

富国天益价值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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人中国交通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	富国天益价值混合
基金主代码	100020
交易代码	前端交易代码：100020 后端交易代码：100021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月15日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,331,587,382.36份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属价值型基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票，或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的投资策略。本基金在大类资产配置和行业配置层面，遵循自上而下的积极策略，个股选择层面，遵循自下而上的积极策略。根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断，决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响，最大限度地确保基金资产的安全。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+中债综合全价指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为价值型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	汤嵩彦
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216

## 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 交通银行 上海市浦东新区银城中路188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	2,946,352,472.12	863,104,648.13	287,777,369.30
本期利润	2,459,704,907.50	1,195,498,731.61	510,247,443.47
加权平均基金份额本期利润	0.7476	0.1782	0.0578
本期基金份额净值增长率	42.91%	20.87%	6.46%
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	0.5560	-0.0130	-0.1495
期末基金资产净值	3,627,936,843.05	5,781,229,226.77	6,818,918,256.92
期末基金份额净值	1.5560	1.0888	0.9008

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，封闭式基金交易佣金、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	30.49%	2.02%	15.75%	1.59%	14.74%	0.43%
过去六个月	-8.53%	3.18%	-14.93%	2.49%	6.40%	0.69%
过去一年	42.91%	2.72%	7.32%	2.32%	35.59%	0.40%
过去三年	83.90%	1.84%	49.39%	1.66%	34.51%	0.18%

过去五年	53.42%	1.58%	21.19%	1.50%	32.23%	0.08%
自基金合同生效日起至今	872.27%	1.52%	263.58%	1.72%	608.69%	-0.20%

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×95%+中债综合全价指数收益率×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（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{沪深 300 指数}_t / (\text{沪深 300 指数}_{t-1}) - 1] + 5\% * [\text{中信国债指数}_t / (\text{中信国债指数}_{t-1}) - 1] ;$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

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

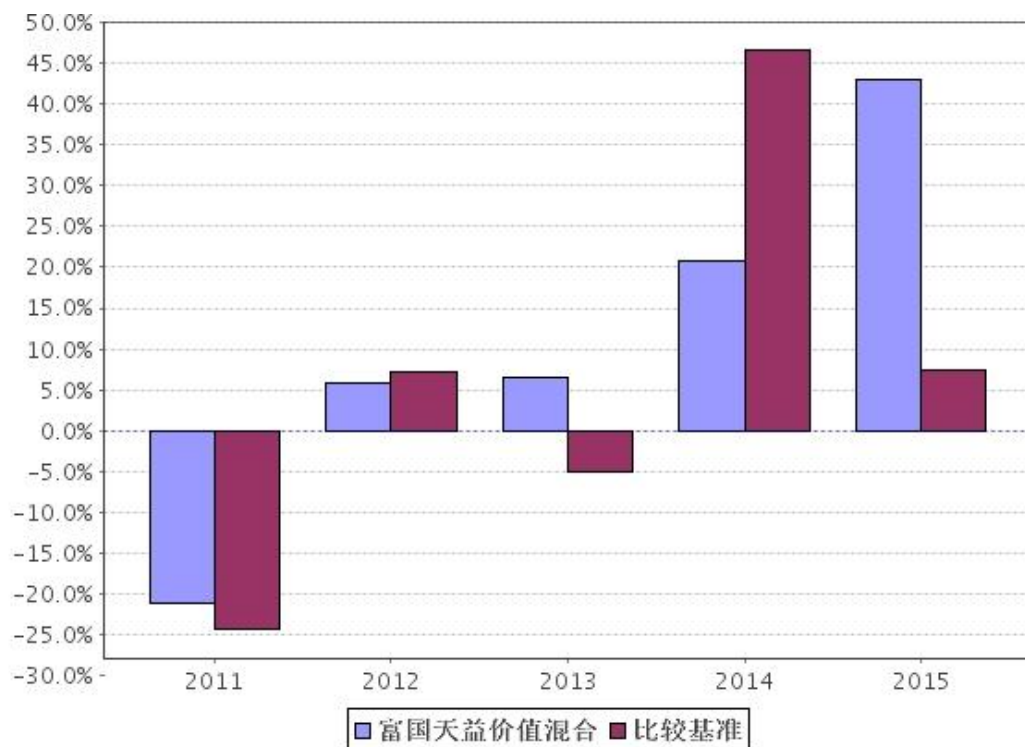
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2015 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2004 年 6 月 15 日成立，建仓期 6 个月，从 2004 年 6 月 15 日至 2004 年 12 月 14 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于 2007 年 11 月 6 日大比例分红规模急剧扩大，建仓期 3 个月，从 2007 年 11 月 5 日至 2008 年 2 月 4 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	—	—	—	—	—
2014年	—	—	—	—	—
2013年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注：本基金过往三年未发生利润分配

