

富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

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：招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。

基金托管人招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

基金简称	富国沪港深价值精选灵活配置混合
基金主代码	001371
交易代码	前端交易代码：001371 后端交易代码：001372
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年06月24日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,544,593,731.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于质地优良、估值合理的上市公司股票，通过精选个股和严格风险控制，追求基金长期资产增值，并争取实现超越业绩比较基准的收益。
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	沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中债综合财富指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	范伟隽	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95555	
传真	021-20361616	0755-83195201	

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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商 银行大厦

§ 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 6 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	65,221,028.19	-18,782,876.92
本期利润	175,598,680.41	-16,304,674.05
加权平均基金份额本期利润	0.0840	-0.0182
本期基金份额净值增长率	2.63%	-1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-0.0089	-0.0192
期末基金资产净值	2,585,784,893.22	720,841,930.18
期末基金份额净值	1.016	0.990

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 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	-1.65%	0.80%	-1.87%	0.64%	0.22%	0.16%

过去六个月	8.43%	0.80%	5.00%	0.65%	3.43%	0.15%
过去一年	2.63%	0.92%	-4.35%	1.01%	6.98%	-0.09%
自基金合同生效日起至今	1.60%	0.88%	-21.42%	1.33%	23.02%	-0.45%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中债综合财富指数收益率×10%。

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。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

中债综合财富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。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 45\% * [\text{沪深 300 指数}_t / (\text{沪深 300 指数}_{t-1}) - 1] + 45\% * [\text{恒生指数}_t / (\text{恒生指数}_{t-1}) - 1] + 10\% * [\text{中债综合财富指数}_t / (\text{中债综合财富指数}_{t-1}) - 1];$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

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

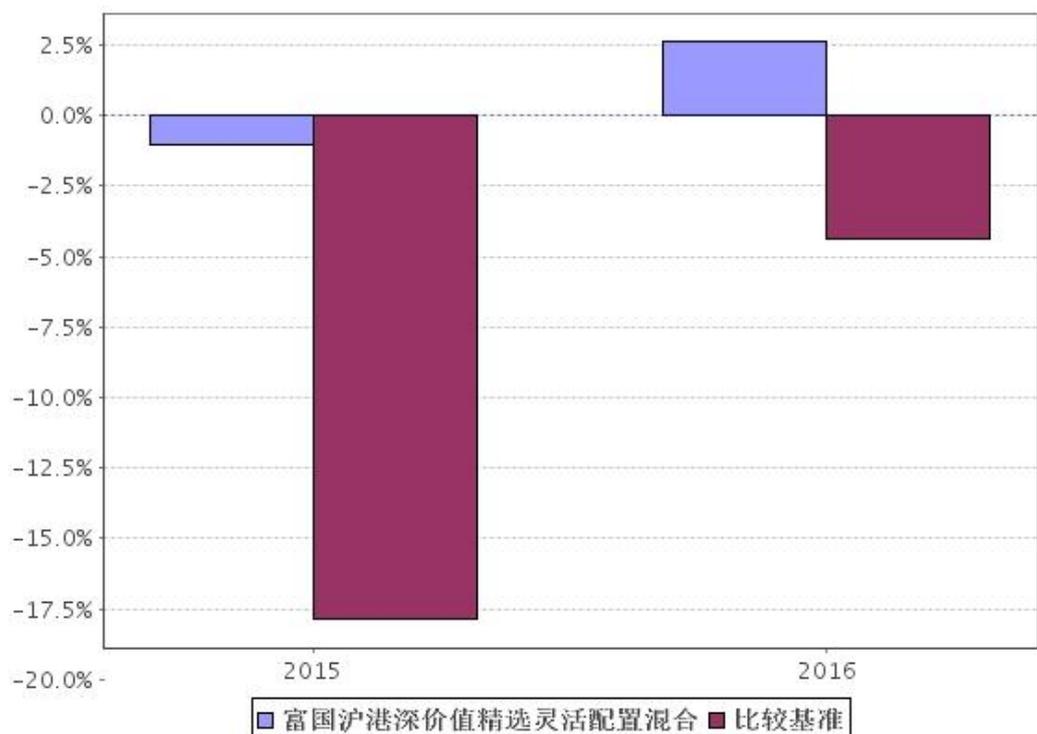
其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 (1+benchmark_t) 数学连乘。

