

富国天盈债券型证券投资基金（LOF）

二〇一六年年度报告

（摘要）

2016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：2017年03月27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 2017 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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	富国天盈
基金简称	富国天盈债券（LOF）
基金主代码	161015
交易代码	161015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年05月23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	216,514,673.26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	2011年7月8日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在追求基金资产长期安全的基础上，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	中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，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	范伟隽	郭明
	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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,036,249.40	82,148,524.82	188,100,348.19
本期利润	9,791,156.51	82,391,800.77	279,646,671.37
加权平均基金份额本期利润	0.0259	0.0669	0.1160
本期基金份额净值增长率	2.82%	9.11%	17.02%
3.1.2 期末数据和指标	2016年12月31日	2015年12月31日	2014年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.1138	0.0890	0.0155
期末基金资产净值	197,218,378.41	504,805,295.45	911,714,829.46
期末基金份额净值	0.911	0.886	0.812

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。

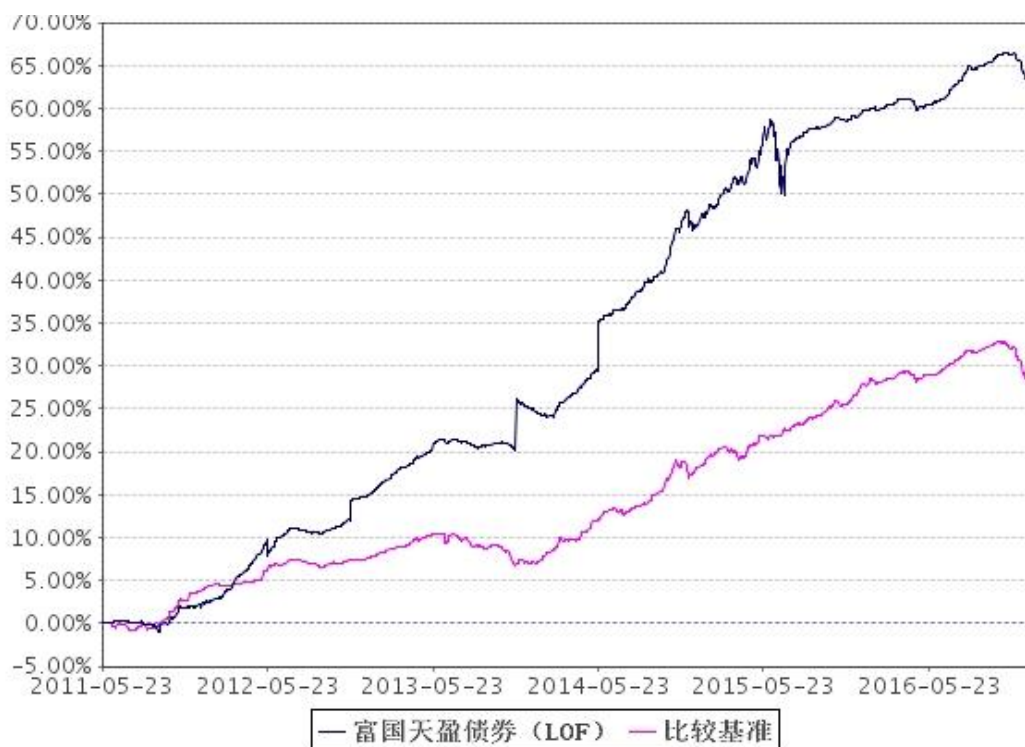
### 3.2 基金净值表现

#### 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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	-----------	-----------	--------------	-----	-----

		差②	③	④		
过去三个月	-0.65%	0.10%	-1.48%	0.15%	0.83%	-0.05%
过去六个月	1.79%	0.09%	0.27%	0.11%	1.52%	-0.02%
过去一年	2.82%	0.08%	1.85%	0.09%	0.97%	-0.01%
过去三年	31.29%	0.27%	21.54%	0.10%	9.75%	0.17%
过去五年	60.17%	0.27%	25.33%	0.09%	34.84%	0.18%
自基金合同生效日起至今	64.20%	0.26%	30.20%	0.09%	34.00%	0.17%