## § 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、富国全球债券投资基金、富国可转换债券投资基金、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		
李晓铭	本基金基金经理兼	2014-04-15	—	11年	硕士，曾任华富基金管理有限公司行业研究员，2006年4月至

	任权益研究部总经理、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金			2009年10月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，富国天博创新主题混合型证券投资基金基金经理助理，2009年10月至2014年10月任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理，2011年8月至2014年7月任富国低碳环保混合型证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国天益价值混合型证券投资基金基金经理，2015年2月起兼任富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；兼任权益研究部总经理。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益价值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》、《富国天益价值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、力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7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，中国宏观经济增速平稳下行，但不同行业景气度分化严重。本基金在过去一年中，主要以自下而上的个股选择作为主要的投资方式，主要选择方向是高景气行业中的龙头公司，传统行业中竞争力在不断增强未来有望获得更高市场地位的公司。面对众多转型公司，新兴领域的公司，本基金保持一贯的选股策略，在价值安全的基础上审慎选择。2015年A股市场波动较大，本基金持续保持较高仓位，没有获得波动收益。

#### **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1.5560元，份额累计净值为4.5673元。报告期内，本基金份额净值增长率为42.91%，同期业绩比较基准收益率为7.32%。

### **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，国内宏观经济面临较多不确定性，但对于中国经济整体增长前景，本基金保持高度乐观。在投资方面，汇率、供给侧改革成为新的投资维度，传统行业的脱胎换骨，新兴行业的蓬勃发展会提供更多的投资选择。同时资本的流动、资金的风险偏好会增加市场的波动性。

2016年本基金将坚持自下而上的策略，对上市公司的整体质量、安全边际有更高的要求。本基金将继续重点投资竞争力强大，增长与估值相匹配的优质公

司。

#### **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 2016 年 1 月 28 日公告每 10 份基金份额派发红利 1.10 元，共计派发红利 256464548.01 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**

2015 年度，基金托管人在富国天益价值混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### **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**

2015 年度，富国基金管理有限公司在富国天益价值混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配。

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### **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**

2015 年度，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国天益价值混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：富国天益价值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	146,403,981.07	8,110,733.56
结算备付金	252,817,661.09	272,557,826.04
存出保证金	2,038,582.70	2,498,782.16
交易性金融资产	3,217,713,994.87	5,540,128,523.43
其中：股票投资	3,167,498,994.87	5,262,836,016.23
基金投资	—	—
债券投资	50,215,000.00	277,292,507.20
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	78,124,775.50	—
应收利息	2,172,580.62	6,709,246.28
应收股利	—	—
应收申购款	350,462.93	1,546,717.84
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	3,699,622,038.78	5,831,551,829.31
<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	55,374,117.80	—
应付赎回款	5,385,077.18	29,956,978.60
应付管理人报酬	4,542,650.08	7,880,101.29

应付托管费	757,108.36	1,313,350.20
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	4,724,237.48	9,957,605.31
应交税费	776,180.80	776,180.80
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	125,824.03	438,386.34
负债合计	71,685,195.73	50,322,602.54
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,331,587,382.36	5,309,626,957.43
未分配利润	1,296,349,460.69	471,602,269.34
所有者权益合计	3,627,936,843.05	5,781,229,226.77
负债和所有者权益总计	3,699,622,038.78	5,831,551,829.31

