

富国天盈债券型证券投资基金(LOF)

富国基金管理有限公司
中国工商银行股份有限公司
2019年03月29日

§ 1 重要提示及目录

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、公司已于2019年03月23日发布公告,李弄自2019年03月22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性情况的说明
本报告期,富国基金管理有限公司作为富国天盈债券型证券投资基金(LOF)的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天盈债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并力求基金资产长期稳定收益为目标,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。在制作、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配售等相关环节进行控制;2、二级市场,通过交易系统对组合间的公平性进行自动化的处理。2.同一基金经理管理的不同组合,对同一投资标的的采用相同的投评价标准,必须通过交易系统采取同样的同价下达投资指令,确保公平对待其管理的组合。

事后评估及反馈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.通过公平交易的定期报告分析评估系统,对涉及公平性交易的投资策略进行分析评估,对对象涵盖公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同组类组合(股票型、混合型、债券型)之间不同产品以及同一基金经理管理不同组之间的交易行为,若发现异常交易行为,风险管理部视情况要求相关当事人做出合理解释,并按法规要求上报稽核监察机构。2.季度公平性交易分析报告按规定的基金经理经投资经理签字,并经总经理、总经理助理签字后,存档归档,以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况
本报告期,在同向交易与反向交易方面,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)的同向交易金额,在假设同向交易差额零及95%的置信水平下,对同向交易差额进行分析和检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本公司投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易差额方面未出现异常。

本报告期公司内盘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
本基金报告期内未出现异常交易行为。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限制方面,报告期内本组合与其它投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金额度的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金份额投资策略和运作分析
2018年,债券市场经历了牛熊行情,从10年国债收益率来看,下行至70BP;分阶段看,一季度虽然跟随美联储加息步伐上调MLF利率,但幅度已经有所缩小,流动性开始逐步宽裕;二季度开始,去杠杆严监管的环境逐步向稳杠杆转变,尤其是中美贸易纠纷后,对经济预期利空,权益市场开始调整,市场风险偏好下降。三季度开始,中央开始加大逆周期调节,货币政策继续边际宽松,在货币宽松方面,在通胀保持稳定的前提下,央行通过降准、逆回购和MLF等方式向市场投放流动性。四季度开始,经济数据继续边际宽松,在货币政策方面,国债收益率继续下行空间受限,2019年总览宏观环境将有利于债券行情。本基金力争在控制风险的前提下,争取为基金份额持有人带来持续的回报。

4.4.2 报告期内基金的绩效表现
截至2018年12月31日,本基金份额净值为0.984元;份额累计净值为1.636元;本期已实现收益占基金本期利息收入、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。

4.5 管理人对宏观经济的展望
展望2019年,“三大攻坚战”初告战成,未来化解防范重大风险攻坚战依然是主要任务之一。在经济下行周期中,防范风险多是以稳为主,监管政策会体现刚柔并济,货币政策的表述去除了“稳”和“总基调”,表明全年流动性仍将保持持币待购,美联储加息步伐逐步放缓,全球货币宽松预期将进一步升温,人民币汇率大概率将总体稳定。经历了2018年的牛市,虽然债券收益率继续下行空间受限,2019年总览宏观环境将有利于债券行情。本基金力争在控制风险的前提下,争取为基金份额持有人带来持续的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期间,本基金严格按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》和《基金合同》约定以及基金的实际情况,本基金管理人将基金投资估值方法、估值参数的选取和确定、估值原则和具体核算方法等信息向中国证监会基金监管部报告,并按照基金监管部的要求予以披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配的情况说明
本基金报告期内未进行利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信的情况说明
本基金报告期内,本基金托管人在对富国天盈债券型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本基金报告期内,富国基金管理有限公司对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于2009年4月13日获得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。公司在2001年3月从北京迁址上海,2003年9月,加纳大利得利银行(BMO)参股富国基金管理有限公司成为国内首批成立的一家基金管理公司,中行第一家中外合资的基金管理公司。

目前,公司注册资本2亿元人民币,股东为:海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大大利得利银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司,并全资设立两个子公司——富国资产管理(上海)有限公司和富国资产管理(香港)有限公司,公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至2018年12月31日,富国基金管理有限公司对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于2009年4月13日获得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。公司在2001年3月从北京迁址上海,2003年9月,加纳大利得利银行(BMO)参股富国基金管理有限公司成为国内首批成立的一家基金管理公司,中行第一家中外合资的基金管理公司。

截至2018年12月31日,富国基金管理有限公司对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于2009年4月13日获得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。公司在2001年3月从