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2016年12月31日。
 2、本基金于2015年6月24日成立，建仓期6个月，从2015年6月24日起至2015年12月23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：2015 年按实际存续期计算。

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
2016年	—	—	—	—	—
2015年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注：本基金 2015 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 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		
汪孟海	本基金基金经理	2015-10-09	—	7	博士，自 2010 年 6 月至 2014 年 8 月在中国人保资产管理股份有限公司任银行/外汇业务部研究员；自 2014 年 8 月加入富国基金管理有限公司，2014 年 8 月至 2015 年 10 月任 QDII 基金经理助理，2015 年 10 月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
张峰	本基金基金经理兼任海外权益投资部总经理、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国中	2015-06-24	—	15	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券股票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自 2009 年 7 月至 2011 年 4 月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，2011 年 4 月至 2012 年 12 月任富国全球债券证券投资基金基金经理，自 2011 年 7 月起任富国全球顶级消费品混合型证券投资基金基金经理，

	国中小盘 (香港上市) 混合型 证券投资 基金基金 经理			自 2012 年 9 月起任富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金基金经理,自 2015 年 6 月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任海外权益投资部总经理。具有基金从业资格。
--	---	--	--	--

注: 1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国沪港深价值精选灵活配置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》、《富国沪港深价值精选灵活配置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1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

2016年对于全球资本市场来讲都是不平静的一年。人民币汇率，美联储加息，英国脱欧，美国大选等诸多因素影响市场。全年来看，恒生指数实现0.4%的正收益，沪深300指数下跌11.3%，虽然香港市场的表现优于A股，但同样是大幅震荡，获益较弱的一年。

操作上来讲，本基金在年初一月份市场大幅下挫期间，适当控制了仓位和结构，并且在2~3月份逐步加仓，加仓的结构以估值合理的优质成长股，股息率稳定的高息股，以及不受人民币贬值因素影响的香港资产股和出口导向股为主。6月份随着英国脱欧靴子落地，市场憧憬美国加息进程放缓，沪港通资金大幅流入，恒生指数开始攀升，本基金由于大额申购使得仓位被动摊薄原因，在7~8月份略微落后恒生指数，但仍然大幅跑赢比较基准。4季度，鉴于美国国债收益率上行，本基金做了适当切换，增加了金融保险等行业的配置，降低了公共事业，房地产等行业的配置。全年来看，本基金在行业配置，个股选择方面，均有不错的表现。不足之处在于没有把握到大宗商品相关个股的牛市行情。

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1.016元；份额累计净值为1.016元；本报告期，本基金份额净值增长率为2.63%，同期业绩比较基准收益率为-4.35%。

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，中国经济已经回暖，这从宏观基本面的角度给香港和A股资本市场以支撑。流动性可能会有略微的收缩，但当前恒生指数的估值也处于历史上较低的水平，已经基本反映了流动性的预期。2017年当然也有一些不确定因素，例如特朗普政策的不确定性，美联储加息进程，法国德国大选等，但是在下行空间有限的情况下，我们认为2017年资本市场更有可能出现震荡走高的行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

招商银行股份有限公司

2017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：富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

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)
资产：		
银行存款	557,462,832.79	132,493,558.05
结算备付金	92,846,163.19	6,503,795.45
存出保证金	97,024.07	105,637.46
交易性金融资产	2,226,280,955.08	584,311,748.05
其中：股票投资	2,224,848,034.28	584,311,748.05
基金投资	—	—
债券投资	1,432,920.80	—
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	17,359,405.13	8,536,587.70
应收利息	112,045.92	31,111.18
应收股利	81,600.00	29,589.86
应收申购款	171,052.91	524,473.99
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,894,411,079.09	732,536,501.74
负债和所有者权益	本期末 (2016年12月31日)	上年度末 (2015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	1.39	7,369,282.62
应付赎回款	302,416,307.54	2,900,590.54
应付管理人报酬	3,644,116.46	931,716.79