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5560 元，基金份额总额 2,331,587,382.36 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天益价值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>	<b>2,593,531,731.50</b>	<b>1,352,492,261.10</b>
1. 利息收入	10,675,289.21	11,477,627.55
其中：存款利息收入	4,499,276.73	4,859,464.72
债券利息收入	6,176,012.48	6,433,455.31
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	184,707.52
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,068,773,497.48	1,008,160,248.42
其中：股票投资收益	3,014,557,634.14	938,241,982.10
基金投资收益	—	—
债券投资收益	10,009,241.65	-6,374,227.11
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	44,206,621.69	76,292,493.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-486,647,564.62	332,394,083.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	730,509.43	460,301.65
<b>减：二、费用</b>	133,826,824.00	156,993,529.49
1. 管理人报酬	72,073,965.25	93,069,073.11
2. 托管费	12,012,327.62	15,511,512.20
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	49,247,166.79	47,995,628.26
5. 利息支出	69,178.42	—
其中：卖出回购金融资产支出	69,178.42	—
6. 其他费用	424,185.92	417,315.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	2,459,704,907.50	1,195,498,731.61
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	2,459,704,907.50	1,195,498,731.61

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天益价值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）	5,309,626,957.43	471,602,269.34	5,781,229,226.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	2,459,704,907.50	2,459,704,907.50
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）	-2,978,039,575.07	-1,634,957,716.15	-4,612,997,291.22
其中：1. 基金申购款	734,753,639.05	374,276,829.70	1,109,030,468.75
2. 基金赎回款	-3,712,793,214.12	-2,009,234,545.85	-5,722,027,759.97
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）	2,331,587,382.36	1,296,349,460.69	3,627,936,843.05
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）	7,569,600,784.67	-750,682,527.75	6,818,918,256.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,195,498,731.61	1,195,498,731.61
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）	-2,259,973,827.24	26,786,065.48	-2,233,187,761.76

填列)			
其中：1. 基金申购款	617,507,341.28	-16,393,169.50	601,114,171.78
2. 基金赎回款	-2,877,481,168.52	43,179,234.98	-2,834,301,933.54
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)	5,309,626,957.43	471,602,269.34	5,781,229,226.77

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、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
交通银行股份有限公司	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	1,484,680,229.80	4.77	2,887,472,564.32	9.32
申万宏源	4,071,898,337.20	13.09	—	—
申银万国	—	—	8,754,000,609.61	28.26

###### 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

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

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(%)
海通证券	—	—	160,000,000.00	100.00

###### 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	1,351,648.01	4.82	0.00	0.00
申万宏源	3,616,684.91	12.89	131,594.71	2.79
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	2,628,751.65	9.45	899,463.08	9.03
申银万国	7,761,145.20	27.91	3,196,523.40	32.10

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	72,073,965.25	93,069,073.11
其中：支付销售机构的客户维护费	14,626,695.89	20,809,497.55

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	12,012,327.62	15,511,512.20

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

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

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
交通银行股份有限公司	146,403,981.07	271,099.81	8,110,733.56	270,208.28



注：本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额 2015 年末为 252,817,661.09 元，2014 年末为 272,557,826.04 元。

#### 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
002053	云南盐化	2015-11-19	重大事项停牌	25.84	2016-03-14	23.26	600,000	11,967,361.20	15,504,000.00	—

#### 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 3,151,994,994.87 元，属于第二层次的余额为人民币 65,719,000.00 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次的余额为人民币 4,877,581,299.48 元，属于第二层次的

余额为人民币 662,547,223.95 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	3,167,498,994.87	85.62
	其中：股票	3,167,498,994.87	85.62
2	固定收益投资	50,215,000.00	1.36
	其中：债券	50,215,000.00	1.36
	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	399,221,642.16	10.79
7	其他各项资产	82,686,401.75	2.23
8	合计	3,699,622,038.78	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	24,365,880.00	0.67
B	采矿业	154,316,463.00	4.25
C	制造业	1,714,878,857.74	47.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,890,000.00	1.04
E	建筑业	68,796,000.00	1.90
F	批发和零售业	76,922,133.30	2.12
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	452,473,749.08	12.47
J	金融业	191,322,795.00	5.27
K	房地产业	248,955,782.00	6.86
L	租赁和商务服务业	150,806,718.90	4.16
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	5,280,000.00	0.15
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	41,490,615.85	1.14
S	综合	—	—
	合计	3,167,498,994.87	87.31