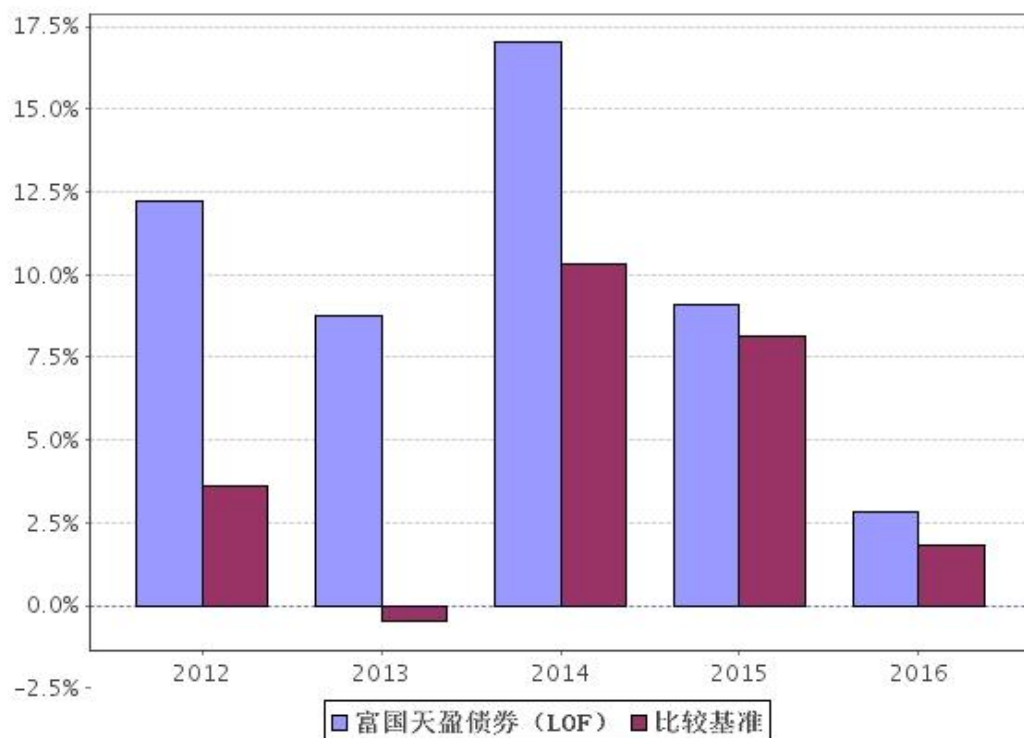
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2016年12月31日。

2、本基金于2011年5月23日成立，建仓期6个月，从2011年5月23日起至2011年11月22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
2016年	—	—	—	—	—
2015年	—	—	—	—	—
2014年	2.640	776,170,182.00	22,378,494.61	798,548,676.61	2次分红。本期本基金利润分配总金额为798,548,676.61，其中16,205,847.21为转型前2014年5余额22日天盈A根据基金合同进行份额折算。
合计	2.640	776,170,182.00	22,378,494.61	798,548,676.61	—

## § 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 2016 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、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、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金等七十八只证券投资基金。

#### 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		
张钊	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、富国产业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、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理	2014-07-29	—	8	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月起在富国基金管理有限公司固定收益投资部工作，并自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，自2014年10月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理，自2014年10月至2016年4月任富国稳健增强债券型证券投资基金基金经理，自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，自2016年12月起任富国两年期理财债券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。
李羿	本基金基金经理	2016-11-04	—	3	硕士，2009年4月至2010年6月任上海浦东发展银行交易员；2010年6月至2013年7月任交银康联人寿保险有限公司高级投资经理；2013年7月至2016年6月任汇丰晋信基金管理有限公司投



					资经理、基金经理；2016年6月起加入富国基金管理有限公司，自2016年11月起任富国天盈债券型证券投资基金（LOF）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。  
3、基金管理人已于2017年1月25日分别在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站发布公告，张钊先生自2017年1月23日起不再担任本基金基金经理。

## 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盈债券型证券投资基金（LOF）的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天盈债券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，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，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**

