

富国新回报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：中国银行股份有限公司

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	富国新回报灵活配置混合		
基金主代码	000841		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年11月26日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	135,051,600.06份		
基金合同存续期	不定期		
下属两级基金的基金简称	富国新回报灵活配置混合 A/B	富国新回报灵活配置混合 C	
下属两级基金的交易代码	前端	后端	000843
	000841	000842	
报告期末下属两级基金的份额总额	130,661,628.53份	4,389,971.53份	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+1%。
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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	王永民
	联系电话	021-20361818	010-66594896
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942

## 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楼 托管人住所

## § 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

#### (1) 富国新回报灵活配置混合 A/B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 11 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-368,561.47	126,016,435.38	5,640,553.11
本期利润	-2,403,808.05	136,919,321.90	9,907,132.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0168	0.1095	0.0152
本期基金份额净值增长率	-1.73%	7.98%	1.50%
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	0.0770	0.0956	0.0087
期末基金资产净值	140,720,793.65	150,878,699.06	660,968,165.30
期末基金份额净值	1.077	1.096	1.015

#### (2) 富国新回报灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 11 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-539,832.30	152,319,212.69	1,527,656.79
本期利润	-511,643.25	135,708,326.68	2,750,801.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0280	0.0856	0.0147
本期基金份额净值增长率	-2.19%	7.88%	1.50%
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	0.0705	0.0946	0.0082
期末基金资产净值	4,699,511.54	31,352,553.04	189,492,976.08

期末基金份额净值	1.071	1.095	1.015
----------	-------	-------	-------

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

##### (1) 富国新回报灵活配置混合 A/B

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	-0.55%	0.20%	0.63%	0.01%	-1.18%	0.19%
过去六个月	-0.28%	0.15%	1.26%	0.01%	-1.54%	0.14%
过去一年	-1.73%	0.14%	2.50%	0.01%	-4.23%	0.13%
自成立以来	7.70%	0.12%	5.99%	0.01%	1.71%	0.11%

##### (2) 富国新回报灵活配置混合 C

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	-0.56%	0.20%	0.63%	0.01%	-1.19%	0.19%
过去六个月	-0.46%	0.15%	1.26%	0.01%	-1.72%	0.14%
过去一年	-2.19%	0.14%	2.50%	0.01%	-4.69%	0.13%
自成立以来	7.10%	0.12%	5.99%	0.01%	1.11%	0.11%

注：本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+1%。

本基金的投资目标旨在为持有人提供高于定期存款的稳定增值回报，从过往历史数据看，“1 年期人民币定期存款基准利率+1.00%”绝大部分时间都能战胜通货膨胀，市场上同类基金也多采用类似的业绩比较基准。综合本基金的投资目标和市场情况，本基金的业绩比较基准定为“1 年期人民币定期存款基准利率+1.00%”。

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

$$\text{benchmark}_t = \text{同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）} / 360 + 1\% / 360;$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

