富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

二 0 一五年年度报告

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： 中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....9
§4 管理人报告.....9
4.1 基金管理人及基金经理.....9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....13
4.9 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.....13
§5 托管人报告.....13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....13
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 14
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.....14
§6 审计报告.....14
6.1 审计报告基本信息.....14
6.2 审计报告的基本内容.....14
§7 年度财务报表.....15
7.1 资产负债表.....15
7.2 利润表.....17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....18
7.4 报表附注.....19
§8 投资组合报告.....39
8.1 期末基金资产组合情况.....39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....39
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....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 51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .51
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 .51
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 51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
8.12 投资组合报告附注 52
§9 基金份额持有人信息 53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
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 53
§10 开放式基金份额变动 54
§11 重大事件揭示 54
11.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
11.4 基金投资策略的改变 54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
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 54
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 56
11.8 其他重大事件 57
§12 影响投资者决策的其他重要信息 59
§13 备查文件目录 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金
基金简称	富国天源沪港深
基金主代码	100016
交易代码	前端交易代码：100016 后端交易代码：100017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 08 月 16 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	640,988,498.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	本基金采用“证券市场平均收益率”作为衡量本基金操作水平的比较基准。 证券市场平均收益率=沪深 300 指数收益率×65%＋中债综合全价指数收益率×30%＋同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券和货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	林葛
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599

传真	021-20361616	010-68121816
注册地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	北京复兴门内大街 2 8 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	200120	100031
法定代表人	薛爱东	刘士余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	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

§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	468,829,787.86	193,054,986.78	148,397,076.97
本期利润	548,958,863.77	168,068,591.92	167,515,903.30
加权平均基金份额本期利润	0.8250	0.1626	0.1766
本期加权平均净值利润率	56.90%	15.28%	17.10%
本期基金份额净值增长率	73.14%	15.39%	20.17%
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
期末可供分配利润	484,677,624.98	141,230,360.72	102,599,243.34

期末可供分配基金份额利润	0.7561	0.1733	0.1030
期末基金资产净值	1,125,666,123.83	956,245,088.40	1,098,683,446.98
期末基金份额净值	1.7561	1.1733	1.1030
3.1.3 累计期末指标	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日	2013 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	531.79%	264.91%	216.24%

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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	44.57%	2.01%	11.25%	1.08%	33.32%	0.93%
过去六个月	4.91%	2.11%	-9.55%	1.70%	14.46%	0.41%
过去一年	73.14%	1.93%	7.40%	1.59%	65.74%	0.34%
过去三年	140.07%	1.36%	38.27%	1.14%	101.80%	0.22%
过去五年	111.57%	1.20%	23.29%	1.03%	88.28%	0.17%
自基金合同生效日起至今	531.79%	1.15%	148.92%	1.14%	382.87%	0.01%

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×65%＋中债综合全价指数收益率×30%＋同业存款利率×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（benchmarkt）按下列公式计算：

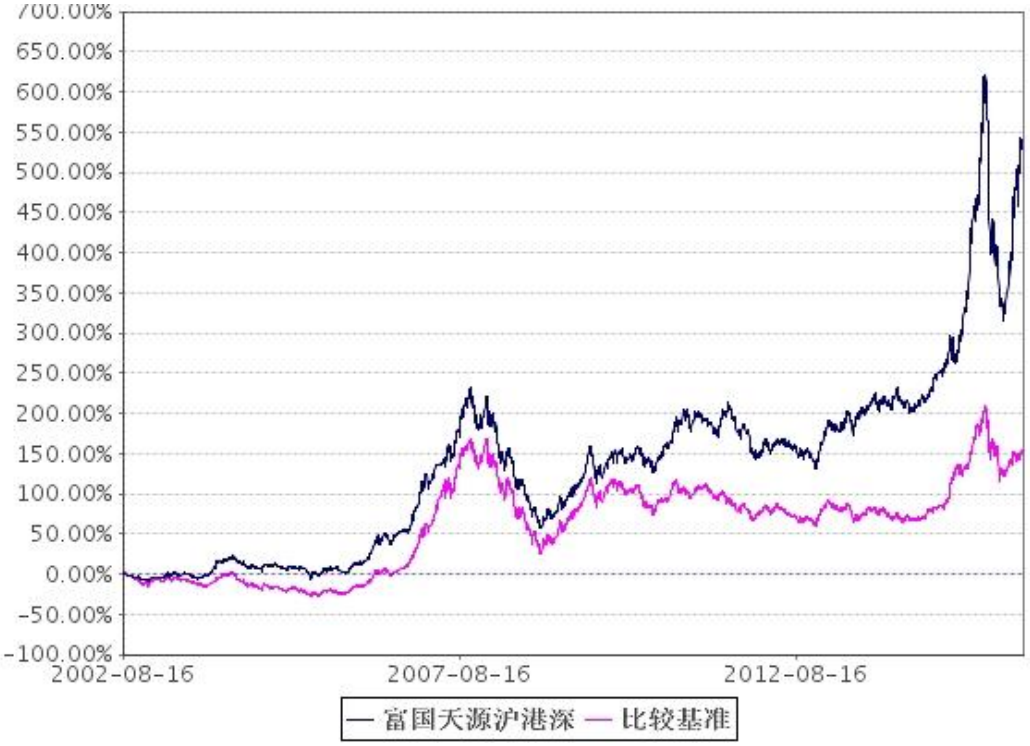
benchmarkt = 65% *[沪深 300 指数 t/(沪深 300 指数 t-1)-1] +30%* [中债综合全价指数 t/(中债综合全价指数 t-1)-1]+ 5% * 同业存款利率 / 360 ；

其中，t=1,2,3,…, T，T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

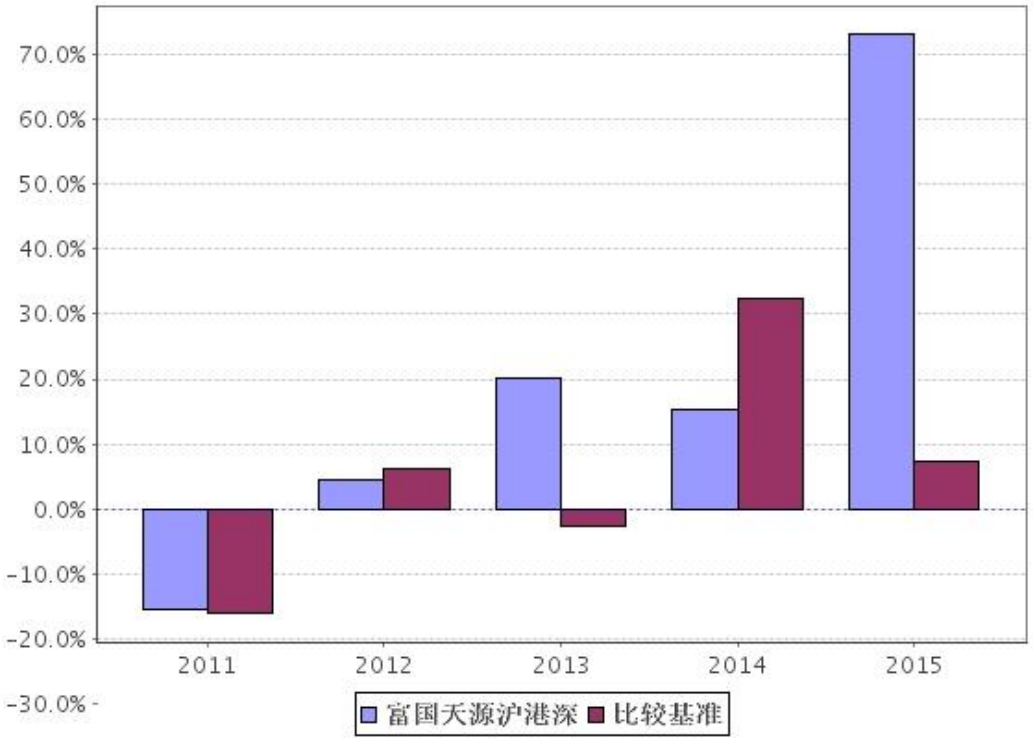
benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1
其中，T=2,3,4,…； ∏Tt=1(1+benchmarkt)表示 t 日至 T 日的(1+benchmarkt)数学连乘。

