富国产业债债券型证券投资基金

2015 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: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

基金简称	富国产业债券
基金主代码	100058
交易代码	前端交易代码:100058 后端交易代码:100059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月05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	2,306,351,028.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟炜	洪澜
	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	275,138,777.00	240,305,346.81	325,973,693.19
本期利润	242,050,259.58	562,073,626.04	39,384,502.84
加权平均基金份额本期利润	0.0983	0.1398	0.0075
本期基金份额净值增长率	9.35%	15.05%	0.90%
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	0.0286	0.0276	-0.0060
期末基金资产净值	2,452,113,037.36	2,981,930,573.59	4,593,425,403.45
期末基金份额净值	1.063	1.076	0.994

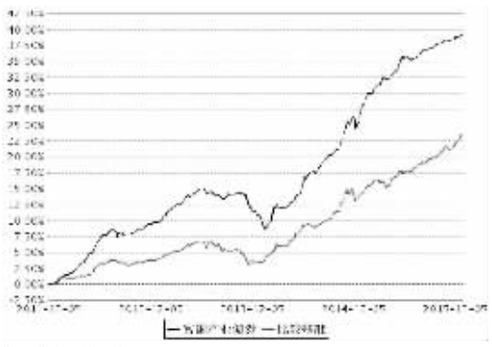
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

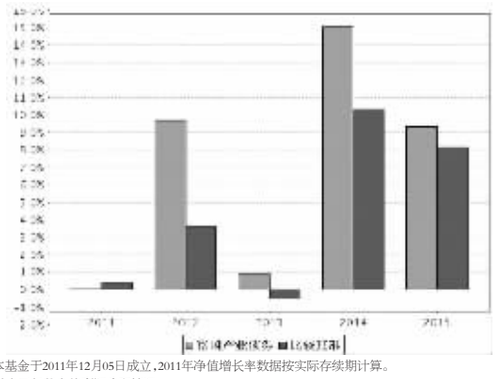
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.24%	0.05%	2.73%	0.08%	-1.49%	-0.03%
过去六个月	2.95%	0.06%	4.90%	0.07%	-1.95%	-0.01%
过去一年	9.35%	0.09%	8.15%	0.08%	1.20%	0.01%
过去三年	26.94%	0.12%	18.78%	0.10%	8.16%	0.02%
自基金合同生效日起至今	39.36%	0.11%	23.54%	0.09%	15.82%	0.02%

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2011年12月5日成立。本基金建仓期6个月,即从2011年12月5日起至2012年6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 自基金合同生效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



注:本基金于2011年12月05日成立,2011年净值增长率数据按实际存续期计算。

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	1.100	262,664,912.33	9,219,787.92	271,884,700.25	3次分红
2014年	0.640	232,324,195.24	4,831,536.61	237,155,731.85	4次分红
2013年	0.740	298,111,597.00	79,263,713.95	377,375,310.95	4次分红
合计	2.480	793,100,704.57	93,315,038.48	886,415,743.05	-

§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		
张钧	本基金基金经理兼任固定收益投资副总监、富国优化增强债券型证券投资基金、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国信用增强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、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-07-29	-	7年	硕士,曾任华富基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、基金经理;自2014年3月至2014年7月在富国基金管理有限公司人力资源部工作,自2014年7月起任富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金基金经理,2014年10月起任富国国有企业债债券型证券投资基金和富国信用增强债券型证券投资基金基金经理,2014年11月起任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任固定收益投资副总监。具有基金从业资格。
饶刚	本基金前任基金经理	2014-06-20	2015-03-13	16年	硕士,曾任职兴业证券股份有限公司研究部职员、投资银行部职员;2003年7月任富国基金管理有限公司债券研究员,2006年1月至2015年3月任富国天利基金经理,2008年10月至2015年3月任富国天丰基金经理,2010年9月至2013年9月任富国汇利分级债券基金经理,2013年9月至2015年3月任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金基金经理,2014年3月至2015年3月任富国天盈分级债券型证券投资基金(2014年5月更名为富国天盈债券型证券投资基金(LOF))基金经理,2014年6月至2015年3月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理,兼任固定收益投资部总经理和富国资产管理(上海)有限公司总经理。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