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

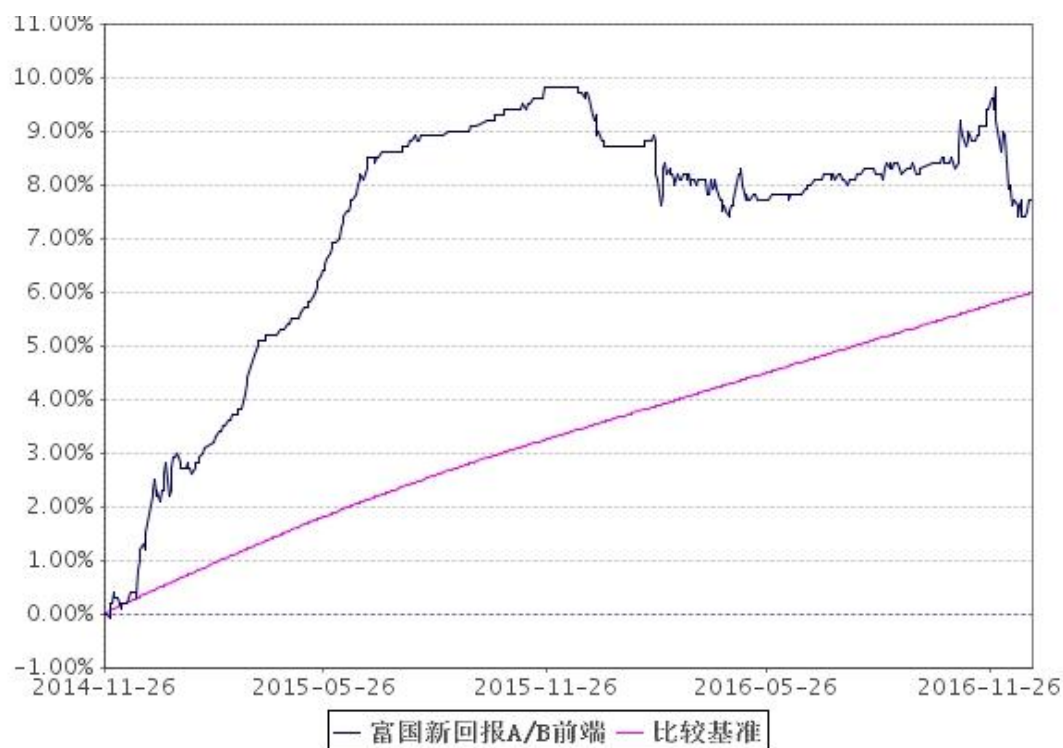
$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

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

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

(1) 自基金合同生效以来富国新回报灵活配置混合 A/B 基金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2014年11月26日成立，建仓期6个月，从2014年11月26日起至2015年5月25日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国新回报灵活配置混合 C 基金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

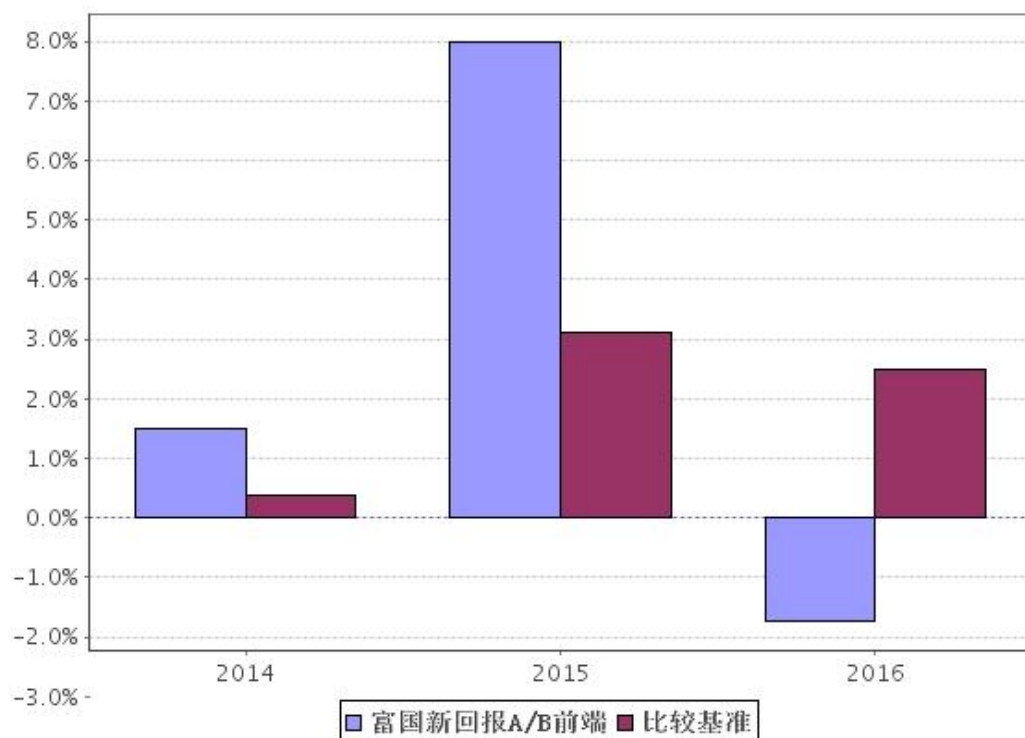


注：1、截止日期为2016年12月31日。

2、本基金于2014年11月26日成立，建仓期6个月，从2014年11月26日起至2015年5月25日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