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 日止。
2、本基金于 2002 年 8 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2002 年 8 月 16 日至 2003 年 2 月 15 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	1.640	86,640,616.38	44,215,199.85	130,855,816.23	1次分红
2014年	0.850	64,008,230.69	27,474,978.29	91,483,208.98	1次分红
2013年	-	-	-	-	-
合计	2.490	150,648,847.07	71,690,178.14	222,339,025.21	-

§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		
曹晋	本基金基金经理兼富国中小盘精选混合型证券投资基金基金经理	2015-10-27	—	7 年	硕士，曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理研究员、研究员、基金经理助理、基金经理；2014 年 6 月加入富国基金管理有限公司，2014 年 10 月至 2015 年 10 月任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理,2015 年 1 月起任富国中

					小盘精选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月起任富国天源沪港深平衡混合型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天源沪港深平衡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》、《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》（原《富国天源平衡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、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 15 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，在稳增长,低利率的宽松货币政策护航下，宏观风险相对可控，市场上半年表现强势；三季度受清查场外配资的影响,股市出现剧烈调整；进入四季度，随着管理层的一系列救市政策相继出炉,市场开始反弹企稳。

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 1.7561 元，份额累计净值为 3.4687 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 73.14%，同期业绩比较基准收益率为 7.40%。

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，宏观的不确定性逐步加大；注册制的推出以及 IPO 重启发行都将加大股票的供给；大小非开放减持解禁也将加大市场的压力； 汇率的波动以及外汇占款的外流加大市场对流动性的担忧。下半年，随着全球宏观经济的不确定增加，以及流动性宽松的边际效应递减，市场风险逐步加大。 对于公募基金而言，我们认为 2016 年的机会来自于不断的结构性优化，寻找穿越牛熊的品种。天源平衡基金将更多的发挥平衡基金的优势，在股债中调整结构，精选个股，为持有人取得超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终将加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2015 年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

（一）针对日常检查发现的问题，建立健全公司制度

监察稽核部结合公司运作及日常检查情况，督促各业务部门对制度、流程进行了全面梳理，2015 年公司制订或修订了三十项规章制度。通过健全完善公司制度体系，明确新设部门岗位设置及岗位职责、相关业务操作规则，为业务办理提供清晰、明确的依据，确保公司各项工作准确高效完成。

（二）着眼于日常流程控制，推动流程改进工作

2015 年监察稽核部以各项检查、日常发现为契机，牵头推动流程改进工作。如通过逐步梳理信息披露流程、合同审核流程和跨部门协作流程等，解决了用其他流程替代业务审核流程的问题，使产品设计能满足后续运维的实际需要，更有效地保障投资者的相关权益。

（三）积极开展合规培训，提升全员合规意识

2015 年监察稽核部积极配合人力资源部做好员工合规培训。为加强培训效果，公司采用灵活多样的培训方式，选取基金行业的热点问题，邀请外部律师和会计师事务所专家参与培训互动，向员工详细讲解公募行业“三条底线”，介绍利用未公开信息交易和内幕交易的真实案件，解读内部控制的监管要求和核查要点，分析基金管理公司各部门内部控制常见问题和潜在风险。通过对法律法规、真实案例的解读，提高全体员工合规意识，并在日常工作中自觉遵守各项法规要求。

（四）着重开展专项审计，提高内部控制有效性

为加强审计工作的有效性，不至于流于形式，2015 年监察稽核部结合常规季度监察稽核工作，有针对性地开展了 6 项专项审计。根据审计情况，除帮助相关部门对审计发现的问题进行梳理外，监察稽核部还协同对相应的流程进行了重整，以规范相关业务操作流程，提高内部控制的有效性。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2015 年 01 月 15 日公告对 2014 年报告期内利润进行收益分配，每 10 份基金份额派发红利 1.64 元，共计派发红利 130855816.23 元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31

日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第 60467606_B05 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金（原名富国天源平衡混合型证券投资基金）全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金（原名富国天源平衡混合型证券投资基金）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人富国基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照

	中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金（原名富国天源平衡混合型证券投资基金）2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	郭杭翔	黎　燕
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2016 年 03 月 24 日	

§7　年度财务报表

7.1　资产负债表

会计主体：富国天源沪港深平衡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）
资 产：		
银行存款	51,888,735.28	71,472,909.94
结算备付金	8,667,372.14	10,134,022.08
存出保证金	2,744,529.31	833,066.06
交易性金融资产	1,051,521,438.29	952,030,341.38
其中：股票投资	766,917,338.29	621,838,341.38
基金投资	-	-
债券投资	284,604,100.00	330,192,000.00
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	10,576,074.85	12,148,126.82
应收利息	4,561,345.16	4,489,341.88
应收股利	-	-
应收申购款	7,503,857.11	745,445.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	547.03	547.03
资产总计	1,137,463,899.17	1,051,853,801.03
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	2,026,221.21	43,243,435.59
应付赎回款	3,845,594.49	46,077,992.98
应付管理人报酬	1,331,775.56	1,350,820.26
应付托管费	221,962.57	225,136.71
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,223,715.35	4,300,936.72
应交税费	34,926.80	34,926.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	113,579.36	375,463.57
负债合计	11,797,775.34	95,608,712.63
所有者权益：		
实收基金	640,988,498.85	815,014,727.68
未分配利润	484,677,624.98	141,230,360.72

所有者权益合计	1,125,666,123.83	956,245,088.40
负债和所有者权益总计	1,137,463,899.17	1,051,853,801.03