## 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	002153	石基信息	2,268,007	342,469,057.00	9.44
2	002215	诺普信	11,718,786	224,766,315.48	6.20
3	600547	山东黄金	7,348,403	154,316,463.00	4.25
4	601688	华泰证券	6,800,000	134,096,000.00	3.70
5	002366	台海核电	2,000,000	131,900,000.00	3.64
6	601888	中国国旅	1,995,190	118,334,718.90	3.26
7	600745	中茵股份	2,600,000	106,548,000.00	2.94
8	600519	贵州茅台	474,399	103,509,117.81	2.85
9	600208	新湖中宝	20,000,000	95,400,000.00	2.63
10	600309	万华化学	5,327,302	95,092,340.70	2.62

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	600309	万华化学	643,663,873.21	11.13
2	601166	兴业银行	524,740,105.20	9.08
3	601933	永辉超市	394,599,615.60	6.83
4	600547	山东黄金	316,430,875.50	5.47
5	601318	中国平安	265,112,191.94	4.59
6	600048	保利地产	250,973,429.48	4.34
7	600219	南山铝业	243,485,975.15	4.21
8	300156	神雾环保	242,091,961.70	4.19
9	002304	洋河股份	228,711,325.92	3.96
10	002153	石基信息	202,171,055.11	3.50
11	600061	国投安信	192,386,097.62	3.33
12	002048	宁波华翔	191,975,960.29	3.32
13	600887	伊利股份	182,128,124.43	3.15
14	601688	华泰证券	168,947,684.90	2.92
15	300147	香雪制药	166,764,812.07	2.88
16	002221	东华能源	166,159,158.69	2.87
17	002450	康得新	165,256,116.49	2.86
18	600663	陆家嘴	163,674,446.39	2.83
19	000090	天健集团	161,398,567.81	2.79
20	600999	招商证券	155,776,933.72	2.69
21	000625	长安汽车	147,201,495.32	2.55
22	600060	海信电器	145,679,586.77	2.52
23	000712	锦龙股份	144,945,506.41	2.51
24	002366	台海核电	142,499,176.13	2.46
25	002310	东方园林	141,220,258.00	2.44
26	000423	东阿阿胶	141,067,639.87	2.44
27	300016	北陆药业	129,137,221.59	2.23
28	600745	中茵股份	128,569,977.20	2.22
29	300204	舒泰神	127,454,645.62	2.20

### 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	600309	万华化学	909,471,161.64	15.73
2	002153	石基信息	849,236,223.61	14.69
3	601166	兴业银行	503,982,031.30	8.72
4	002221	东华能源	446,769,001.81	7.73