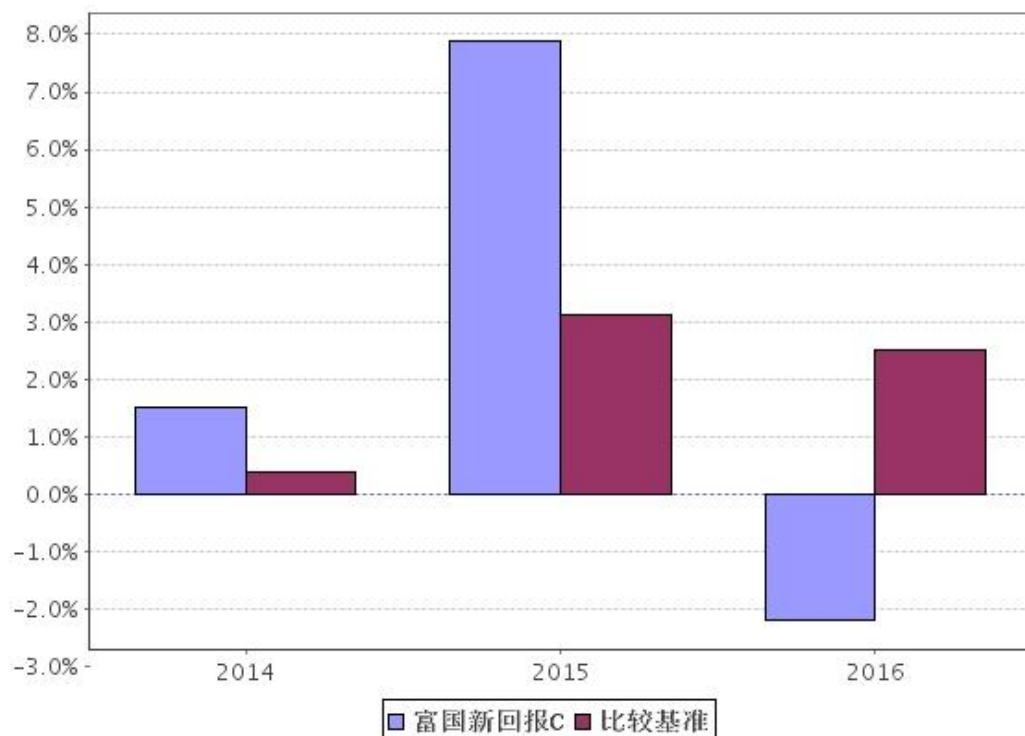
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国新回报灵活配置混合 A/B 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2014 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国新回报灵活配置混合 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2014 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国新回报灵活配置混合 A/B

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	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注：本基金 2014 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

## (2) 富国新回报灵活配置混合 C

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	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注：本基金 2014 年 11 月 26 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		
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、富国天盈债券型	2014-11-26	—	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

	证券投资基金（LOF）、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、富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理				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。
钟智伦	本基金基金经理兼固定收益投资部总经理、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国两	2016-12-13	—	23	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2009年3月任富国天时货币市场基金基金经理；2008年10月至今任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；2015年3月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2015年5月起任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月起任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；兼任固定收益投资部总经理。具有基金从业资格。

	年期理财 债券型证 券投资基 金基金经 理				
--	-----------------------------------	--	--	--	--

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》、《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合规守信情况的说明

公司于2016年6月6日收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《关于对张钊采取出具警示函措施的决定》，就未审慎对待2015年11月遭遇的巨额赎回申请，且确认巨额赎回后，本基金持有“15山水SCP001”单一债券市值持续超过资产净值10%的事宜，对基金经理张钊采取出具警示函的行政监管措施。