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7561 元，基金份额总额 640,988,498.85 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天源沪港深平衡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）
一、收入	598,351,407.22	205,375,534.15
1.利息收入	11,612,473.30	14,737,511.02
其中：存款利息收入	599,440.65	444,880.04
债券利息收入	10,827,467.51	14,147,289.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	185,565.14	145,341.78
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	505,640,511.26	214,926,921.47
其中：股票投资收益	508,583,550.98	206,850,089.13
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,254,845.52	726,472.20
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	4,311,805.80	7,350,360.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	80,129,075.91	-24,986,394.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	969,346.75	697,496.52
减：二、费用	49,392,543.45	37,306,942.23
1．管理人报酬	14,373,294.40	16,511,284.47
2．托管费	2,395,549.03	2,751,880.74
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	32,038,989.41	17,715,600.47
5．利息支出	281,803.01	99,921.03
其中：卖出回购金融资产支出	281,803.01	99,921.03
6．其他费用	302,907.60	228,255.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	548,958,863.77	168,068,591.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	548,958,863.77	168,068,591.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天源沪港深平衡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）	815,014,727.68	141,230,360.72	956,245,088.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	548,958,863.77	548,958,863.77
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）	-174,026,228.83	-74,655,783.28	-248,682,012.11
其中：1.基金申购款	609,548,172.81	276,897,230.16	886,445,402.97
2.基金赎回款	-783,574,401.64	-351,553,013.44	-1,135,127,415.08
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）	-	-130,855,816.23	-130,855,816.23
五、期末所有者权益（基金净值）	640,988,498.85	484,677,624.98	1,125,666,123.83
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）	996,084,203.64	102,599,243.34	1,098,683,446.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	168,068,591.92	168,068,591.92
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）	-181,069,475.96	-37,954,265.56	-219,023,741.52
其中：1.基金申购款	554,057,827.60	27,900,508.35	581,958,335.95
2.基金赎回款	-735,127,303.56	-65,854,773.91	-800,982,077.47
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）	-	-91,483,208.98	-91,483,208.98
五、期末所有者权益（基金净值）	815,014,727.68	141,230,360.72	956,245,088.40

注：所附附注为本会计报表的组成部分

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 基金基本情况

富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金(原名富国天源平衡混合型证券投资基金）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2002]36 号文《关于同意富国动态平衡证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2002 年 8 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 4,616,913,656.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。自 2007 年 4 月 13 日起，本基金由“富国动态平衡证券投资基金”正式更名为“富国天源平衡混合型证券投资基金”。

根据富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会通过的《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》，自 2015 年 10 月 27 日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、港股通标的股票、固定收益类资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产）、衍生工具（权证、股指期货）、以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-75%（其中，投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-75%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-75%）；债券投资占基金资产的比例为 25%-80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的 5%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金原业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率×65%＋中信国债指数收益率×30%＋同业存款利率×5%。自 2015 年 10 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为沪深 300 指数收益率×65%＋中债综合全价指数收益率×30%＋同业存款利率×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定

的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行＜企业会计准则＞估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号＜年度报告和半年度报告＞》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；
金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；
本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：
(1) 股票投资
买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；
卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；
(2) 债券投资
买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；
买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；
卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；
(3) 权证投资
买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；
卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；
(4) 股指期货投资
买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；
股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；
(5) 分离交易可转债
申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；
上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；
(6) 回购协议
基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层

次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐

日计提；
(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；
(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；
(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；
(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式默认为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金。
(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额 净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
(3) 每一基金份额享有同等分配权。如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别， 则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；
(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期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。

7.4.5.3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。

7.4.6 税项

1.印花税
经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；
经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；
2.营业税、企业所得税
根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；
根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；
3.个人所得税
根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；
根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；
根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1

个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
活期存款	51,888,735.28	71,472,909.94
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	51,888,735.28	71,472,909.94

注：本基金本报告期内及上年度内未投资于定期存款。

7.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2015 年 12 月 31 日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		663,028,345.91	766,917,338.29	103,888,992.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	122,756,451.79	122,430,100.00	-326,351.79
	银行间市场	160,073,230.00	162,174,000.00	2,100,770.00
	合计	282,829,681.79	284,604,100.00	1,774,418.21
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		945,858,027.70	1,051,521,438.29	105,663,410.59
项目		上年度末（2014 年 12 月 31 日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		597,513,876.70	621,838,341.38	24,324,464.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	29,909,280.00	29,955,000.00	45,720.00
	银行间市场	299,072,850.00	300,237,000.00	1,164,150.00
	合计	328,982,130.00	330,192,000.00	1,209,870.00
资产支持证券		-	-	-

其他	-	-	-
合计	926,496,006.70	952,030,341.38	25,534,334.68

7.4.7.3衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
应收活期存款利息	12,342.17	11,551.42
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,900.30	4,560.30
应收债券利息	4,543,867.69	4,472,855.26
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,235.00	374.90
合计	4,561,345.16	4,489,341.88

7.4.7.6其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
其他应收款	547.03	547.03
待摊费用	-	-
合计	547.03	547.03

7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
交易所市场应付交易费用	4,222,840.35	4,300,311.72
银行间市场应付交易费用	875.00	625.00
合计	4,223,715.35	4,300,936.72

7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	13,579.36	175,463.57

预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	-	100,000.00
合计	113,579.36	375,463.57

7.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	815,014,727.68	815,014,727.68
本期申购	609,548,172.81	609,548,172.81
本期赎回（以“-”号填列）	-783,574,401.64	-783,574,401.64
本期末	640,988,498.85	640,988,498.85

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	302,685,425.08	-161,455,064.36	141,230,360.72
本期利润	468,829,787.86	80,129,075.91	548,958,863.77
本期基金份额交易产生的变动数	-109,793,137.92	35,137,354.64	-74,655,783.28
其中：基金申购款	345,271,009.68	-68,373,779.52	276,897,230.16
基金赎回款	-455,064,147.60	103,511,134.16	-351,553,013.44
本期已分配利润	-130,855,816.23	-	-130,855,816.23
本期末	530,866,258.79	-46,188,633.81	484,677,624.98

7.4.7.11 存款利息收入

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）
活期存款利息收入	400,106.98	358,120.09
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	169,624.17	62,510.05
其他	29,709.50	24,249.90
合计	599,440.65	444,880.04

7.4.7.12 股票投资收益

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）
卖出股票成交总额	10,780,249,823.63	5,967,940,152.71
减：卖出股票成本总额	10,271,666,272.65	5,761,090,063.58
买卖股票差价收入	508,583,550.98	206,850,089.13

7.4.7.13 债券投资收益

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）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	672,699,371.39	155,701,574.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	667,292,986.95	151,173,457.70
减：应收利息总额	12,661,229.96	3,801,644.93
买卖债券差价收入	-7,254,845.52	726,472.20

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期和上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

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）
股票投资产生的股利收益	4,311,805.80	7,350,360.14
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,311,805.80	7,350,360.14

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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）
1.交易性金融资产	80,129,075.91	-24,986,394.86
股票投资	79,564,527.70	-44,563,778.96
债券投资	564,548.21	19,577,384.10
资产支持证券投资	-	-

基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	80,129,075.91	-24,986,394.86

7.4.7.19 其他收入

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）
基金赎回费收入	597,154.32	474,765.76
基金转换费收入	372,192.43	222,730.76
其他	-	-
合计	969,346.75	697,496.52

7.4.7.20 交易费用

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）
交易所市场交易费用	32,025,714.41	17,710,825.47
银行间市场交易费用	13,275.00	4,775.00
合计	32,038,989.41	17,715,600.47

