理上，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。本基金在报告期内遇到多次大额申购赎回，同时受上市公司大面积停牌的影响，时且增加了本基金的交易成本。

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0.972元，份额累计净值为1.622元。本报告期内，本基金份额净值增长率为28.64%，同期业绩比较基准收益率为54.88%。

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，A股经过1年多的大幅波动后，市场的资金供需、投资者信心、估值体系、结构主线都将寻找新的平衡。目前来看，美联储加息、人民币贬值、上市公司大幸解禁、注册制增加供给等因素都给市场投资者带来担忧，市场将未出现较为剧烈持续的投资主线，更多机会将来自市场的超跌反弹。从全年来看，期待经济数据企稳改革及其他改革的执行情况，改革的逐步落实将有望使市场投资者信心重新恢复。

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，成员包括基金首算、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

根据本基金基金合同约定，"在存续期内，本基金（包括富国移动互联网分级、富国移动互联网A分额、富国移动互联网B分额）不进行收益分配。"因此本报告期内本基金未进行收益分配。

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

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全履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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§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：富国中证移动互联网指数分级证券投资基金

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）
资 产：		
银行存款	191,796,588.78	85,232,874.67
结算备付金	952,497.76	700,210.87
存出保证金	19,404,226.62	356,818.72
交易性金融资产	2,608,550,653.99	905,341,883.66
其中：股票投资	2,608,550,653.99	903,548,156.40
基金投资	-	-
债券投资	-	1,793,727.26
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	-	6,002,613.67
应收利息	112,849.54	45,672.47
应收股利	-	-
应收申购款	3,726,985.21	1,951,252.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,824,543,801.90	999,631,326.37
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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	61,330,421.80	13,109,059.41
应付管理人报酬	2,668,281.54	805,824.10
应付托管费	320,193.78	96,698.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,503,344.31	1,471,945.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	488,130.88	235,049.73
负债合计	67,310,372.31	15,718,577.14
所有者权益：		
实收基金	2,024,669,231.94	920,242,321.94
未分配利润	732,564,197.65	63,670,427.29
所有者权益合计	2,757,233,429.59	983,912,749.23
负债和所有者权益总计	2,824,543,801.90	999,631,326.37

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值0.972元，基金份额总额2,837,320,663.00份，其中：富国中证移动互联网指数分级份额净值0.972元，份额总额1,345,009,183.00份；互联网A份额净值1.002元，份额总额746,155,740.00份；互联网B份额净值0.942元，份额总额746,155,740.00份。

7.2利润表

会计主体：富国中证移动互联网指数分级证券投资基金

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9月2日(基金合同生效日)至2014年12月31日)
一、收入	-2,594,419,330.01	7,537,648.37
1.利息收入	6,483,938.87	810,988.77
其中：存款利息收入	6,446,224.15	575,185.73
债券利息收入	943.05	317.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	36,771.67	235,485.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	-2,567,864,527.49	14,806,329.02
其中：股票投资收益	-2,586,227,561.27	14,753,055.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,839,340.93	-
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	13,523,692.85	53,273.25
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-50,845,697.73	-8,791,787.92
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	17,806,956.34	712,118.50
减：二、费用	79,939,464.42	4,271,357.67
1. 管理人报酬	34,437,936.67	1,780,202.47
2. 托管费	4,132,552.44	213,624.30
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	40,320,216.65	2,040,112.14
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	1,048,758.66	237,418.76
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-2,674,358,794.43	3,266,290.70
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-2,674,358,794.43	3,266,290.70

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证移动互联网指数分级证券投资基金

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）	920,242,321.94	63,670,427.29	983,912,749.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,674,358,794.43	-2,674,358,794.43
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）	1,104,426,910.00	3,343,252,564.79	4,447,679,474.79
其中：1.基金申购款	10,631,242,061.22	8,061,593,566.04	18,692,835,627.26
2.基金赎回款	-9,526,815,151.22	-4,718,341,001.25	-14,245,156,152.47
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,024,669,231.94	732,564,197.65	2,757,233,429.59
项目	上年度可比期间(2014年9月2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）	409,897,261.47	-	409,897,261.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,266,290.70	3,266,290.70
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）	510,345,060.47	60,404,136.59	570,749,197.06
其中：1.基金申购款	1,053,033,001.25	87,174,345.98	1,140,207,347.23
2.基金赎回款	-542,687,940.78	-26,770,209.39	-569,458,150.17
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	920,242,321.94	63,670,427.29	983,912,749.23

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 密青松

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》和其他相关规定所规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

本基金本报告期无需会计差错的内容和更正金额。

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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
富国量化增强1号混合型资产管理计划	基金管理人控制的资产管理计划

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

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。

7.4.4.1.4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

注：本基金本报告期应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9月2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	34,437,936.67	1,780,202.47
其中：支付销售机构的客户维护费	5,005,707.20	281,354.24

注：基金管理费按前一日基金资产净值的100%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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9月2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	4,132,552.44	213,624.30

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.12%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.4.3认购费用

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。

7.4.4.4交易佣金

注：本基金无因交易而产生的应支付关联方的佣金。

7.4.4.5因提供担保或流动性支持而与关联方发生的交易

注：本基金无因提供担保或流动性支持而与关联方发生的交易。

7.4.5期末持有的关联方投资情况

7.4.5.1通过关联方交易单元进行的交易

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
000901	航天科技	2015-08-19	重大事项停牌	42.14	2016-02-18	47.59	655,453	37,933,449.39	27,620,789.42	-
002049	同方国芯	2015-12-11	重大事项停牌	60.15	2016-03-11	54.14	424,122	16,845,952.02	25,510,938.30	-
002065	东华软件	2015-12-21	重大事项停牌	25.10	-	-	1,558,588	42,877,706.75	39,120,558.80	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事项停牌	89.53	2016-02-15	80.58	156,651	16,768,232.57	14,024,964.03	-
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事项停牌	52.62	2016-03-15	47.36	408,542	18,680,543.15	21,497,480.04	-
300010	立思辰	2015-12-30	重大事项停牌	31.90	2016-01-08	28.71	709,617	23,087,465.06	22,636,782.30	-
300028	金亚科技	2015-06-09	重大事项停牌	24.48	-	-	1,237,795	48,237,019.47	30,301,221.60	-
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项停牌	58.80	-	-	1,634,604	89,214,896.75	96,114,715.20	-
300336	新文化	2015-12-24	重大事项停牌	42.00	-	-	346,350	13,232,970.18	14,546,700.00	-
600271	航天信息	2015-10-12	重大事项停牌	71.46	-	-	965,761	65,821,329.26	69,013,281.06	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项停牌	31.25	2016-03-10	29.00	491,557	17,110,158.28	15,361,156.25	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项停牌	21.33	2016-01-21	20.10	5,649,258	90,409,219.46	120,498,673.14	-

7.4.5.2期末债券正回购交易中作为抵押的债券1.1.1.1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。

1.1.1.2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。

1.1.2有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.11公允价值

7.4.11.1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。

7.4.11.2以公允价值计量的金融工具

7.4.11.2.1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