2016年，债券市场经历了起伏震荡行情，年初延续了2015年的火爆行情；二季度后随后因为营改增、个别信用风险事件等原因债市开始调整；进入三季度，在英国脱欧事件和充裕配置资金的推动下走出了一波强势牛市行情；四季度后，海外强美元因素逐渐影响加剧，处于对汇率压力和控杠杆风险的考量，央行拉长了资金投放期限，提升了短端资金成本，货币政策逐渐回归中性，债券市场出现剧烈调整。全年信用利差走阔，局部信用风险继续暴露，中债全价指数全年下跌0.39%。本基金在力控风险前提下，审慎操作，全年为投资者获取了一定的超额回报。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2016年12月31日，本基金份额净值为0.911元；份额累计净值为1.545元；本报告期，本基金份额净值增长率为2.82%，同期业绩比较基准收益率为1.85%

### **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2017年，由于央行再次提出了“流动性总闸门”概念，表明货币政策已回归中性，预计全年利率中枢将高于2016年。但实体经济复苏依然脆弱，实际利率大幅上升的可能性不大。期间也仍将出现除资金波动、信用事件冲击、机构配置行为变化等因素对债券市场带来的影响。利率中枢上行或带来配置性机会，适合对下一轮利率行情进行布局。本基金力争在控制风险的前提下，争取为基金持有人带来可持续的投资回报。

### **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**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **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**

本报告期内，本基金托管人在对富国天盈债券型证券投资基金（LOF）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，富国天盈债券型证券投资基金（LOF）的管理人——富国基金管理有限公司在富国天盈债券型证券投资基金（LOF）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，富国天盈债券型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

#### **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**

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盈债券型证券投资基金（LOF）2016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。

### **§ 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：富国天盈债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2016年12月31日)	上年度末 (2015年12月31日)
<b>资产：</b>		
银行存款	16,288,752.59	21,938,601.88
结算备付金	877,408.00	5,663,359.05
存出保证金	18,630.99	264,232.24
交易性金融资产	184,422,944.56	484,723,109.66
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	184,422,944.56	484,723,109.66
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	198,107.78	—
应收利息	4,187,491.38	10,107,761.79
应收股利	—	—
应收申购款	94,505.63	117,865.09
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	206,087,840.93	522,814,929.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>(2016年12月31日)</b>	<b>上年度末</b> <b>(2015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	1,000,000.00	9,000,000.00
应付证券清算款	6,080,392.09	6,002,994.70
应付赎回款	270,858.86	1,237,076.12
应付管理人报酬	124,242.04	315,994.35
应付托管费	35,497.73	90,284.11
应付销售服务费	62,121.02	157,997.19
应付交易费用	1,200.00	5,050.00
应交税费	1,135,067.16	1,135,067.16

应付利息	77.78	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	160,005.84	65,170.63
负债合计	8,869,462.52	18,009,634.26
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	172,582,003.13	454,117,731.50
未分配利润	24,636,375.28	50,687,563.95
所有者权益合计	197,218,378.41	504,805,295.45
负债和所有者权益总计	206,087,840.93	522,814,929.71

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.911 元，基金份额总额 216,514,673.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天盈债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	14,652,637.89	99,963,497.04
1. 利息收入	17,226,445.13	59,524,062.73
其中：存款利息收入	83,541.44	710,203.37
债券利息收入	17,018,838.54	58,601,877.39
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	124,065.15	211,981.97
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,655,698.65	40,054,539.97
其中：股票投资收益	—	10,222,521.37
基金投资收益	—	—
债券投资收益	2,655,698.65	28,752,399.77
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	—	1,079,618.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,245,092.89	243,275.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	15,587.00	141,618.39
<b>减：二、费用</b>	4,861,481.38	17,571,696.27
1. 管理人报酬	2,392,728.79	7,427,410.14
2. 托管费	683,636.76	2,122,117.24

