富国天益价值证券投资基金 2014 第 差帶责任。 股公司根據本基金合詞規定,于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表 内容不存在虚數过聚,提号性陈述或者置大遗漏。 法诚实信用,美统权贵的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利。 未未表现。投资有风险,投资者任作出投资法策前应行倒阅读本基金的招展说明书。 告期末基金份额总额(单位:份 资目标 资策略 § 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1主要财务指标 期末基金资产净值 净值增长率① 净值增长率标准 业绩比较基准收 业绩比较基准收益 差率③ 业绩比较基准收益 3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

注:截止日期为2014年12月31日

在::(被L口到/9/2014年12月31日。 本基金于2004年6月15日或2.建仓期6个月,从2004年6月15日至2004年12月14日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大,建仓期3个月,从2007年11月5日至2008年2月4日,建仓期4束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

姓名	职务	任本基金的基	1.金经理期限	证券从业年	说明
KE-4D	W1 55	任职日期	高任日期	服	
李晓铭	本基金基金经理	2014-04-15	-	10年	硕士、曾任年富基金管理有限公司 业所负品。2006年4月至2009年10月 范围基金管理有限公司行业研究部 业研交员,富国大师创新主组联员 证券投资基金基金经理制度。2009 10月至2014年10月任富国大原基金 课。2011年8月至2014年7月任富国 碳环保股票型业务投资基金基金经理 理。2014年4月起任富国大旅站价值 投资基金基金经理,具有基金从业 投资基金基金经理,具有基金从业

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国天益价值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》、《富国天益价值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谋求基金资产长期稳定的增长为目标,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。 4.3公平交易专项语明

k绩比较基准 、险收益特征

3.1主要财务指标

净值增长率① 净值增长率标准 业 差②

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

职务

k基金基金经:

业绩比较基准收益 益率③ 业绩比较基准收益 率标准差④

注:1.截止日期为2014年12月31日。 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。 § 4 管理人报告

4.3.1公平交易削度的执行情况 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坏节,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赛权。 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,通过专易系统的投资备选库,交易对手库及授权管理,对投资 标的、交易对手租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 化证代统 1、据主动机等组合的相同自动管理分别加速制行力。非场绝别极知论新自由核同常。不是进行,对

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。非经特别控制流展审核同意,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

:771日至0321日。 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 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。以及不同时间面口下(1日、3日、5日) 时参重众平性交易分析评估等。1. 通过公平性交易的等后分 析评估系统、对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估、务所对象涵盖公募 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、苦发现界常交易行为、监察储器、视情况要以相关当事人做出合理性解解,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。 本报告询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。 4.32异常交易行为的专项说明 本报告询内太爱规异常交易行为。 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4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报告期内基金的投资策略和运作分析 2014年四季度,在新管资会大量人市的背景之下,A股市场价值被充分控制,低估值股票猛烈上涨。

5.1报告期末其全资产组合情况

序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,262,836,016.23	90.25
	其中:股票	5,262,836,016.23	90.25
2	固定收益投资	277,292,507.20	4.76
	其中:债券	277,292,507.20	4.76
	资产支持证券	-	_
3	贵金属投资	-	_
4	金融衍生品投资	-	_
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	_
6	银行存款和结算备付金合计	280,668,559.60	4.81
7	其他资产	10,754,746.28	0.18
8	合计	5,831,551,829.31	100.00