除上述情况外，本报告期，富国基金管理有限公司作为富国新回报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》、《富国新回报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，债券市场走势跌宕起伏，年初国内经济出现改善迹象，通胀预期回升，债券市场振荡调整，二季度一致预期从企稳回升变成了“L形态”，5月之后在配置需求的推动下，收益率水平和信用利差回到历史低位，但四季度货币政策从之前的偏宽松转为实际偏紧，加上PPI加速转正和外围市场影响，在多重因素夹击下债券市场出现激烈调整，收益率急剧上升。股票市场在1月大幅下跌之后走势平稳，波动率较上年显著下降。

本基金的投资目标是在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。报告期内本基金的主要投资策略是配置固定收益类资产以逐步累积风险垫，在可承担的风险限额内适度配置股票资产，并积极参与新股申购。今年年初，权益类资产波动剧烈，股票资产配置风险加剧，上半年净值回撤明显，之后管理人对基金的资产配置进行了动态的调整，严格按照风险承受能力控制股票资产仓位，基金净值平稳增长。四季度，由于新股申购的市值要求显著提升，本基金亦相应提高了股票资产的配置比例，基金净值的波动较前期显著提升，12月净值回撤较大。

#### **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A/B级为1.077元，C级为1.071元；份额累计净值A/B级为1.077元，C级为1.071元；本报告期，本基金份额净值增长率A/B级为-1.73%，C级为-2.19%，同期业绩比较基准收益率A/B级为2.5%，C级为2.5%

#### **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，国内外不确定因素增加，预计债券市场在收益率波动提升的过程中重新定位新的收益率中枢水平和各种利差水平。债券收益率水平上升有利于本基金风险垫的积累，从而更好地实现基金的投资目标。

管理人将严格围绕本基金的投资目标对基金资产进行投资管理，大部分基金资产仍会配置固定收益类资产，进一步累积风险垫，同时积极参与新股申购，并在可承担的风险额度内适度配置股票资产，努力为基金持有人获取相对稳定的投资回报。

#### **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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国新回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了

认真地复核，截至 2016 年 4 季度末，富国新回报灵活配置混合型证券投资基金仍持有 15 山水 SCP001，且投资比例超过了本基金 4 季度末资产净值的 10%。上述情况我中心及时履行了必要的提示义务。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：富国新回报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)
<b>资产：</b>		
银行存款	1,788,875.49	36,997,122.53
结算备付金	671,967.02	352,564.49
存出保证金	30,162.56	282,905.51
交易性金融资产	53,050,159.00	57,051,803.17
其中：股票投资	33,017,165.00	6,893,700.00
基金投资	—	—
债券投资	20,032,994.00	50,158,103.17
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	—	—
应收利息	359,622.70	413,557.09
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	90,000,000.00	92,736,885.25
资产总计	145,900,786.77	187,834,838.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

	(2016年12月31日)	(2015年12月31日)
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	1,337,841.68
应付赎回款	167,011.35	3,837,373.17
应付管理人报酬	74,905.19	104,678.52
应付托管费	24,968.39	34,892.82
应付销售服务费	2,180.72	17,443.64
应付交易费用	91,353.39	178,734.11
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	120,062.54	92,622.00
负债合计	480,481.58	5,603,585.94
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	135,051,600.06	166,245,922.41
未分配利润	10,368,705.13	15,985,329.69
所有者权益合计	145,420,305.19	182,231,252.10
负债和所有者权益总计	145,900,786.77	187,834,838.04

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.077 元，基金份额总额 135,051,600.06 份。其中：富国新回报灵活配置混合 A/B 级份额净值 1.077 元，份额总额 130,661,628.53 份；富国新回报灵活配置混合 C 级份额净值 1.071 元，份额总额 4,389,971.53 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国新回报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01月01日至 2015年12月31日)
<b>一、收入</b>	-631,597.99	307,824,736.82
1. 利息收入	1,398,489.42	75,221,850.83
其中：存款利息收入	244,860.85	43,618,341.06
债券利息收入	1,032,662.95	21,743,286.57
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	120,965.62	9,860,223.20