3. 销售服务费	1,196,364.35	3,713,705.03
4. 交易费用	8,614.40	1,232,688.72
5. 利息支出	121,377.08	2,607,027.14
其中：卖出回购金融资产支出	121,377.08	2,607,027.14
6. 其他费用	458,760.00	468,748.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>9,791,156.51</b>	<b>82,391,800.77</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>9,791,156.51</b>	<b>82,391,800.77</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天盈债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2016年01月01日至2016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）	454,117,731.50	50,687,563.95	504,805,295.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	9,791,156.51	9,791,156.51
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）	-281,535,728.37	-35,842,345.18	-317,378,073.55
其中：1. 基金申购款	100,321,855.45	12,633,280.35	112,955,135.80
2. 基金赎回款	-381,857,583.82	-48,475,625.53	-430,333,209.35
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）	172,582,003.13	24,636,375.28	197,218,378.41
项目	上年度可比期间 (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）	894,364,793.78	17,350,035.68	911,714,829.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	82,391,800.77	82,391,800.77
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）	-440,247,062.28	-49,054,272.50	-489,301,334.78
其中：1. 基金申购款	1,771,928,366.12	110,706,626.79	1,882,634,992.91
2. 基金赎回款	-2,212,175,428.40	-159,760,899.29	-2,371,936,327.69

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）	454, 117, 731. 50	50, 687, 563. 95	504, 805, 295. 45

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	徐慧
—————	—————	—————
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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：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(2016年01月01日至2016年12月31日)		上年度可比期间(2015年01月01日至2015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	—	—	80, 325, 071. 24	13. 50

申万宏源	—	—	5,727,404.92	0.96
------	---	---	--------------	------

#### 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（2016年01月01日至2016年12月31日）		上年度可比期间（2015年01月01日至2015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	69,375,804.46	11.96	1,012,859,722.74	34.16
申万宏源	43,966,823.24	7.58	247,870,109.44	8.36

#### 7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2016年01月01日至2016年12月31日）		上年度可比期间（2015年01月01日至2015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	200,400,000.00	9.00	2,570,000,000.00	13.57
申万宏源	128,000,000.00	5.75	2,035,600,000.00	10.75

#### 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	上年度可比期间（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（%）
申万宏源	5,214.37	0.97	0.00	0.00
海通证券	72,699.05	13.51	0.00	0.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方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（2016年01月01日至2016年12月31日）	上年度可比期间（2015年01月01日至2015年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,392,728.79	7,427,410.14
其中：支付销售机构的客户维护费	520,518.65	812,905.99



注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

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(2016年01月01日至 2016年12月31日)	上年度可比期间(2015年01 月01日至2015年12月31日)
当期发生的基金应支付的 托管费	683,636.76	2,122,117.24

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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期(2016年01月01日至2016年12月31日)	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	合计	
富国基金管理有限公司	608,690.94	
申万宏源	975.07	
海通证券	7,294.84	
工商银行	222,184.39	
合计	839,145.24	

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间(2015年01月01日至2015年12月31日)	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	合计	
富国基金管理有限公司	2,706,513.97	
申万宏源	43,926.37	
海通证券	13,832.92	
工商银行	320,970.91	
合计	3,085,244.17	

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。

基金销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人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（2016年01月01日至2016年12月31日）		上年度可比期间（2015年01月01日至2015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	16,288,752.59	64,648.08	21,938,601.88	399,448.00

#### 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（2016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

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2016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 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2017 年 2 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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 2016 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 4,462,200.00 元，属于第二层次的余额为人民币 179,960,744.56 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（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 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 484,723,109.66 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可转换债券，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可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	184,422,944.56	89.49
	其中：债券	184,422,944.56	89.49
	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	17,166,160.59	8.33
7	其他各项资产	4,498,735.78	2.18
8	合计	206,087,840.93	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

### 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

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期没有买入或卖出股票。

## 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	14,277,045.00	7.24
2	央行票据	—	—
3	金融债券	19,970,000.00	10.13
	其中：政策性金融债	19,970,000.00	10.13
4	企业债券	141,612,030.00	71.81
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	8,563,869.56	4.34
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	184,422,944.56	93.51

## 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	160414	16 农发 14	200,000	19,970,000.00	10.13
2	124288	13 光谷联	130,000	13,725,400.00	6.96
3	010107	21 国债(7)	125,790	13,239,397.50	6.71
4	124376	13 渝物流	140,000	11,726,400.00	5.95
5	124235	13 清河投	139,880	11,577,867.60	5.87