7.4.7.21 其他费用

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）
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
其他	60,000.00	-
银行费用	24,907.60	10,255.52
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	302,907.60	228,255.52

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国农业银行股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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	5,576,154,395.97	26.41	1,332,817,724.53	11.45
申万宏源	3,156,837,007.92	14.95	-	-
申银万国	-	-	1,634,530,703.15	14.05

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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（%）
申万宏源	68,606,863.80	22.23	-	-
申银万国	-	-	2,997,900.00	6.90

7.4.10.1.4 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（%）
申万宏源	1,385,400,000.00	41.57	-	-

7.4.10.1.5 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	5,006,602.17	26.29	1,083,764.63	25.66
申万宏源	2,888,519.05	15.17	761,362.97	18.03
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（%）
申银万国	1,468,512.85	14.11	1,083,138.05	25.19
海通证券	1,179,411.58	11.33	731,190.26	17.00

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	14,373,294.40	16,511,284.47
其中：支付销售机构的客户维护费	3,692,020.58	1,272,877.16

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×1.50%/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。

7.4.10.2.2 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	2,395,549.03	2,751,880.74

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×0.25%/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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期（2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	314,000,000.00	226,942.23
上年度可比期间（2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	50,000,000.00	99,726.03

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2015 年 6 月 24 日,无上年度同期对比数据。

7.4.10.4.2 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未投资本基金，本基金合同生效日为 2015 年 6 月 24 日,无上年度同期对比数据。

7.4.10.5 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
中国农业银行股份有限公司	51,888,735.28	400,106.98	71,472,909.94	358,120.09

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计	备注
1	2015-01-19	2015-01-20	1.640	86,640,616.38	44,215,199.85	130,855,816.23	-
合 计			1.640	86,640,616.38	44,215,199.85	130,855,816.2	-

						3	

注：本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项(附注 7.4.8.2)。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项停牌	30.62	-	-	10	125.00	306.20	-
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项停牌	49.96	2016-01-22	44.96	661,900	29,724,756.30	33,068,524.00	-
300349	金卡股份	2015-11-20	重大事项停牌	37.75	-	-	1	55.83	37.75	-
300431	暴风科技	2015-10-27	重大事项停牌	95.83	-	-	2	221.27	191.66	-
600271	航天信息	2015-10-12	重大事项停牌	71.46	-	-	68,900	3,548,124.00	4,923,594.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基

金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。
本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。
本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。
本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2015 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	51,888,735.28	-	-	-	-	-	51,888,735.28
结算备付金	8,667,372.14	-	-	-	-	-	8,667,372.14
存出保证金	2,744,529.31	-	-	-	-	-	2,744,529.31
交易性金融资产	-	-	252,645,100.00	-	31,959,000.00	766,917,338.29	1,051,521,438.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,576,074.85	10,576,074.85
应收利息	-	-	-	-	-	4,561,345.16	4,561,345.16
应收申购款	196,992.58	-	-	-	-	7,306,864.53	7,503,857.11
其他应收款	-	-	-	-	-	547.03	547.03
资产总计	63,497,629.31	-	252,645,100.00	-	31,959,000.00	789,362,169.86	1,137,463,899.17
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,026,221.21	2,026,221.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,845,594.49	3,845,594.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,331,775.56	1,331,775.56
应付托管费	-	-	-	-	-	221,962.57	221,962.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,223,715.35	4,223,715.35
应付税费	-	-	-	-	-	34,926.80	34,926.80
其他负债	-	-	-	-	-	113,579.36	113,579.36
负债总计	-	-	-	-	-	11,797,775.34	11,797,775.34
利率敏感度缺口	63,497,629.31	-	252,645,100.00	-	31,959,000.00	777,564,394.52	1,125,666,123.83

上年度末（2014 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	71,472,909.94	-	-	-	-	-	71,472,909.94
结算备付金	10,134,022.08	-	-	-	-	-	10,134,022.08
存出保证金	833,066.06	-	-	-	-	-	833,066.06
交易性金融资产	58,242,000.00	-	90,279,000.00	39,949,000.00	141,722,000.00	621,838,341.38	952,030,341.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,148,126.82	12,148,126.82
应收利息	-	-	-	-	-	4,489,341.88	4,489,341.88
应收申购款	2,092.26	-	-	-	-	743,353.58	745,445.84
其他应收款	-	-	-	-	-	547.03	547.03
资产总计	140,684,090.34	-	90,279,000.00	39,949,000.00	141,722,000.00	639,219,710.69	1,051,853,801.03
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	43,243,435.59	43,243,435.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	46,077,992.98	46,077,992.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,350,820.26	1,350,820.26
应付托管费	-	-	-	-	-	225,136.71	225,136.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,300,936.72	4,300,936.72
应付税费	-	-	-	-	-	34,926.80	34,926.80
其他负债	-	-	-	-	-	375,463.57	375,463.57
负债总计	-	-	-	-	-	95,608,712.63	95,608,712.63
利率敏感度缺口	140,684,090.34	-	90,279,000.00	39,949,000.00	141,722,000.00	543,610,998.06	956,245,088.40

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1.影响生息资产的其他变量不变，仅利率发生变动； 2.利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元 ）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1.基准点利率增加 0.1%	-267,757.33	-931,504.46
	2.基准点利率减少 0.1%	267,757.33	931,504.46

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-75%（其中，投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-75%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-75%）；债券投资占基金资产的比例为 25%-80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的 5%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2015 年 12 月 31 日）		上年度末（2014 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	766,917,338.29	68.13	621,838,341.38	65.03
交易性金融资产－债券投资	284,604,100.00	25.28	330,192,000.00	34.53
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,051,521,438.29	93.41	952,030,341.38	99.56

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1.基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2.以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元 ）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准增加 1%	8,661,283.01	7,739,414.19
	2.业绩比较基准减少 1%	-8,661,283.01	-7,739,414.19

7.4.14 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 728,924,684.68 元，属于第二层次的余额为人民币 322,596,753.61 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2014 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 570,974,324.02 元，属于第二层次的余额为人民币 381,056,017.36 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	766,917,338.29	67.42
	其中：股票	766,917,338.29	67.42
2	固定收益投资	284,604,100.00	25.02
	其中：债券	284,604,100.00	25.02
	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	60,556,107.42	5.32
7	其他各项资产	25,386,353.46	2.23
8	合计	1,137,463,899.17	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	32,584,658.40	2.89
B	采矿业	-	-
C	制造业	529,575,080.65	47.05

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	50.62	0.00
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	81,012,702.96	7.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,465,412.00	1.82
L	租赁和商务服务业	15.46	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	103,279,418.20	9.17
S	综合	-	-
	合计	766,917,338.29	68.13