应付托管费	607,352.74	155,286.12
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,276,470.08	256,903.39
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	681,937.66	80,792.10
负债合计	308,626,185.87	11,694,571.56
所有者权益：		
实收基金	2,544,593,731.56	727,984,600.34
未分配利润	41,191,161.66	-7,142,670.16
所有者权益合计	2,585,784,893.22	720,841,930.18
负债和所有者权益总计	2,894,411,079.09	732,536,501.74

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.016 元，基金份额总额 2,544,593,731.56 份。

7.2 利润表

会计主体：富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

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 6 月 24 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日)
一、收入	221,343,572.83	-6,370,494.43
1. 利息收入	3,683,036.36	1,937,602.49
其中：存款利息收入	3,414,746.66	1,937,602.49
债券利息收入	1,860.80	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	266,428.90	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	101,951,434.72	-11,693,395.94
其中：股票投资收益	54,409,006.06	-12,812,963.07
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
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	—	25,475.22
股利收益	47,542,428.66	1,094,091.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	110,377,652.22	2,478,202.87

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,331,449.53	907,096.15
减：二、费用	45,744,892.42	9,934,179.62
1. 管理人报酬	30,456,591.45	6,845,320.50
2. 托管费	5,076,098.55	1,140,886.77
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	9,924,590.21	1,752,978.53
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	287,612.21	194,993.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	175,598,680.41	-16,304,674.05
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	175,598,680.41	-16,304,674.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

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）	727,984,600.34	-7,142,670.16	720,841,930.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	175,598,680.41	175,598,680.41
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）	1,816,609,131.22	-127,264,848.59	1,689,344,282.63
其中：1. 基金申购款	3,769,409,203.32	-76,944,950.71	3,692,464,252.61
2. 基金赎回款	-1,952,800,072.10	-50,319,897.88	-2,003,119,969.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	2,544,593,731.56	41,191,161.66	2,585,784,893.22
项目	上年度可比期间(2015年6月24日(基金合同生效日) 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）	1,029,199,705.41	—	1,029,199,705.41
二、本期经营活动产生的基金净值	—	-16,304,674.05	-16,304,674.05

变动数（本期利润）			
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）	-301,215,105.07	9,162,003.89	-292,053,101.18
其中：1. 基金申购款	9,088,440.74	-167,773.18	8,920,667.56
2. 基金赎回款	-310,303,545.81	9,329,777.07	-300,973,768.74
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）	727,984,600.34	-7,142,670.16	720,841,930.18

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、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	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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6月24日(基金合同生效日)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(%)
申万宏源	34,420,072.74	0.58	10,971,783.12	0.97

7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.4 回购交易

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回购交易。

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(2016年01月01日至2016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	31,366.95	0.98	12,902.50	1.01
关联方名称	上年度可比期间(2015年6月24日(基金合同生效日)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	9,998.68	1.39	9,998.68	3.89

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6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	30,456,591.45	6,845,320.50
其中：支付销售机构的客户维护费	4,670,325.59	3,692,020.58

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2 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6 月24日(基金合同生效日) 至2015年12月31日)
当期发生的基金应支付的 托管费	5,076,098.55	1,140,886.77

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本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6月24日(基金 合同生效日)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
招商银行股份有限公司	557,462,832.79	2,865,823.33	132,493,558.05	1,877,325.40

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

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股认购	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	—
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股认购	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	—
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股认购	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	—
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股认购	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	—
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股认购	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	—
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股认购	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	—
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股认购	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	—
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股认购	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	—
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股认购	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	—
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股认购	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	—
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股认购	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	—

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，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 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 2,225,940,507.82 元，属于第二层次

的余额为人民币 340,447.26 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 576,090,893.05 元，属于第二层次的余额为人民币 8,220,855.00 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	2,224,848,034.28	76.87
	其中：股票	2,224,848,034.28	76.87
2	固定收益投资	1,432,920.80	0.05
	其中：债券	1,432,920.80	0.05
	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	650,308,995.98	22.47
7	其他各项资产	17,821,128.03	0.62
8	合计	2,894,411,079.09	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 2,059,337,387.00 元，占资产净值比例 79.64%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 6,448,070.00 元，占资产净值比例 0.25%。

