

富国医疗健康行业混合型证券投资基金

富国优化增强债券型证券投资基金

【2016】第一季度报告

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期：2016年04月22日	

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。
基金管理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4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书。
本报告所载数据截至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	富国医疗健康行业混合
基金代码	010022D
交易代码	前缀交易代码:010002D 后缀交易代码:010002D
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年08月07日
报告期末基金份额总额(单位:万)	1,047,433,227.67
投资目标	本基金主要投资于医疗健康行业股票，通过精选个股风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准收益的投资回报。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金的风险收益特征属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-289,223,493.34
2.本期利润	-279,472,264.88
4.加权平均基金份额本期利润	-0.2639
4.本期基金份额净值	2.174,311,963.04
5.本期基金份额净值增长率	2.077

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、基金赎回费），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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-14.01%	2.00%	-13.01%	-2.26%	-1.01%
过去三个月	-14.01%	2.00%	-13.01%	-2.26%	-1.01%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔		104,050.00	0.00
B 医药生物		1,814,769,286.14	83.46
C 制造业		153,000.00	0.01
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		-	-
K 建筑业		-	-
F 批发和零售业		97,233,526.26	4.47
G 交通运输、仓储和邮政业		-	-
H 信息传输、软件和信息技术服务业		223,070.00	0.01
J 金融保险		-	-
K 房地产业		-	-
L 租赁和商务服务业		-	-
M 科学技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		-	-
O 国防军工		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		1,161,793.12	0.07
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		1,914,078,686.52	89.61

5.3 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	002039	金通威	10,172,460	214,536,970.00	9.97
2	002051	横店东磁	10,081,201	213,722,733.00	9.93
3	300347	华金矿业	11,050,000	206,746,000.00	9.61
4	000062	广州药业	9,476,462	202,666,768.88	9.52
5	000087	深圳华强	15,244,032	196,021,069.28	9.11
6	000009	金城医药	5,369,289	147,659,362.11	6.79
7	600139	万达路桥	7,038,526	117,086,233.36	5.42
8	002052	江苏钢研	3,876,766	113,069,376.00	5.24
9	300451	花园生物	3,169,864	112,176,172.00	5.16
10	000236	华兰医院	8,221,072	109,761,244.66	5.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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)	-
股指期货持仓盈利或亏损合计(元)	-
股指期货持仓公允价值变动损益(元)	-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金股指期货持仓的投资政策

本基金股指期货持仓将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货持仓政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2 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)	-
国债期货持仓盈利或亏损合计(元)	-
国债期货持仓公允价值变动损益(元)	-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货持仓的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“广济药业”的发行主体湖北广济药业股份有限公司（以下简称“公司”）发布公告，公司于2015年6月30日接到武汉市环保局下发的《行政处罚决定书》（武环罚告字〔2015〕第21号），公司因废水排放问题被责令拆除排水排污设施，并处以人民币10万元的罚款。

基金管理人将密切跟踪相关情况，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余各名证券发行主体本期未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。

5.11.2 申明本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。

报告期内本基金基金投资的十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,813,449.64
2	应收证券清算款	43,073,670.34
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	80,319.69
6	其他应收款	2,351,281.87
7	其他	-
8	合计	49,159,222.36

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.6 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项存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

序号	名称	单位:份
1	转出基金份额	43,073,670.34
2	申购基金份额	-
3	赎回基金份额	-
4	其他	-
5	合计	49,159,222.36

5.11.7 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。

5.11.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.9 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项存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

序号	名称	单位:份
1	转出基金份额	43,073,670.34
2	申购基金份额	-
3	赎回基金份额	-
4	其他	-
5	合计	49,159,222.36

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	321,78,243.47

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金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 本报告期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	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%
过去三个月	-0.25%	0.32%	-0.30%	0.26%	0.04%

注：过去三个月指2016年1月1日至2016年3月31日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日至2016年03月31日)	比较基准(2016年01月01日至2016年03月31日)
1.本期已实现损益	-2,320,486.47	-1,948,789.16
2.本期利润	-2,101,721.04	-1,948,789.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087	-0.0106
4.本期基金份额净值	625,26,114.51	32