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002329	皇氏集团	3,000,000	83,700,000.00	7.44
2	002094	青岛金王	1,691,294	52,683,808.10	4.68
3	600136	道博股份	836,745	52,179,418.20	4.64
4	002445	中南重工	1,838,388	51,566,783.40	4.58
5	002699	美盛文化	1,000,000	51,100,000.00	4.54
6	002494	华斯股份	1,807,900	47,909,350.00	4.26
7	002292	奥飞动漫	883,501	45,685,836.71	4.06
8	300310	宜通世纪	672,800	41,935,624.00	3.73
9	600678	四川金顶	1,292,900	35,800,401.00	3.18
10	300242	明家科技	661,900	33,068,524.00	2.94
11	002458	益生股份	862,028	32,584,658.40	2.89
12	000561	烽火电子	2,049,600	29,063,328.00	2.58
13	000835	长城动漫	1,000,000	22,330,000.00	1.98
14	002464	金利科技	272,501	22,146,156.27	1.97
15	002308	威创股份	895,275	22,068,528.75	1.96
16	002590	万安科技	874,000	21,762,600.00	1.93
17	300264	佳创视讯	758,300	20,974,578.00	1.86
18	600745	中茵股份	499,400	20,465,412.00	1.82
19	002123	荣信股份	788,899	20,235,259.35	1.80
20	300051	三五互联	683,104	18,102,256.00	1.61

21	300100	双林股份	522,771	16,373,187.72	1.45
22	002626	金达威	808,400	15,691,044.00	1.39
23	600271	航天信息	68,900	4,923,594.00	0.44
24	002766	索菱股份	65,768	3,258,804.40	0.29
25	300009	安科生物	26,600	1,151,248.00	0.10
26	300078	思创医惠	3,200	156,160.00	0.01
27	002018	华信国际	10	306.20	0.00
28	300431	暴风科技	2	191.66	0.00
29	300257	开山股份	2	61.70	0.00
30	002253	川大智胜	1	53.30	0.00
31	002462	嘉事堂	1	50.62	0.00
32	300349	金卡股份	1	37.75	0.00
33	002358	森源电气	2	36.90	0.00
34	002339	积成电子	1	24.40	0.00
35	000861	海印股份	2	15.46	0.00

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	601988	中国银行	169,494,827.58	17.73
2	002329	皇氏集团	144,634,843.08	15.13
3	000002	万科 A	135,387,195.64	14.16
4	601166	兴业银行	134,876,131.13	14.10
5	002405	四维图新	114,582,090.82	11.98
6	300043	互动娱乐	105,976,167.92	11.08
7	002599	盛通股份	101,071,312.57	10.57
8	002445	中南重工	86,612,185.58	9.06
9	002363	隆基机械	86,607,152.04	9.06
10	002292	奥飞动漫	81,194,200.68	8.49
11	600048	保利地产	80,861,928.95	8.46
12	000333	美的集团	80,101,563.38	8.38
13	002494	华斯股份	79,883,371.91	8.35
14	300144	宋城演艺	79,124,584.58	8.27
15	601599	鹿港科技	76,205,211.63	7.97
16	601398	工商银行	76,143,661.94	7.96
17	300016	北陆药业	74,859,936.48	7.83
18	300253	卫宁软件	74,602,793.27	7.80
19	002458	益生股份	74,407,585.15	7.78
20	600415	小商品城	71,732,715.51	7.50
21	002153	石基信息	71,455,889.75	7.47

22	300133	华策影视	70,648,962.57	7.39
23	002312	三泰控股	67,927,172.35	7.10
24	002699	美盛文化	67,708,018.43	7.08
25	300005	探路者	67,126,946.42	7.02
26	600358	国旅联合	66,230,271.09	6.93
27	000100	TCL 集团	66,208,783.28	6.92
28	002714	牧原股份	63,876,154.37	6.68
29	600208	新湖中宝	63,745,389.16	6.67
30	002318	久立特材	63,728,804.79	6.66
31	300104	乐视网	63,697,303.75	6.66
32	300147	香雪制药	62,323,816.96	6.52
33	600690	青岛海尔	61,425,527.88	6.42
34	002308	威创股份	61,296,839.83	6.41
35	600571	信雅达	61,110,040.70	6.39
36	000732	泰禾集团	60,989,378.35	6.38
37	601818	光大银行	60,787,221.14	6.36
38	300113	顺网科技	60,545,163.90	6.33
39	300171	东富龙	60,459,927.81	6.32
40	600694	大商股份	59,575,782.17	6.23
41	000802	北京文化	59,202,019.31	6.19
42	300356	光一科技	58,388,491.61	6.11
43	300295	三六五网	57,299,277.00	5.99
44	000831	五矿稀土	56,983,541.53	5.96
45	300336	新文化	56,798,723.43	5.94
46	600409	三友化工	56,302,865.32	5.89
47	600058	五矿发展	56,180,073.00	5.88
48	002456	欧菲光	56,016,358.94	5.86
49	002466	天齐锂业	52,674,959.65	5.51
50	000901	航天科技	52,410,108.75	5.48
51	002074	国轩高科	52,228,167.77	5.46
52	002642	荣之联	51,326,767.81	5.37
53	600136	道博股份	50,673,993.84	5.30
54	002094	青岛金王	50,228,803.81	5.25
55	600325	华发股份	49,299,152.55	5.16
56	601801	皖新传媒	49,152,684.00	5.14
57	600109	国金证券	49,058,076.00	5.13
58	300130	新国都	48,887,250.10	5.11
59	300226	上海钢联	47,003,831.18	4.92
60	002659	中泰桥梁	46,150,777.40	4.83
61	000768	中航飞机	46,121,474.05	4.82
62	300242	明家科技	46,037,461.05	4.81

63	300352	北信源	45,793,619.02	4.79
64	600654	中安消	45,133,756.32	4.72
65	000024	招商地产	44,541,072.02	4.66
66	002343	禾欣股份	42,098,054.40	4.40
67	300018	中元华电	41,440,230.99	4.33
68	002304	洋河股份	41,357,588.59	4.32
69	600663	陆家嘴	40,090,694.25	4.19
70	601998	中信银行	39,936,170.15	4.18
71	300347	泰格医药	39,718,914.46	4.15
72	002221	东华能源	39,471,545.99	4.13
73	002251	步步高	38,903,711.52	4.07
74	300100	双林股份	38,650,394.08	4.04
75	600054	黄山旅游	38,346,896.41	4.01
76	600518	康美药业	38,321,740.52	4.01
77	600999	招商证券	38,262,344.28	4.00
78	601318	中国平安	38,161,259.49	3.99
79	600118	中国卫星	38,073,404.08	3.98
80	300430	诚益通	37,640,424.32	3.94
81	600536	中国软件	37,572,857.78	3.93
82	002044	江苏三友	37,090,840.65	3.88
83	000967	上风高科	36,889,742.42	3.86
84	600876	洛阳玻璃	36,798,874.42	3.85
85	601688	华泰证券	36,623,858.88	3.83
86	300291	华录百纳	36,616,128.46	3.83
87	002425	凯撒股份	36,587,345.12	3.83
88	002612	朗姿股份	36,367,254.60	3.80
89	300146	汤臣倍健	36,030,156.86	3.77
90	002477	雏鹰农牧	35,862,692.53	3.75
91	601555	东吴证券	34,713,835.04	3.63
92	300364	中文在线	34,238,132.60	3.58
93	601628	中国人寿	34,223,333.64	3.58
94	002029	七匹狼	34,172,483.18	3.57
95	300271	华宇软件	34,132,615.75	3.57
96	000607	华媒控股	33,616,624.90	3.52
97	601799	星宇股份	33,488,076.14	3.50
98	600887	伊利股份	33,278,698.05	3.48
99	601021	春秋航空	33,267,132.69	3.48
100	600703	三安光电	33,197,474.02	3.47
101	002400	省广股份	32,673,137.47	3.42
102	000523	广州浪奇	32,530,069.31	3.40
103	603555	贵人鸟	32,374,404.11	3.39

