

富国天盈债券型证券投资基金(LOF)

2015 年度报告摘要

本报告期内,富国基金管理有限公司作为富国天盈债券型证券投资基金(LOF)的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天盈债券型证券投资基金合同》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,确保基金资产的稳定性和基金长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的控制方法
本基金管理人根据相关法律法规要求,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、二级市场交易的相关控制,投资决策、授权、交易执行、业绩评估等管理环节,实行事前控制、事中监控、事后分析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交易知情权、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,通过标准化的业务流程,对关联方申购、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选择库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和授权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一反向交易行为限制行为,为非特别控制流程审核同意,不得进行;对于同一方向交易,通过交易系统对组合间交易公平性进行自动化控制;2、同一基金经理管理不同组合,同一投资组合采取相同投资策略的,必须通过交易系统采取限制;3、对于下达投资指令,确保公平其所管理组合。

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(1日、3日、5日)的季节公平性交易分析评估;1、通过公平交易的事后分析评估系统,对涉及公平交易的证券行为进行分析评估,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的交易行为;若发现异常交易行为,监察稽核部须要求相关当事人做出合理解释,并按法规要求上报相关监管机构;2、季度公平性交易分析评估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
本报告期内,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、3日、5日)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分析并假设检验,并对检验结果进行分析,分析结果显示,未出现违反公平交易制度的其他投资组合间同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下各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间巨向交易的控制方面,报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2015年,债券市场延续牛市,货币政策持续宽松,作为低风险稳定收益的品种,债券在资产配置中获取青睐,全年信用利差整体压缩,信用事件局部有发生,低等级信用风险溢价抬升。2015年,本基金净值增长受益于债券市场牛市,二季度参与转债投资,净值波动有所较大。

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0.886元,份额累计净值为1.513元。报告期内,本基金份额净值增长率为9.11%,同期业绩比较基准收益率为8.15%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2016年,供给侧改革启动,无风险利率有望保持低位,但不排除资金波动、信用事件冲击、机构持仓变化等因素对债市流动性带来负面影响。本基金力争在控制风险的前提下,争取为持有人带来可持续的投资回报。

4.6 管理人对于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,并制定了《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构,由主管运营副总负责,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,所有相关人员均具有丰富的证券基金从业经验,公司估值委员会负责提供估值意见,履行估值技术、执行估值决策程序,对外信息披露等工作,保证基金估值的公允性和合理性,维护基金份额持有人的利益。基金估值委员会成员的重要职责,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,参与估值程序及估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对于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,2015年报告期末本基金未满足利润分配条件,故不进行收益分配。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 报告期内管理人对于本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
本报告期内无需要说明的相关情形。
5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,本基金托管人在对富国天盈债券型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,富国天盈债券型证券投资基金(LOF)的管理人——富国基金管理有限公司在富国天盈债券型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为;在各重要环节的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,富国天盈债券型证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国天盈债券型证券投资基金(LOF)2015年年度报告中财务信息、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 审计报告
本基金的审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。
7 年度财务报表
7.1 资产负债表
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
报告截止日:2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 资产, 负债和所有者权益. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 其他资产, 其他负债, 基金份额持有人权益, 未分配利润, 所有者权益合计.

7.2 利润表
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、营业收入, 公允价值变动收益, 投资收益, 其他收入, 二、营业利润, 三、营业外收入, 四、利润总额, 五、所得税费用, 六、净利润, 七、其他综合收益, 八、综合收益总额, 九、归属于基金份额持有人的净利润, 十、归属于基金份额持有人的其他综合收益, 十一、归属于基金份额持有人的综合收益总额.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、基金份额持有人权益, 二、本期基金份额持有人权益增加:1.申购赎回费, 2.利息收入, 3.投资收益, 4.其他收入, 5.其他综合收益, 6.其他, 三、期末基金份额持有人权益.

7.4 所有者权益(基金净值)变动表续
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、基金份额持有人权益, 二、本期基金份额持有人权益增加:1.申购赎回费, 2.利息收入, 3.投资收益, 4.其他收入, 5.其他综合收益, 6.其他, 三、期末基金份额持有人权益.

7.5 所有者权益(基金净值)变动表续
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、基金份额持有人权益, 二、本期基金份额持有人权益增加:1.申购赎回费, 2.利息收入, 3.投资收益, 4.其他收入, 5.其他综合收益, 6.其他, 三、期末基金份额持有人权益.

7.6 所有者权益(基金净值)变动表续
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、基金份额持有人权益, 二、本期基金份额持有人权益增加:1.申购赎回费, 2.利息收入, 3.投资收益, 4.其他收入, 5.其他综合收益, 6.其他, 三、期末基金份额持有人权益.

7.7 所有者权益(基金净值)变动表续
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、基金份额持有人权益, 二、本期基金份额持有人权益增加:1.申购赎回费, 2.利息收入, 3.投资收益, 4.其他收入, 5.其他综合收益, 6.其他, 三、期末基金份额持有人权益.

7.8 所有者权益(基金净值)变动表续
会计主体:富国天盈债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年12月31日
单位:人民币元

本报告7至7.4财务报表由下列自然人签署: 陈天歌, 雷青松

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 占期末基金资产净值比例(%).

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%), 占期末基金资产净值比例(%).

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

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额.

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

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table with columns: 序号, 债券品种, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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

Table with columns: 合约名称, 持仓数量, 公允价值, 公允价值变动.

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 合约名称, 持仓数量, 公允价值, 公允价值变动.

8.11 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.13 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。

8.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.19 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.21 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.23 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

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因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元:东吴证券34414; 东吴证券000103; 东吴证券395444; 华泰证券0005611; 华泰证券36274; 兴业证券28836; 本报告期本基金退券商交易单元:华泰证券25547。其余券商券商交易单元未发生变更。