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	135,621,636.51	5.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.01
J	金融业	23,136,280.00	0.89
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	159,062,577.28	6.15

8.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
医疗保健	199,016,097.00	7.70
房地产	17,301,300.00	0.67
金融	617,240,720.00	23.87
原材料	3,974,400.00	0.15
信息技术	339,964,080.00	13.15
能源	49,325,000.00	1.91
非日常生活消费品	294,957,580.00	11.41
日常消费品	46,118,620.00	1.78
工业	224,752,660.00	8.69
公用事业	107,111,500.00	4.14
电信业务	166,023,500.00	6.42
合计	2,065,785,457.00	79.89

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	700HK	腾讯控股	1,290,000	218,900,100.00	8.47
2	941HK	中国移动	1,550,000	113,971,500.00	4.41
3	3988HK	中国银行	33,700,000	103,796,000.00	4.01
4	5HK	汇丰控股	1,550,000	86,304,000.00	3.34
5	1093HK	石药集团	10,700,000	79,287,000.00	3.07
6	3311HK	中国建筑国际	6,692,000	69,462,960.00	2.69
7	2313HK	申洲国际	1,516,000	66,522,080.00	2.57
8	388HK	香港交易所	350,000	57,354,500.00	2.22
9	2318HK	中国平安	882,500	30,631,575.00	1.18
10	601318	中国平安	650,000	23,029,500.00	0.89

注：中国平安同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

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

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 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	700HK	腾讯控股	211,488,714.54	29.34
2	941HK	中国移动	157,942,380.77	21.91
3	1299HK	友邦保险	150,399,764.98	20.86
4	3988HK	中国银行	127,369,679.12	17.67
5	388HK	香港交易所	124,913,816.22	17.33
6	939HK	建设银行	124,283,332.73	17.24
7	1398HK	工商银行	109,092,697.98	15.13
8	5HK	汇丰控股	88,005,885.95	12.21
9	3888HK	金山软件	85,602,002.52	11.88
10	2382HK	舜宇光学科技	70,309,429.73	9.75
11	1336HK	新华保险	66,398,208.77	9.21
12	3311HK	中国建筑国际	59,686,541.62	8.28
13	2388HK	中银香港	58,174,360.47	8.07
14	175HK	吉利汽车	57,005,398.92	7.91
15	1093HK	石药集团	55,171,520.57	7.65
16	2313HK	申洲国际	53,189,002.94	7.38
17	2018HK	瑞声科技	52,386,387.40	7.27
18	1128HK	永利澳门	52,008,121.04	7.21

19	2628HK	中国人寿	48,326,672.67	6.70
20	27HK	银河娱乐	46,772,847.43	6.49
21	2601HK	中国太保	46,171,259.25	6.41
22	371HK	北控水务集团	41,282,152.62	5.73
23	386HK	中国石油化工股份	41,204,861.54	5.72
24	1800HK	中国交通建设	40,562,467.70	5.63
25	270HK	粤海投资	40,553,617.62	5.63
26	762HK	中国联通	40,432,096.07	5.61
27	177HK	江苏宁沪高速公路	39,611,833.62	5.50
28	1999HK	敏华控股	38,535,941.51	5.35
29	425HK	敏实集团	37,698,889.40	5.23
30	1186HK	中国铁建	36,949,613.24	5.13
31	6881HK	中国银河	36,444,526.90	5.06
32	2318HK	中国平安	35,584,310.95	4.94
33	6886HK	华泰证券	34,418,767.94	4.77
34	601318	中国平安	34,063,889.02	4.73
35	570HK	中国中药	32,965,558.47	4.57
36	867HK	康哲药业	32,946,580.31	4.57
37	688HK	中国海外发展	32,592,775.50	4.52
38	338HK	上海石油化工股份	30,999,115.13	4.30
39	1109HK	华润置地	30,729,445.81	4.26
40	000581	威孚高科	30,015,239.62	4.16
41	728HK	中国电信	29,734,977.98	4.13
42	1177HK	中国生物制药	29,413,713.06	4.08
43	2186HK	绿叶制药	29,388,969.75	4.08
44	600887	伊利股份	29,350,365.00	4.07
45	1038HK	长江基建集团	28,698,114.18	3.98
46	257HK	中国光大国际	28,620,636.30	3.97
47	2238HK	广汽集团	28,563,751.96	3.96
48	1928HK	金沙中国有限公司	28,418,132.25	3.94
49	1112HK	合生元	28,355,111.63	3.93
50	902HK	华能国际电力股份	28,180,898.10	3.91
51	1071HK	华电国际电力股份	27,964,297.42	3.88
52	66HK	港铁公司	27,171,523.62	3.77
53	874HK	白云山	25,309,215.33	3.51