70		季	T.	叓		报	告			
代码		行业类别			公	允价值(元)	占基金资产净值	生比例(%)		
A	农、林、牧、渔。	k				-		-		
В	采矿业					98,647,548.80		1.71		
C D	制造业 电力、热力、燃	气及水生产和	供应业	-+		2,458,623,467.53 104,295,247.36		42.53 1.80		
E	建筑业	THE STATE OF THE S	, von M.	-+				- 1.60		
F	批发和零售业					926,324,644.14		16.02		
G	交通运输、仓f					-		-		
H	住宿和餐饮业	: 牛和信息技术》	日女小			691.758.803.84		11.97		
I	金融业	十和16.83.1又不8	R 27 3E	-		229,698,315.20		3.97		
K	房地产业					615,231,139.68		10.64		
L	租赁和商务服	务业				84,480,000.00		1.46		
M	科学研究和技					1,654,010.00		0.03		
N O		公共设施管理』 理和其他服务』				_				
P	教育	# 70 96 1E 0X 77 3	E.	-						
Q	卫生和社会工	ff.		-+		-		_		
R	文化、体育和知	吴乐业				46,865,516.28		0.81		
S	综合					5,257,323.40		0.09		
3担4	合计 与期末按公。	介价值占 目	全容立	海値 いめ	大小‡	5,262,836,016.23 非序的前十名股	三	91.03		
序号	股票代码	股票名称		量(股)		公允价值(元)	占基金资产净值	直比例(%)		
1	002153	石基信息		7,789,71	_	511,005,566.40		8.84		
2	600309	万华化学		20,309,07	/2	442,331,588.16		7.65		
3	600208	新湖中宝		58,000,00	_	424,560,000.00		7.34		
4	002024	苏宁云商		28,000,00		252,000,000.00		4.36		
5	000581 000712	威孚高科 锦龙股份		9,263,44	_	248,538,148.86 229,698,315.20	-	4.30		
7	000712	一汽轿车		14,275,07	_	216,124,590.08		3.74		
8	600694	大商股份		4,130,28	_	197,964,655.91		3.42		
9	000671	阳光城		13,437,55		186,378,915.59		3.22		
10 4404	600858	银座股份	- 15-15-14-14-1	18,000,00		181,080,000.00		3.13		
4报台 序号	与期末按债	分品种分类 债券品种	的顶斧	区页组合		值(元)	占基金资产净值	生化例(%)		
1	国家债券							-		
2	央行票据					-		-		
3	金融债券					250,152,000.00		4.33		
	其中:政策性	金融债				250,152,000.00		4.33		
4	企业债券	F #A								
6	中期票据	1 50*								
7	可转债					27,140,507.20		0.47		
8	其他					_		-		
9 E-HD-H	合计	ム人店ト甘	· A.W>	Var Att LL As	N_L d. #	277,292,507.20	44.4FL26c0036m	4.80		
P 号	分別不仅公 债券代码	元17F1且亡基 债券名		数量(非序的前五名债 公允价值(元)	占基金资产净值	百比例(%)		
1	140327	14进出			100,000	110,165,000.00		1.91		
2	140444	14农发	44		500,000	50,110,000.00)	0.87		
3	120229	12国开			500,000	49,815,000.00		0.86		
4	140207	14国开 石化转			300,000	30,045,000.00		0.52		
	110015 与期末按公:				201,160 27,140,507.20 0.47 中值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细					
E:本	基金本报告	期末未持有	育资产支	持证券。				(193)44		
7报台	5期末按公: 基金本报告	た价值占基 期未投资量	金贤产 金属	净值比例	1大小扫	非序的前五名贵	金属投资明细			
.8报台	与期末按公:	允价值占基	金资产	净值比例	大小杉	非序的前五名权	证投资明细			
	基金本报告 与期末本基:			六日を石	1224111					
	告期末本建					細				
E:本	基金本报告	期末未投资	的股指期	货。						
	○基金投资Ⅰ ○根据基金台				旨期份					
10报	告期末本基	宝金投资的 [国债期货	f交易情	况说明	ĺ				
	本期国债期			:40.85 FIR	去田化					
	k根据基金台 报告期末本									
:本	基金本报告	期末未投资	医国债期	货。						
	本期国债期 注本报告期ラ									
11投	资组合报告	計附注								
年1.11	申明本基金 1受到公开证	投资的前十	-名证券	的发行	E体本	期是否出现被监	监管部门立案调查	查,或在报台		
				的发行主	体没有	T被监管部门立	案调查或在本报	告编制日前		
公开	·谴责、处罚	的情况。						a - marks a pol fi		
报告	甲明基金投 i期本基金拉 其他资产构	9资的前十	3股票是 名股票。	:否超出是 中没有在	基金合基金合	司规定的备选版	^{设票库。} 票库之外的股票	0		
序号			名称				金額(元)			
1	存出保证金							2,498,782.16		
	h off how ofe h	# 10° 35°								
2	应收证券	H ST SA				_				
3 4	应收证券2 应收股利 应收利息	H SP EX						6,709,246.28		