其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-56,179.55	226,514,731.63
其中：股票投资收益	-219,992.43	192,927,662.29
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-17,495.12	33,406,369.34
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	181,308.00	180,700.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,007,057.53	-5,707,999.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	33,149.67	11,796,153.85
<b>减：二、费用</b>	<b>2,283,853.31</b>	<b>35,197,088.24</b>
1. 管理人报酬	1,047,999.76	17,997,584.56
2. 托管费	349,333.22	5,999,194.85
3. 销售服务费	99,698.01	8,416,146.12
4. 交易费用	555,085.85	1,077,904.77
5. 利息支出	—	1,341,750.33
其中：卖出回购金融资产支出	—	1,341,750.33
6. 其他费用	231,736.47	364,507.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-2,915,451.30</b>	<b>272,627,648.58</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-2,915,451.30</b>	<b>272,627,648.58</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国新回报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）	166,245,922.41	15,985,329.69	182,231,252.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-2,915,451.30	-2,915,451.30
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）	-31,194,322.35	-2,701,173.26	-33,895,495.61
其中：1. 基金申购款	83,281,963.13	6,745,839.03	90,027,802.16
2. 基金赎回款	-114,476,285.48	-9,447,012.29	-123,923,297.77

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）	135,051,600.06	10,368,705.13	145,420,305.19
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）	837,803,207.34	12,657,934.04	850,461,141.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	272,627,648.58	272,627,648.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-671,557,284.93	-269,300,252.93	-940,857,537.86
其中：1. 基金申购款	6,316,202,078.21	271,765,973.97	6,587,968,052.18
2. 基金赎回款	-6,987,759,363.14	-541,066,226.90	-7,528,825,590.04
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）	166,245,922.41	15,985,329.69	182,231,252.10

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

基金管理人负责人

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
中国银行股份有限公司	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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 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

注：本基金本报告期没有应支付的关联方佣金。

##### 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	1,047,999.76	17,997,584.56
其中：支付销售机构的客户维护费	299,990.31	2,500,762.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

###### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（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	349,333.22	5,999,194.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

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。

#### 7.4.4.2.3 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		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	3,425.29	3,425.29
申万宏源	—	134.08	134.08
海通证券	—	3.50	3.50
中国银行	—	7,384.59	7,384.59
合计	—	10,947.46	10,947.46

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		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	7,987,865.72	7,987,865.72
申万宏源	—	185.43	185.43
海通证券	—	1,052.97	1,052.97
中国银行	—	108,394.52	108,394.52
合计	—	8,097,498.64	8,097,498.64

注：本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费率为年费率 0.5%。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（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）	
	富国新回报灵活配置混合 A/B	富国新回报灵活配置混合 C	富国新回报灵活配置混合 A/B	富国新回报灵活配置混合 C

基金合同生效日(2014年11月26日)持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	83,255,319.15	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减:期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	83,255,319.15	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	63.72%	—	—	—

注:本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行,不存在费率优惠的情况。

#### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期(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
中国银行股份有限公司	1,788,875.49	231,657.45	36,997,122.53	4,865,142.89

#### 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，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 33,028,777.00 元，属于第二层次的余额为人民币 20,021,382.00 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 6,893,700.00 元，属于第二层次的余额为人民币 50,158,103.17 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	33,017,165.00	22.63
	其中：股票	33,017,165.00	22.63
2	固定收益投资	20,032,994.00	13.73
	其中：债券	20,032,994.00	13.73
	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	2,460,842.51	1.69
7	其他各项资产	90,389,785.26	61.95
8	合计	145,900,786.77	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	—	—
B	采矿业	9,964,000.00	6.85
C	制造业	10,758,160.00	7.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,021,800.00	1.39
F	批发和零售业	5,358,888.00	3.69
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	2,193,000.00	1.51
J	金融业	1,354,322.00	0.93
K	房地产业	1,366,995.00	0.94
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	33,017,165.00	22.70