54	1099HK	国药控股	25,159,054.59	3.49
55	2HK	中电控股	23,965,007.48	3.32
56	600019	宝钢股份	23,523,869.00	3.26
57	1113HK	长实地产	22,613,861.02	3.14
58	1359HK	中国信达	22,344,743.98	3.10
59	1288HK	农业银行	22,268,456.36	3.09
60	165HK	中国光大控股	22,012,523.62	3.05
61	16HK	新鸿基地产	21,751,693.87	3.02
62	600519	贵州茅台	20,647,006.00	2.86
63	2328HK	中国财险	20,281,493.18	2.81
64	1618HK	中国中冶	19,975,010.95	2.77
65	966HK	中国太平	19,896,423.62	2.76
66	548HK	深圳高速公路股份	18,739,092.70	2.60
67	1316HK	耐世特	17,591,446.95	2.44
68	861HK	神州控股	17,262,368.63	2.39
69	3908HK	中金公司	16,701,369.19	2.32
70	6HK	电能实业	16,635,100.29	2.31
71	1788HK	国泰君安国际	16,593,513.21	2.30
72	600585	海螺水泥	16,527,699.59	2.29
73	152HK	深圳国际	16,268,855.47	2.26
74	489HK	东风集团股份	16,205,080.91	2.25
75	000333	美的集团	14,993,091.33	2.08
76	3328HK	交通银行	14,528,618.94	2.02

8.5.2 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	1299HK	友邦保险	119,340,338.88	16.56
2	939HK	建设银行	109,531,416.97	15.19
3	1398HK	工商银行	88,438,194.91	12.27
4	388HK	香港交易所	85,519,834.87	11.86
5	3888HK	金山软件	58,340,887.59	8.09
6	1336HK	新华保险	52,688,721.50	7.31
7	2601HK	中国太保	52,685,393.81	7.31
8	941HK	中国移动	41,784,477.96	5.80
9	1186HK	中国铁建	41,537,096.81	5.76
10	3988HK	中国银行	40,019,458.88	5.55
11	688HK	中国海外发展	38,116,220.65	5.29
12	175HK	吉利汽车	38,033,851.04	5.28

13	338HK	上海石油化工股份	35,482,854.53	4.92
14	1800HK	中国交通建设	34,123,634.12	4.73
15	700HK	腾讯控股	32,958,185.99	4.57
16	165HK	中国光大控股	32,791,923.41	4.55
17	2388HK	中银香港	32,779,573.96	4.55
18	2238HK	广汽集团	32,497,641.78	4.51
19	570HK	中国中药	30,289,316.64	4.20
20	270HK	粤海投资	30,131,309.66	4.18
21	177HK	江苏宁沪高速公路	29,179,196.24	4.05
22	966HK	中国太平	29,168,291.08	4.05
23	66HK	港铁公司	28,791,721.89	3.99
24	1128HK	永利澳门	27,921,847.64	3.87
25	6881HK	中国银河	27,247,234.34	3.78
26	1038HK	长江基建集团	26,957,573.81	3.74
27	601318	中国平安	26,224,782.83	3.64
28	600019	宝钢股份	25,089,981.43	3.48
29	2HK	中电控股	24,234,393.24	3.36
30	1113HK	长实地产	23,977,021.21	3.33
31	3606HK	福耀玻璃	23,296,269.45	3.23
32	1177HK	中国生物制药	22,537,189.01	3.13
33	1288HK	农业银行	22,008,109.71	3.05
34	27HK	银河娱乐	21,490,139.14	2.98
35	5HK	汇丰控股	21,393,526.87	2.97
36	1316HK	耐世特	21,189,832.64	2.94
37	3618HK	重庆农村商业银行	21,114,167.66	2.93
38	3311HK	中国建筑国际	20,854,326.46	2.89
39	600660	福耀玻璃	20,447,263.44	2.84
40	1109HK	华润置地	19,719,871.18	2.74
41	2328HK	中国财险	19,309,633.50	2.68
42	16HK	新鸿基地产	18,638,117.88	2.59
43	371HK	北控水务集团	17,795,668.85	2.47
44	2382HK	舜宇光学科技	17,242,283.86	2.39