1 110015 石化转债 27,140,50 5.11.5报告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不存在流通受限情况。 5.11.6投资组合报告附注的其他文学描述部分。 因四舍五人原因,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。 § 6 开放式基金份额变动

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

8.3查阅方式 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

富国天盈债券型证券投资基金 (LOF)

沒在帶責任。 核有限公司報报本基金合同模定。于2015年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值 定复核内容不存在虛骸记载,误导性陈述或者重大遭盡。 以该女后用"颠簸条"的原则管理和更用基金货产。但不保证基金一定盈利。 来来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策加血行圈阅读本基金的招额设明书。 § 2 基金产品概况 と 佐策略 、基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低 6品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型 险收益特征 (3) 主要财务指标和基金净值表现 3.1主要财务指标

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 3.2.1本报告期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

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,开放式基金的申购则

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

注:截止日期为2014年12月31日。 本基金合同生效日为2011年5月23日,本基金建仓期6个月,即从2011年5月23日起至2011年11月 22日。建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

	1	小组)简介	A for our file still	1	ı	
姓名	职务	任本基金的基	7 SMC 7001 7001 777 1 1 1 4	证券从业年	说明	
		任职日期	离任日期	PR		
\$36 F0J	本基色基金收益的基本基金基金收益的基本基础。 本基任因总是基础的基础的基础的基础的基础的基础的基础的基础的基础的现在, 第一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	2014-03-26	-	16年	面上,曾任职关企证券股份有限公司实际服务。 研究部取品,投资银行取制品。2003年 为代据。2004年1月至今任富国民利关。 安阳,2006年1月至今任富国民利关。 全经理,2006年1月至今任富国民利关。 全经理,2006年1月至今任富国民利关。 全经理,2006年1月至少日本第一次, 全经理。2017年0月至	
张钫	本基在全国短汇单位 全国短汇单位。 全国国汇单位。 一个工作, 一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一	2014-07-29	-	6年	級土, 他任乎基本会管理有限公司 等种究员,基金经理的度,基金经理 15 2014年7月至2014年7月至富国基金 15 2014年7月至6国基金管理有限公司经定 10 10 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12	

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明 4.4亿円到19/4-基並是下陸於了旧同位於明 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》、《富国天盈分级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,本着破实信用、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,管理和运用基金资产, 无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3公平交易专项证明 4.31公平交易制度的执行情况 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

事前控制,事中监控,事后评估及反馈的流档化管理。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赛权。 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 标约、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同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 于同日间向交易,通过交易系统对组合间的交易公性进行自动化处理。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 经柱后邻距的织合

等局所官地的组合。 事局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, 并重占分析同类组合(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 問色面目90份。公子度公平往文例7的1报百亿%纪念盛金总理现及页台建设于, 开党曾宗下、总会周阅签字后, 归咎保存, 以备后查。 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。

4.3.2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意价同日反向交易的控制方面,报告期内本组合与其他

不可認作自量的自含较强自合性公認的公开起时间自及间交易的经理方面,我看到内华组合与典电投资组合之间未出现成交换少的单立交易量超过该距券当日成交惠等的情况。 4.根告期内基金的投资策略和运作分析 四季度债券收益率见底回开,基本面的利好因素在钝化,交易情绪主导市场,市场波动较大。转债市场行情上涨,为债券基金分享收益提供了机会。报告期内,本基金调整组合结构应对市场波动和赎回,获

一季度,政策取向在逐步转向宽信用,地产成交量能否持续并带动地产投资增长仍 有待观察。四季度信用利差扩大后,收益率水平一定程度上隐含了上述基本面的预期。整体来看,债市收益率小幅波动的概率大,交易可以带来相对收益。权益市场的波动性加大,需要加强风险控制。 4.5报告期内基金的业绩表现

太报告期 太其全份额净值增长率为408% 同期业绩比较其准收益率为258% § 5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况 2.5.2报告期末按行业分类的股票投资组合 注:本基金本报告期末未持有股票投资。 5.3报告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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

59,558,31 数量(张)

5.6报告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注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.7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。 5.8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权证投资明细 注, 本基金本报告期末未持有权证。