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600998	九州通	226,200	4,691,388.00	3.23
2	600873	梅花生物	450,000	2,934,000.00	2.02
3	600498	烽火通信	100,000	2,521,000.00	1.73
4	600489	中金黄金	200,000	2,418,000.00	1.66
5	600804	鹏博士	100,000	2,193,000.00	1.51
6	600547	山东黄金	60,000	2,190,600.00	1.51
7	600497	驰宏锌锗	300,000	2,109,000.00	1.45
8	600068	葛洲坝	220,000	2,021,800.00	1.39
9	600188	兖州煤业	150,000	1,629,000.00	1.12
10	600616	金枫酒业	119,200	1,466,160.00	1.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000728	国元证券	8,915,706.58	4.89
2	000423	东阿阿胶	6,675,843.00	3.66
3	600547	山东黄金	6,539,206.00	3.59
4	600489	中金黄金	6,346,635.33	3.48
5	000069	华侨城 A	5,040,872.00	2.77
6	600998	九州通	4,898,761.00	2.69
7	600276	恒瑞医药	4,882,504.29	2.68
8	600517	置信电气	4,406,297.92	2.42
9	600958	东方证券	4,058,569.26	2.23
10	002344	海宁皮城	4,023,908.00	2.21
11	002508	老板电器	3,951,382.84	2.17
12	600366	宁波韵升	3,945,095.48	2.16
13	600637	东方明珠	3,693,405.63	2.03
14	600219	南山铝业	3,672,750.40	2.02
15	600795	国电电力	3,583,007.00	1.97
16	600887	伊利股份	3,521,842.00	1.93
17	600497	驰宏锌锗	3,482,496.00	1.91
18	600050	中国联通	3,421,000.00	1.88
19	300261	雅本化学	3,419,015.44	1.88
20	000089	深圳机场	3,312,377.00	1.82



### 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	000728	国元证券	8,630,378.00	4.74
2	000423	东阿阿胶	6,746,666.00	3.70
3	600276	恒瑞医药	5,614,784.40	3.08
4	600887	伊利股份	5,018,465.52	2.75
5	000069	华侨城 A	4,916,286.00	2.70
6	600547	山东黄金	4,518,377.00	2.48
7	600050	中国联通	4,310,268.00	2.37
8	600517	置信电气	4,252,346.77	2.33
9	600366	宁波韵升	4,198,749.00	2.30
10	002344	海宁皮城	4,066,600.00	2.23
11	600489	中金黄金	3,954,355.82	2.17
12	002508	老板电器	3,862,579.66	2.12
13	600958	东方证券	3,767,251.32	2.07
14	600637	东方明珠	3,656,989.74	2.01
15	600795	国电电力	3,564,000.00	1.96
16	600500	中化国际	3,463,526.00	1.90
17	300261	雅本化学	3,401,645.00	1.87
18	600219	南山铝业	3,328,323.59	1.83
19	002271	东方雨虹	3,154,463.15	1.73
20	000089	深圳机场	3,150,954.90	1.73

### 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	203,383,100.95
卖出股票收入（成交）总额	175,018,109.04

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	9,987.00	0.01
2	央行票据	—	—
3	金融债券	9,990,000.00	6.87
	其中：政策性金融债	9,990,000.00	6.87
4	企业债券	—	—

5	企业短期融资券	10,010,000.00	6.88
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	23,007.00	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	20,032,994.00	13.78

## 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	041654024	16京投CP001	100,000	10,010,000.00	6.88
2	160209	16国开09	100,000	9,990,000.00	6.87
3	113009	广汽转债	100	11,612.00	0.01
4	132006	16皖新EB	100	11,395.00	0.01
5	019539	16国债11	100	9,987.00	0.01