45	3328HK	交通银行	17,192,391.01	2.39
46	1099HK	国药控股	16,850,548.16	2.34
47	6886HK	华泰证券	16,727,719.91	2.32
48	600585	海螺水泥	16,717,617.33	2.32
49	6HK	电能实业	16,565,925.32	2.30
50	1788HK	国泰君安国际	16,308,982.16	2.26
51	3908HK	中金公司	16,269,393.03	2.26
52	806HK	惠理集团	16,029,018.17	2.22
53	152HK	深圳国际	15,698,905.02	2.18
54	489HK	东风集团股份	15,610,855.61	2.17
55	2186HK	绿叶制药	15,386,160.25	2.13
56	600900	长江电力	15,382,307.21	2.13
57	762HK	中国联通	15,282,365.29	2.12
58	861HK	神州控股	15,055,975.13	2.09
59	1999HK	敏华控股	15,005,155.76	2.08

8.5.3 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	3,726,399,911.05
卖出股票收入（成交）总额	2,250,451,362.30

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。

8.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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）	1,432,920.80	0.06
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,432,920.80	0.06

8.7 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	113009	广汽转债	12,340	1,432,920.80	0.06

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	97,024.07
2	应收证券清算款	17,359,405.13
3	应收股利	81,600.00
4	应收利息	112,045.92
5	应收申购款	171,052.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	17,821,128.03

8.13.4 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	113009	广汽转债	1,432,920.80	0.06

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.13.6 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	持有人结构
----------	------	-------

	的基金份额	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 (%)
12,521	203,226.08	2,076,394,281.99	81.60	468,199,449.57	18.40

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	872,475.80	0.0343

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
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(2015年06月24日)基金份额总额	1,029,199,705.41
报告期期初基金份额总额	727,984,600.34
本报告期基金总申购份额	3,769,409,203.32
减：本报告期基金总赎回份额	1,952,800,072.10
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,544,593,731.56

§ 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 8 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 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国金证券	2	5,508,248,574.57	92.58	—	—	175,000,000.00	24.48	—	—	2,798,290.45	87.30	—
国泰君安	1	8,636,347.32	0.15	—	—	—	—	—	—	8,043.22	0.25	—
恒泰证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	2	16,372,343.59	0.28	—	—	—	—	—	—	15,247.50	0.48	—
申万宏源	1	34,420,072.74	0.58	—	—	—	—	—	—	31,366.95	0.98	—
中金公司	1	32,250,806.34	0.54	—	—	—	—	—	—	30,035.46	0.94	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	1	25,190,280.52	0.42	—	—	—	—	—	—	23,459.71	0.73	—
中信山东	2	56,918,640.45	0.96	—	—	—	—	—	—	52,588.37	1.64	—
中信证券	2	260,305,111.72	4.38	—	—	540,000,000.00	75.52	—	—	239,513.27	7.47	—
中银国际	1	7,179,598.31	0.12	—	—	—	—	—	—	6,686.30	0.21	—

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：恒泰证券 37374；恒泰证券 002246。其余租用券商交易单元未发生变动。