5	000712	锦龙股份	400,485,751.48	6.93
6	600208	新湖中宝	390,775,845.22	6.76
7	002024	苏宁云商	375,892,943.47	6.50
8	601933	永辉超市	351,611,982.28	6.08
9	000671	阳光城	337,253,670.81	5.83
10	000800	一汽轿车	320,446,538.59	5.54
11	300156	神雾环保	298,032,326.51	5.16
12	002466	天齐锂业	288,273,021.64	4.99
13	000581	威孚高科	284,882,641.04	4.93
14	002450	康得新	280,425,413.11	4.85
15	601318	中国平安	278,196,558.53	4.81
16	600048	保利地产	270,234,353.69	4.67
17	600219	南山铝业	261,076,775.01	4.52
18	300257	开山股份	259,357,457.38	4.49
19	002048	宁波华翔	246,014,652.91	4.26
20	000501	鄂武商A	244,705,332.46	4.23
21	600858	银座股份	225,282,959.13	3.90
22	300253	卫宁软件	224,488,458.23	3.88
23	000090	天健集团	219,704,688.45	3.80
24	300147	香雪制药	207,995,548.14	3.60
25	600061	国投安信	202,527,816.58	3.50
26	600694	大商股份	202,235,788.40	3.50
27	600887	伊利股份	200,876,309.92	3.47
28	002304	洋河股份	198,157,995.45	3.43
29	600547	山东黄金	169,545,818.92	2.93
30	002293	罗莱生活	154,693,048.37	2.68
31	002366	台海核电	153,871,526.15	2.66
32	600999	招商证券	151,738,009.95	2.62
33	000625	长安汽车	149,131,609.56	2.58
34	000423	东阿阿胶	146,452,287.00	2.53
35	600663	陆家嘴	144,146,912.59	2.49
36	600703	三安光电	142,715,244.59	2.47
37	300058	蓝色光标	140,208,394.59	2.43
38	300347	泰格医药	128,684,868.13	2.23
39	002223	鱼跃医疗	125,267,581.32	2.17
40	002009	天奇股份	123,454,504.44	2.14
41	002318	久立特材	122,290,879.07	2.12
42	603766	隆鑫通用	120,034,311.38	2.08
43	601233	桐昆股份	119,298,680.18	2.06
44	002085	万丰奥威	118,484,472.70	2.05

### 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	13,248,775,608.28
卖出股票收入（成交）总额	17,880,172,436.51

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	50,215,000.00	1.38
	其中：政策性金融债	50,215,000.00	1.38
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	50,215,000.00	1.38

### 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	140206	14 国开 06	500,000	50,215,000.00	1.38

### 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“华泰证券”的发行主体华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”）于2015年9月10日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字【2015】72号），因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，中国证监会拟决定对公司责令改正，给予警告，没收违法所得18,235,275.00元，并处以54,705,825.00元罚款。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的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。

#### 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	2,038,582.70
2	应收证券清算款	78,124,775.50
3	应收股利	—

4	应收利息	2,172,580.62
5	应收申购款	350,462.93
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	82,686,401.75

#### 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

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。

#### 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(%)
121,485	19,192.39	102,825,677.62	4.41	2,228,761,704.74	95.59

### 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	261,559.14	0.0112

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；  
2、本基金基金经理未持有本基金。

### 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(2004年06月15日)基金份额总额	1,033,718,023.69
报告期期初基金份额总额	5,309,626,957.43
本报告期基金总申购份额	734,753,639.05
减：本报告期基金总赎回份额	3,712,793,214.12
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,331,587,382.36

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 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	1	4,925,038,706.76	15.83	—	—	—	—	—	—	4,484,654.66	15.99	—
东方证券	1	175,130,053.37	0.56	—	—	—	—	—	—	159,439.70	0.57	—
方正证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
高华证券	1	1,025,520,138.62	3.30	—	—	—	—	—	—	933,784.94	3.33	—
光大证券	1	3,001,372,197.40	9.65	29,470,508.00	100.00	—	—	—	—	2,766,202.84	9.86	—
广发华福	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	1,484,680,229.80	4.77	—	—	—	—	—	—	1,351,648.01	4.82	—
恒泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	2,647,613,148.28	8.51	—	—	—	—	—	—	2,373,992.46	8.46	—
申万宏源	2	4,071,898,337.20	13.09	—	—	—	—	—	—	3,616,684.91	12.89	—
西南证券	2	2,984,527,071.76	9.59	—	—	—	—	—	—	2,726,240.92	9.72	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
银河证券	1	593,819,938.31	1.91	—	—	—	—	—	—	542,727.28	1.93	—
中金公司	1	10,207,481,120.88	32.80	—	—	—	—	—	—	9,094,317.54	32.42	—

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、根据自 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人决定自 2015 年 7 月 30 日起将基金类型变更为混合型基金并修改基金合同部分条款。本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形，无需召开基金份额持有人大会。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

2、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，并报中国证监会备案，决定自 2015 年 10 月 1 日起，变更富国天益价值混合型证券投资基金的业绩比较基准并修改基金合同相应条款。上述变更事项对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。