104	002049	同方国芯	32,370,552.80	3.39
105	300075	数字政通	32,305,109.38	3.38
106	300166	东方国信	32,193,248.80	3.37
107	002439	启明星辰	32,040,135.27	3.35
108	002063	远光软件	31,577,498.21	3.30
109	300065	海兰信	31,452,439.91	3.29
110	600678	四川金顶	31,406,552.89	3.28
111	300186	大华龙	31,314,886.10	3.27
112	601888	中国国旅	30,924,062.66	3.23
113	000651	格力电器	30,715,617.80	3.21
114	000829	天音控股	30,462,544.96	3.19
115	600115	东方航空	30,266,052.97	3.17
116	600271	航天信息	30,210,911.88	3.16
117	300332	天壕环境	30,207,317.36	3.16
118	600038	中直股份	30,032,449.68	3.14
119	000561	烽火电子	29,866,926.96	3.12
120	601857	中国石油	29,778,789.00	3.11
121	600958	东方证券	29,167,485.76	3.05
122	002712	思美传媒	29,032,717.93	3.04
123	002030	达安基因	28,989,847.35	3.03
124	002339	积成电子	28,981,795.10	3.03
125	002179	中航光电	28,706,359.68	3.00
126	002047	宝鹰股份	28,490,949.82	2.98
127	000078	海王生物	28,322,350.05	2.96
128	000796	凯撒旅游	28,149,762.05	2.94
129	000835	长城动漫	27,980,479.31	2.93
130	300101	振芯科技	27,965,239.22	2.92
131	600009	上海机场	27,703,083.73	2.90
132	300349	金卡股份	27,225,462.95	2.85
133	002024	苏宁云商	27,100,164.17	2.83
134	002260	德奥通航	26,956,748.15	2.82
135	002070	众和股份	26,709,448.76	2.79
136	300059	东方财富	26,651,491.67	2.79
137	300302	同有科技	26,619,588.61	2.78
138	002462	嘉事堂	26,449,528.35	2.77
139	002589	瑞康医药	26,193,069.97	2.74
140	002390	信邦制药	26,137,112.62	2.73
141	002197	证通电子	26,124,944.08	2.73
142	600547	山东黄金	26,061,903.14	2.73
143	002004	华邦健康	26,023,922.83	2.72
144	300207	欣旺达	26,009,092.55	2.72

145	300038	梅泰诺	25,960,696.93	2.71
146	000001	平安银行	25,879,907.57	2.71
147	300310	宜通世纪	25,866,563.00	2.71
148	600588	用友网络	25,730,926.90	2.69
149	002376	新北洋	25,422,866.60	2.66
150	600651	飞乐音响	25,228,331.68	2.64
151	002664	信质电机	25,006,945.90	2.62
152	002572	索菲亚	24,791,926.97	2.59
153	002354	天神娱乐	24,603,734.00	2.57
154	002384	东山精密	24,095,780.04	2.52
155	600862	南通科技	24,095,663.69	2.52
156	600491	龙元建设	23,931,896.58	2.50
157	002223	鱼跃医疗	23,758,348.64	2.48
158	600570	恒生电子	23,177,436.28	2.42
159	002311	海大集团	22,848,429.68	2.39
160	600343	航天动力	22,695,768.92	2.37
161	600893	中航动力	22,693,344.55	2.37
162	600760	中航黑豹	22,598,924.36	2.36
163	000777	中核科技	22,132,417.20	2.31
164	300333	兆日科技	21,880,864.00	2.29
165	002766	索菱股份	21,863,252.80	2.29
166	600650	锦江投资	21,836,320.05	2.28
167	002590	万安科技	21,749,891.20	2.27
168	000596	古井贡酒	21,528,648.15	2.25
169	600699	均胜电子	21,504,391.95	2.25
170	002236	大华股份	21,436,504.38	2.24
171	002464	金利科技	21,432,064.00	2.24
172	300257	开山股份	21,397,789.96	2.24
173	000547	航天发展	21,325,423.07	2.23
174	002123	荣信股份	21,212,306.08	2.22
175	600745	中茵股份	21,008,695.00	2.20
176	000888	峨眉山 A	20,919,983.44	2.19
177	300248	新开普	20,882,026.40	2.18
178	600697	欧亚集团	20,746,892.77	2.17
179	300264	佳创视讯	20,565,013.00	2.15
180	000697	炼石有色	20,378,016.04	2.13
181	600826	兰生股份	20,341,016.26	2.13
182	300188	美亚柏科	20,321,770.70	2.13
183	300265	通光线缆	20,288,133.90	2.12
184	300031	宝通科技	20,195,613.63	2.11
185	600511	国药股份	20,139,429.00	2.11

186	300259	新天科技	20,024,571.67	2.09
187	002661	克明面业	19,906,748.16	2.08
188	000633	合金投资	19,803,975.81	2.07
189	600701	工大高新	19,729,497.40	2.06
190	600037	歌华有线	19,589,703.77	2.05
191	002392	北京利尔	19,552,388.73	2.04
192	601918	国投新集	19,522,039.84	2.04
193	300183	东软载波	19,507,163.39	2.04
194	600098	广州发展	19,418,165.72	2.03
195	002011	盾安环境	19,220,885.73	2.01

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	300253	卫宁软件	167,903,983.53	17.56
2	601988	中国银行	165,482,825.77	17.31
3	601166	兴业银行	153,607,440.39	16.06
4	600415	小商品城	149,906,908.39	15.68
5	000002	万科 A	145,651,279.99	15.23
6	002329	皇氏集团	122,541,763.65	12.81
7	002405	四维图新	117,968,402.83	12.34
8	002363	隆基机械	110,635,925.19	11.57
9	601599	鹿港科技	104,245,034.02	10.90
10	300043	互动娱乐	102,205,952.34	10.69
11	002318	久立特材	96,664,292.76	10.11
12	000732	泰禾集团	95,742,496.41	10.01
13	300016	北陆药业	86,677,304.43	9.06
14	600048	保利地产	85,986,784.11	8.99
15	002599	盛通股份	85,821,739.39	8.97
16	002153	石基信息	85,346,667.12	8.93
17	300171	东富龙	80,572,817.29	8.43
18	000333	美的集团	80,372,861.10	8.41
19	002312	三泰控股	79,069,687.06	8.27
20	300133	华策影视	77,489,193.32	8.10
21	300226	上海钢联	77,472,293.75	8.10
22	002642	荣之联	74,163,469.33	7.76
23	000100	TCL 集团	73,264,329.61	7.66
24	601398	工商银行	72,926,963.91	7.63
25	300113	顺网科技	72,512,722.79	7.58
26	300336	新文化	72,437,291.91	7.58
27	002466	天齐锂业	71,629,065.79	7.49
28	600358	国旅联合	69,953,338.49	7.32