## 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。

## 8.11 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	30,162.56
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	359,622.70
5	应收申购款	—
6	其他应收款	90,000,000.00
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	90,389,785.26

### 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	113009	广汽转债	11,612.00	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：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
富国新回报灵活 配置混合 A/B	969	134,841.72	83,304,945.24	63.76	47,356,683.29	36.24
富国新回报灵活 配置混合 C	235	18,680.73	—	—	4,389,971.53	100.00
合计	1,204	112,169.10	83,304,945.24	61.68	51,746,654.82	38.32

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富国新回报灵 活配置混合 A/B	4,730.11	0.0036
	富国新回报灵 活配置混合 C	9,149.77	0.2084
	合计	13,879.88	0.0103

### 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	份额级别	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	富国新回报灵活配 置混合 A/B	0
	富国新回报灵活配 置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国新回报灵活配 置混合 A/B	0
	富国新回报灵活配	0

	置混合 C	
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国新回报灵活配置混合 A/B	富国新回报灵活配置混合 C
基金合同生效日(2014 年 11 月 26 日)基金份额总额	651,061,032.71	186,742,174.63
报告期期初基金份额总额	137,621,947.79	28,623,974.62
本报告期基金总申购份额	83,281,963.13	—
减：本报告期基金总赎回份额	90,242,282.39	24,234,003.09
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	130,661,628.53	4,389,971.53

## § 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。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1、山东山水水泥集团有限公司（“15 山水 SCP001” 发行人）于 2015 年 11 月 12 日发布《山东山水水泥集团有限公司 2015 年度第一期超短期融资券未按期足额兑付本息的公告》，由于“15 山水 SCP001” 未能按照约定筹措足额偿债资金，“15 山水 SCP001” 不能按期足额偿付。公司作为基金管理人，代表本基金依法向上海市第一中级人民法院起诉“15 山水 SCP001” 发行人并提起财产保全申请，上海市第一中级人民法院做出一审判决后，被告公司“新任法定代表人” 提起上诉并获受理，案件进入二审程序。截止本报告期末，上海市高级人民法院已经开庭审理，但尚未做出终审判决。基金管理人将尽力维护基金份额持有人的利益，并将按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定对该诉讼的进展情况及时予以公告。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

2、本报告期无其他涉及基金管理人、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 (%)	
东方证券	2	15,653,467.81	4.14	—	—	50,000,000.00	9.57	—	—	14,264.50	4.14	—
广发证券	2	20,790,994.00	5.50	—	—	—	—	—	—	18,946.68	5.50	—
太平洋证券	2	34,012,223.70	8.99	—	—	41,700,000.00	7.98	—	—	30,995.29	8.99	—
新时代证券	2	94,232,029.44	24.91	—	—	154,500,000.00	29.56	—	—	85,872.83	24.91	—
银河证券	2	105,979,122.53	28.01	33,034.61	100.00	180,466,000.00	34.53	—	—	96,579.66	28.01	—
浙商证券	2	50,426,818.84	13.33	—	—	13,700,000.00	2.62	—	—	45,953.95	13.33	—
中金公司	2	57,220,609.98	15.13	—	—	82,300,000.00	15.75	—	—	52,145.84	15.13	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

山东山水水泥集团有限公司（“15 山水 SCP001”发行人）于 2015 年 11 月 12 日发布《山东山水水泥集团有限公司 2015 年度第一期超短期融资券未按期足额兑付本息的公告》，由于“15 山水 SCP001”未能按照约定筹措足额偿债资金，“15 山水 SCP001”不能按期足额偿付。公司作为基金管理人，代表本基金依法向上海市第一中级人民法院起诉“15 山水 SCP001”发行人并提起财产保全申请，上海市第一中级人民法院做出一审判决后，被告公司“新任法定代表人”提起上诉并获受理，案件进入二审程序。截止本报告期末，上海市高级人民法院已经开庭审理，但尚未做出终审判决。基金管理人将尽力维护基金份额持有人的利益，并将按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定对该诉讼的进展情况及时予以公告。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。