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,债券市场延续牛市,货币政策持续宽松,作为低风险稳定收益的品种,债券在大类资产配置中获得青睐。全年信用利差整体压缩,信用事件局部有发生,低等级个券风险溢价提高。本基金专注产业债投资,2015年净值稳定增长,实现信用利差下行的收益。本基金持续调整券种结构,为下一个信用周期投资做准备。

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1.063元,份额累计净值为1.351元。报告期内,本基金份额净值增长率为9.35%,同期业绩比较基准收益率为8.15%。

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,供给侧改革起始,无风险利率仍有望持续保持低位,但不排除资金波动、信用事件冲击、机构配置行为变化等因素对债券市场带来负面影响。信用利差的回升,给本基金带来仓位配置的机会。本基金致力于中周期内寻找信用投资的超额收益机会,争取为基金持有人带来可持续的稳定投资回报。

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

本基金对2015年报告期内利润共进行四次收益分配。分别于2015年3月20日公告每10份基金份额派发红利0.40元;2015年6月24日公告每10份基金份额派发红利0.40元;2015年9月24日公告每10份基金份额派发红利0.30元,共计派发红利271884700.25元。2016年1月7日公告每10份基金份额派发红利0.18元;共计派发红利41521632.20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产业债债券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,富国产业债债券型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国产业债债券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,富国产业债债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了3次利润分配,分配金额为271,884,700.25元。
富国产业债券基金2014年7月投资了海宁市资产经营公司2014年中小企业可交换私募债券。由于该基金仅可投资于可交换债券,而该债券既属于可交换债券又属于中小企业私募债券,我们认为投资管理人的投资与基金合同约定的投资范围不完全符合。在本报告期内,我部向中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部就富国产业债券基金投资“14海宁债”的情况进行了报告。

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产业债债券型证券投资基金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:富国产业债债券型证券投资基金
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)
资 产:		
银行存款	39,440,369.21	37,132,950.55
结算备付金	723,773.10	177,700,498.53
存出保证金	67,092.93	311,842.73
交易性金融资产	2,159,942,735.02	3,775,180,200.37
其中:股票投资	8,407,823.32	-
基金投资	-	-
债券投资	2,078,126,226.77	3,669,772,857.91
资产支持证券投资	73,408,684.93	105,407,342.46
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	227,800,274.70	-
应收证券清算款	36,836,226.23	288,059,584.91
应收利息	33,202,783.24	74,681,000.86
应收股利	-	-
应收申购款	1,479,933.01	26,072.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	10,243,278.69	-
资产总计	2,509,736,466.13	4,353,092,150.02
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	-	1,027,699,502.10
应付证券清算款	55,219,671.80	-
应付赎回款	83,894.63	339,735,766.63
应付管理人报酬	1,246,086.42	1,855,623.43
应付托管费	415,362.13	618,541.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	71,370.19	363,724.78
应交税费	507,040.00	507,040.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	80,003.60	381,378.37
负债合计	57,623,428.77	1,371,161,576.43
所有者权益:		
实收基金	2,306,351,028.05	2,771,661,062.87
未分配利润	145,762,009.31	210,269,510.72
所有者权益合计	2,452,113,037.36	2,981,930,573.59
负债和所有者权益总计	2,509,736,466.13	4,353,092,150.02

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.063元,基金份额总额2,306,351,028.05份。