29	300144	宋城演艺	69,927,489.01	7.31
30	601318	中国平安	68,894,990.00	7.20
31	300005	探路者	67,910,737.92	7.10
32	000802	北京文化	67,318,536.99	7.04
33	300038	梅泰诺	66,212,805.99	6.92
34	300104	乐视网	65,989,206.55	6.90
35	600208	新湖中宝	65,836,419.41	6.88
36	300295	三六五网	65,615,856.97	6.86
37	300147	香雪制药	62,572,744.77	6.54
38	002456	欧菲光	61,336,948.18	6.41
39	300356	光一科技	60,751,221.54	6.35
40	300352	北信源	60,057,095.00	6.28
41	601818	光大银行	59,730,296.74	6.25
42	002445	中南重工	57,695,447.77	6.03
43	600409	三友化工	57,632,005.88	6.03
44	300364	中文在线	57,466,121.26	6.01
45	000712	锦龙股份	56,815,967.95	5.94
46	600690	青岛海尔	56,450,549.47	5.90
47	600694	大商股份	56,049,659.06	5.86
48	000831	五矿稀土	54,123,546.65	5.66
49	600654	中安消	51,971,661.33	5.43
50	600999	招商证券	51,086,374.86	5.34
51	002714	牧原股份	50,780,083.14	5.31
52	600571	信雅达	50,672,058.92	5.30
53	002070	众和股份	50,383,776.26	5.27
54	600109	国金证券	50,368,566.44	5.27
55	300059	东方财富	49,998,448.63	5.23
56	002074	国轩高科	49,986,878.26	5.23
57	000901	航天科技	49,657,912.05	5.19
58	601801	皖新传媒	47,876,489.44	5.01
59	601555	东吴证券	46,841,145.47	4.90
60	600703	三安光电	46,585,154.52	4.87
61	002292	奥飞动漫	46,434,051.20	4.86
62	600058	五矿发展	46,093,627.14	4.82
63	300430	诚益通	45,991,186.00	4.81
64	002458	益生股份	45,951,789.21	4.81
65	600118	中国卫星	45,800,624.75	4.79
66	002439	启明星辰	45,234,485.00	4.73
67	002425	凯撒股份	44,840,153.52	4.69
68	300130	新国都	44,435,113.79	4.65
69	000024	招商地产	44,271,970.14	4.63

70	603555	贵人鸟	43,614,233.70	4.56
71	600536	中国软件	42,122,159.23	4.40
72	600325	华发股份	40,789,563.91	4.27
73	002612	朗姿股份	40,577,062.93	4.24
74	002659	中泰桥梁	40,279,907.67	4.21
75	300332	天壕环境	39,761,268.94	4.16
76	600876	洛阳玻璃	39,471,611.66	4.13
77	002308	威创股份	39,290,123.97	4.11
78	002304	洋河股份	39,196,061.40	4.10
79	601998	中信银行	39,017,314.98	4.08
80	002004	华邦健康	38,829,424.83	4.06
81	600518	康美药业	38,585,292.32	4.04
82	002343	禾欣股份	38,459,677.01	4.02
83	300065	海兰信	38,225,960.75	4.00
84	300075	数字政通	38,097,587.93	3.98
85	002563	森马服饰	37,397,868.00	3.91
86	002221	东华能源	37,217,658.17	3.89
87	600054	黄山旅游	37,178,415.21	3.89
88	600663	陆家嘴	37,168,100.08	3.89
89	000523	广州浪奇	36,538,166.37	3.82
90	300291	华录百纳	36,534,336.40	3.82
91	002712	思美传媒	36,503,466.61	3.82
92	002251	步步高	36,393,292.32	3.81
93	300347	泰格医药	36,226,184.30	3.79
94	601688	华泰证券	36,209,402.68	3.79
95	002339	积成电子	36,143,195.66	3.78
96	601021	春秋航空	36,104,467.50	3.78
97	300146	汤臣倍健	35,637,306.11	3.73
98	002047	宝鹰股份	35,165,274.77	3.68
99	000607	华媒控股	35,034,019.64	3.66
100	300018	中元华电	34,855,637.05	3.65
101	002044	江苏三友	34,738,124.21	3.63
102	601628	中国人寿	33,866,070.06	3.54
103	600887	伊利股份	33,721,867.68	3.53
104	600958	东方证券	33,212,748.53	3.47
105	000078	海王生物	33,172,843.34	3.47
106	002063	远光软件	33,110,121.25	3.46
107	002400	省广股份	32,985,613.30	3.45
108	000967	上风高科	32,954,166.18	3.45
109	601799	星宇股份	32,944,594.09	3.45
110	300271	华宇软件	32,666,241.15	3.42

111	300166	东方国信	31,895,161.89	3.34
112	000651	格力电器	31,883,056.90	3.33
113	000768	中航飞机	31,407,660.48	3.28
114	300248	新开普	31,336,284.56	3.28
115	300338	开元仪器	31,173,186.97	3.26
116	000596	古井贡酒	31,025,901.36	3.24
117	002494	华斯股份	30,903,572.26	3.23
118	002049	同方国芯	30,414,366.14	3.18
119	002030	达安基因	30,048,793.04	3.14
120	002462	嘉事堂	29,636,845.82	3.10
121	000796	凯撒旅游	29,436,212.48	3.08
122	600038	中直股份	29,391,380.30	3.07
123	601857	中国石油	29,260,152.39	3.06
124	002589	瑞康医药	29,201,358.35	3.05
125	600115	东方航空	29,143,714.70	3.05
126	300302	同有科技	29,117,804.69	3.05
127	600697	欧亚集团	28,781,232.18	3.01
128	601888	中国国旅	28,698,873.02	3.00
129	600446	金证股份	28,512,918.09	2.98
130	002260	德奥通航	28,429,409.17	2.97
131	002197	证通电子	28,382,658.13	2.97
132	000829	天音控股	27,841,932.47	2.91
133	000671	阳光城	27,682,284.21	2.89
134	600588	用友网络	27,196,068.37	2.84
135	300207	欣旺达	27,154,382.80	2.84
136	002029	七匹狼	27,006,225.95	2.82
137	002024	苏宁云商	26,756,283.90	2.80
138	002376	新北洋	26,566,356.60	2.78
139	002477	雏鹰农牧	26,558,789.82	2.78
140	000001	平安银行	26,378,232.53	2.76
141	002179	中航光电	26,145,741.32	2.73
142	600009	上海机场	26,002,803.20	2.72
143	002011	盾安环境	25,563,482.63	2.67
144	002384	东山精密	25,432,024.28	2.66
145	002646	青青稞酒	25,395,676.01	2.66
146	300333	兆日科技	25,294,294.30	2.65
147	002354	天神娱乐	25,145,476.43	2.63
148	002390	信邦制药	24,985,328.71	2.61
149	600547	山东黄金	24,629,669.20	2.58
150	600570	恒生电子	24,512,777.57	2.56
151	600271	航天信息	24,419,314.56	2.55