## 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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

本基金本报告期末未持有前十名股票超出基金合同规定的备选股票库

### 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	18,630.99
2	应收证券清算款	198,107.78
3	应收股利	—
4	应收利息	4,187,491.38
5	应收申购款	94,505.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,498,735.78

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132004	15 国盛 EB	1,979,200.00	1.00
2	110035	白云转债	1,245,600.00	0.63
3	110033	国贸转债	1,031,400.00	0.52
4	132003	15 清控 EB	984,960.00	0.50
5	128009	歌尔转债	907,200.00	0.46
6	128010	顺昌转债	592,650.00	0.30
7	110032	三一转债	552,600.00	0.28
8	128011	汽模转债	115,677.00	0.06

9	110034	九州转债	17,073.00	0.01
---	--------	------	-----------	------

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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(%)
5,468	39,596.68	58,388,638.32	26.97	158,126,034.94	73.03

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	国元证券-农行-国元黄山1号限定性集合资产管理计划	8,435,957	34.03
2	山西焦煤集团有限责任公司企业年金计划-中国工商银行股份有限	7,099,178	28.63
3	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公	2,672,720	10.78
4	黄慧芹	1,000,000	4.03
5	成都农村商业银行股份有限公司企业年金计划-中国民生银行股份	691,892	2.79
6	原荣祥	553,131	2.23
7	李惠玲	430,000	1.73
8	陈希苓	337,820	1.36
9	李东方	297,281	1.20
10	孙正荣	232,997	0.94

### 9.3 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	114,691.88	0.0530
-------------------	------------	--------

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、本基金的基金经理未持有本基金。

#### 9.4 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(2011年05月23日)基金份额总额	3,504,716,032.32
报告期期初基金份额总额	569,688,421.41
本报告期基金总申购份额	125,865,893.37
减：本报告期基金总赎回份额	479,039,641.52
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	216,514,673.26

## § 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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

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。

### 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 6 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 14 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**

2016 年 6 月，针对上海证监局向公司出具的《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。2016 年 10 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

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	2	—	—	3,131,389.77	0.54	76,700,000.00	3.45	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	39,633,384.48	6.83	315,500,000.00	14.17	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	22,074,310.84	3.81	87,000,000.00	3.91	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	84,357,555.41	14.54	84,500,000.00	3.80	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	42,280,361.79	7.29	176,200,000.00	7.92	—	—	—	—	—
国开证券	1	—	—	8,659,444.92	1.49	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	41,536,411.45	7.16	103,800,000.00	4.66	—	—	—	—	—
海通证券	2	—	—	69,375,804.46	11.96	200,400,000.00	9.00	—	—	—	—	—
华创证券	2	—	—	67,122,595.96	11.57	207,600,000.00	9.33	—	—	—	—	—
华金证券	2	—	—	5,392,444.98	0.93	47,000,000.00	2.11	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	5,415,467.10	0.93	105,000,000.00	4.72	—	—	—	—	—
民生证券	2	—	—	2,413,649.55	0.42	47,900,000.00	2.15	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	3	—	—	43,966,823.24	7.58	128,000,000.00	5.75	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	13,108,096.31	2.26	26,000,000.00	1.17	—	—	—	—	—

西南证券	2	—	—	—	—	14,000,000.00	0.63	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	11,609,954.60	2.00	63,000,000.00	2.83	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	24,270,376.11	4.18	22,000,000.00	0.99	—	—	—	—	—
英大证券	2	—	—	18,404,395.61	3.17	30,000,000.00	1.35	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	21,837,993.20	3.76	138,600,000.00	6.23	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	19,630,002.66	3.38	76,000,000.00	3.41	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	18,595,575.13	3.21	17,300,000.00	0.78	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	17,322,673.23	2.99	259,500,000.00	11.66	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金新增券商交易单元：瑞银证券 001317；天风证券 35910；天风证券 397998；英大证券 014300；英大证券 32932；中信建投 001976；中信建投 36900；中泰证券 37864；中泰证券 003236；西南证券 61042；西南证券 397083。其余租用券商交易单元未发生变动。