7.2 利润表
会计主体:富国产业债债券型证券投资基金
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)
一、收入	266,738,240.69	731,896,163.00
1.利息收入	135,070,144.98	387,680,218.07
其中:存款利息收入	1,137,113.83	3,604,886.47
债券利息收入	125,576,830.74	377,212,194.38
资产支持证券利息收入	6,594,805.48	6,746,897.53
买入返售金融资产收入	1,761,394.93	116,239.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	159,251,670.45	10,145,633.43
其中:股票投资收益	2,291,626.32	3,980,741.36
基金投资收益	-	-
债券投资收益	154,958,701.66	4,345,556.18
资产支持证券投资收益	2,001,342.47	1,819,335.89
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)	-33,088,517.42	321,768,279.23
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	5,504,942.68	12,302,032.27
减:二、费用	24,687,981.11	169,822,536.96
1.管理人报酬	15,966,388.51	24,860,555.88
2.托管费	5,322,129.47	8,286,852.00
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	485,838.15	1,135,242.46
5.利息支出	2,471,881.98	135,114,978.62
其中:卖出回购金融资产支出	2,471,881.98	135,114,978.62
6.其他费用	441,743.00	424,908.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	242,050,259.58	562,073,626.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	242,050,259.58	562,073,626.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富国产业债债券型证券投资基金
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日

单位:人民币元

	本期末 (2015年01月01日至2015年12月31日)		
项目	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)	2,771,661,062.87	210,269,510.72	2,981,930,573.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	242,050,259.58	242,050,259.58
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)	-465,310,034.82	-34,673,060.74	-499,983,095.56
其中:1.基金申购款	527,024,979.69	38,920,639.65	565,945,619.34
2.基金赎回款	-992,335,014.51	-73,593,700.39	-1,065,928,714.90
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)	-	-271,884,700.25	-271,884,700.25
五、期末所有者权益(基金净值)	2,306,351,028.05	145,762,009.31	2,452,113,037.36
	上年度可比期间 (2014年01月01日至2014年12月31日)		
项目	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)	4,621,003,872.20	-27,578,468.75	4,593,425,403.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	562,073,626.04	562,073,626.04
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)	-1,849,342,809.33	-87,069,914.72	-1,936,412,724.05
其中:1.基金申购款	192,756,343.90	12,898,645.00	205,654,988.90
2.基金赎回款	-2,042,099,153.23	-99,968,559.72	-2,142,067,712.95
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)	-	-237,155,731.85	-237,155,731.85
五、期末所有者权益(基金净值)	2,771,661,062.87	210,269,510.72	2,981,930,573.59

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
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	8,371,293.00	22.40	-	-
申万宏源	29,003,779.14	77.60	-	-
申银万国	-	-	46,060,892.06	100.00

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	1,990,563,865.47	53.02	3,420,421,948.51	34.02
申万宏源	1,764,122,135.89	46.98	-	-
申银万国	-	-	6,634,338,911.00	65.98

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	13,010,412,000.00	81.34	150,768,411,000.00	41.22
申万宏源	2,984,771,000.00	18.66	-	-
申银万国	-	-	214,995,694,000.00	58.78

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	193,987.94	51.11	19,788.50	33.70
申万宏源	185,532.34	48.89	38,924.88	66.30
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	336,876.64	34.83	110,756.27	31.94
申银万国	630,343.07	65.17	236,033.41	68.06

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	15,966,388.51	24,860,555.88
其中:支付销售机构的客户维护费	458,915.70	727,010.94

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.60%/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
基金管理费每日计提,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	5,322,129.47	8,286,852.00

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/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

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

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01月01日至2014年12月31日)
基金合同生效日(2011年12月05日)持有的基金份额	25,000,500.02	25,000,500.02
期初持有的基金份额	25,000,500.02	25,000,500.02
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	25,000,500.02	-
期末持有的基金份额	-	25,000,500.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.90%

注:本基金管理人认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。

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
中国工商银行股份有限公司	39,440,369.21	756,193.67	37,132,950.55	678,068.93

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

7.4.5.1.1 受限证券类别:债券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	认购新发证券	100.00	100.00	6,520	652,000.00	652,000.00	

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

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8,407,823.32元,属于第二层次的余额为人民币2,151,534,911.70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1,462,197,581.41元,属于第二层次的余额为人民币2,312,982,618.96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