152	002572	索菲亚	24,267,294.53	2.54
153	600893	中航动力	24,181,087.50	2.53
154	300349	金卡股份	24,131,033.75	2.52
155	600650	锦江投资	24,058,517.21	2.52
156	300183	东软载波	23,721,511.24	2.48
157	002311	海大集团	23,573,948.40	2.47
158	600862	南通科技	23,517,585.51	2.46
159	300100	双林股份	23,267,444.79	2.43
160	002344	海宁皮城	23,218,266.93	2.43
161	600699	均胜电子	23,134,238.82	2.42
162	600651	飞乐音响	23,105,026.55	2.42
163	300186	大华农	23,068,744.36	2.41
164	000697	炼石有色	22,874,454.70	2.39
165	002664	信质电机	22,826,341.10	2.39
166	002587	奥拓电子	22,691,555.53	2.37
167	002335	科华恒盛	22,674,974.60	2.37
168	002236	大华股份	22,322,823.66	2.33
169	000777	中核科技	22,319,694.51	2.33
170	600760	中航黑豹	22,146,746.13	2.32
171	002009	天奇股份	22,125,216.69	2.31
172	600754	锦江股份	21,997,964.20	2.30
173	600343	航天动力	21,966,783.18	2.30
174	002699	美盛文化	21,355,764.22	2.23
175	300031	宝通科技	21,205,131.26	2.22
176	600037	歌华有线	21,177,609.24	2.21
177	000547	航天发展	21,146,952.86	2.21
178	600491	龙元建设	20,734,924.05	2.17
179	300257	开山股份	20,717,061.69	2.17
180	002392	北京利尔	20,599,639.02	2.15
181	002766	索菱股份	20,391,078.41	2.13
182	600079	人福医药	20,300,570.14	2.12
183	000888	峨眉山 A	20,110,548.05	2.10
184	600701	工大高新	20,083,860.04	2.10
185	300188	美亚柏科	20,051,360.24	2.10
186	002113	天润控股	20,015,477.45	2.09
187	603993	洛阳钼业	19,727,933.73	2.06
188	600519	贵州茅台	19,652,213.00	2.06
189	600826	兰生股份	19,442,797.26	2.03
190	300086	康芝药业	19,349,178.87	2.02
191	600511	国药股份	19,318,152.86	2.02
192	000153	丰原药业	19,162,208.90	2.00

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	10,337,180,741.86
卖出股票收入（成交）总额	10,780,249,823.63

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	162,438,100.00	14.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,166,000.00	10.85
	其中：政策性金融债	122,166,000.00	10.85
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	284,604,100.00	25.28

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	150211	15 国开 11	600,000	60,174,000.00	5.35
2	019506	15 国债 06	450,000	45,108,000.00	4.01
3	019509	15 国债 09	400,000	40,088,000.00	3.56
4	110258	11 国开 58	300,000	31,959,000.00	2.84
5	150413	15 农发 13	300,000	30,033,000.00	2.67

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	2,744,529.31
2	应收证券清算款	10,576,074.85
3	应收股利	-
4	应收利息	4,561,345.16
5	应收申购款	7,503,857.11
6	其他应收款	547.03

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,386,353.46

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300242	明家科技	33,068,524.00	2.94	筹划重大事项

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（%）
27,402	23,392.03	298,402,771.15	46.55	342,585,727.70	53.45

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	57,043.71	0.0089

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(2002 年 08 月 16 日)基金份额总额	4,616,913,656.00
报告期期初基金份额总额	815,014,727.68
本报告期基金总申购份额	609,548,172.81
减：本报告期基金总赎回份额	783,574,401.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	640,988,498.85

§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，本基金自 2015 年 9 月 24 日至 2015 年 10 月 23 日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》。本次会议决议于 2015 年 10 月 26 日起生效，会议结果已报中国证券监督管理委员会备案。

本次持有人大会决议生效后，根据本次会议通过的议案及《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书》，自 2015 年 10 月 27 日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效，具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

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。

本报告期内，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	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	2	4,778,323,722.16	22.63	96,159,023.00	31.16	482,500,000.00	14.48	-	-	4,294,780.96	22.55	-
国海证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	2	1,775,763,717.79	8.41	-	-	14,400,000.00	0.43	-	-	1,618,937.75	8.50	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	5,576,154,395.97	26.41	-	-	-	-	-	-	5,006,602.17	26.29	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	4	3,156,837,007.92	14.95	68,606,863.80	22.23	1,385,400,000.00	41.57	-	-	2,888,519.05	15.17	-
兴业证券	2	5,477,051,366.29	25.94	143,847,901.50	46.61	1,319,500,000.00	39.59	-	-	4,915,997.53	25.81	-
华鑫证券	1	352,427,400.04	1.67	-	-	130,700,000.00	3.92	-	-	320,849.81	1.68	-

注：我公司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：安信证券 31551；安信证券 395965。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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司旗下基金 2014 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 01 月 05 日
2	富国基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 01 月 10 日
2	富国天源平衡混合型证券投资基金二〇一四年度收益分配公告	中国证券报	2015 年 01 月 15 日
3	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 01 月 31 日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 03 月 24 日
5	关于在京东电商平台开通富国基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 06 月 24 日
6	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 06 月 30 日
7	富国基金管理有限公司旗下基金 2015 年 06 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告	公司网站	2015 年 07 月 01 日
8	富国基金管理有限公司关于公司及高级管理人员投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 07 月 06 日
9	富国基金管理有限公司关于开展官方京东旗舰店基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 07 月 07 日

		券日报	
10	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 07 月 10 日
11	富国基金管理有限公司关于开展京东官方旗舰店基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 08 月 14 日
12	富国基金管理有限公司关于中信浙江并入中信证券期间基金业务安排的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 09 月 01 日
13	关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 09 月 17 日
14	关于变更富国天源平衡混合型证券投资基金业绩比较基准并修改招募说明书的公告	中国证券报	2015 年 09 月 22 日
15	关于淘宝官方店继续进行在售基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 10 月 14 日
16	关于富国天源平衡混合型证券投资基金恢复申购、定投及转换转入业务的公告	中国证券报	2015 年 10 月 16 日
17	关于富国天源平衡混合型投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报	2015 年 10 月 27 日
18	提请广大投资者持有效身份证件办理相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 11 月 16 日
19	富国基金管理有限公司关于开展官方京东旗舰店基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 04 日
20	富国基金管理有限公司关于调整旗下	中国证券报、上海证	2015 年 12 月 09 日

	基金长期停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报	

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、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，并报中国证券监督管理委员会备案，决定自 2015 年 10 月 1 日起，变更本基金的业绩比较基准，并修改本基金招募说明书相应条款。上述变更事项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。 2、本报告期内，本基金自 2015 年 9 月 24 日至 2015 年 10 月 23 日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》。本次会议决议于 2015 年 10 月 26 日起生效，会议结果已报中国证券监督管理委员会备案。本次持有人大会决议生效后，根据本次会议通过的议案及《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书》，自 2015 年 10 月 27 日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效，具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

§13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金的文件 2、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同 3、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金财	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址：http://www.fullgoal.com.cn

务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		