在: / 本基並平成日初小木1行刊 () 5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 5.9.1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投资股指期货。 5.9.2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。 5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.101本间到水本基金设设的海底的设立。 5.101本期間循期货投资放策 本基金根据基金合同的约定,不产户投资国债期货。 5.102根告期末本基金投资的国债明货件仓和损益明细 注:本基金本报告期末未投资国债期货。 5.10.3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

本基证本报告期末未投資国现明页。 5.11投资组合报告的证 5.111中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 目前一年内受到公开谴责,处罚的情形。 报告即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,或在报告编制日前一年 内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。 本基金本报告期末未持有股票资产。 5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 注:本基金本报告期末未持有股票资产 5.11.6投资组合报告附注的其他文学描述部分。 因四舍五人原因,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。

《6 开放式基金份额变动

《7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金 §8 备查文件目录

6.1 智工又件目录 1.中国证监会批准设立宫国天盈分级债券型证券投资基金的文件 2. 宫国天盈分级债券型证券投资基金基金合同 3、宫国天盈分级债券型证券投资基金托管协议

5、富国天盈分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注 6、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)财务报表及报表附注 、报告期内在指定报刊上披露的各项公告 。24年成地点 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

投资老对木报告书加有疑问 可咨询木其全管理人宣国其全管理有限公司 咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费) 公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7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。
5.8报告期末投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货证。
5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1报告期末未基金投资的股指期货费持仓和损益明细注:本基金本报告期末未找资股指期货。
5.9.2本基金处资股指制的的投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。
5.10年的联末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.101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。
5.101本期国债期货投资政策
在基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。
5.101本期国债期货投资政策
在基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。
5.101本期国债期货投资政策
在基金本报告期末未投资国债期货

富国天源平衡混合型证券投资基金

四

	》1 里安挺小					_	4 •//	4 ·
实性、准确性和完整性承担个别及连 基金托管人中国农业银行根据:					3	0	7	7
基金简称	③ 2 基金产品概况 富国天源平衡混合							硕士, 曾任华富
基金主代码	100016							如
交易代码	前端交易代码;100016 后端交易代码;100017		李晓铭	本基金前任基金	金前任基金 经理 2009-10-29	2014-10-23	10年	业研究员,富 证券投资基金 10月至2014年1
基金运作方式	契约型开放式		7-100 101	经理				理 .2011年8月3
基金合同生效日	2002年08月16日							碳环保股票型i 理,2014年4月起 投资基金基金经
报告期末基金份额总额(单位:份)	815,014,727.68							投资基金基金经格。
投资目标	层可能减少和分散投资风险。为保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的 增长。本基金分平衡型证券投资基金、将基金资产按比例投资于股票和债务。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。	本 人民共	k报告期,管 t和国证券	本基金运作遵 国基金管理有 投资基金法》、 规的规定,本着	限公司作为2 《中华人民共	富国天源平復 和国证券法)	、《富国天	券投资基金的 源平衡证券权
投资策略	采取自上而下主动性管理策略, 前产配置突出期个层面的平衡一、	资风险 金投资 4. 4.	金、确保基金 经组合符合 .3公平交易 .3.1公平交易	党资产的安全并 有关法规及基: 专项说明 易制度的执行	·谋求基金资; 金合同的规定 青况	空长期稳定的 [。	增长为目	标,无损害基金
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=中信标普300指数收益率×65%+中信国债指数收益 率×2004/目明之数列率×50%	级市场	5.申购、二级	人根据相关法 设市场交易相关 数 事后诬估	的研究分析	、投资决策、指	段权、交易:	丸行、业绩评估

金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。
4.3.公平交易制度的执行前品
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、接权、交易执行、业绩评估等投资管理环节、实行事的经验,请申贴选及,请户评估及反馈的原究分析、投资决策、接权、交易执行、业绩评估等投资管理环节、实行事的控制。申申监控、事市的对助主要包括、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。2.2.级市场,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及接权管理,对投资额,支承对手和操作权限进行自动化控制。
事中监控主要包括组合同相同投资标的的交易方向、市场中市的控制、银行间市场交易价格的公人使评估等。1、格主动投资组合的同互向交易别为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行公对于同目同同交易,通过交易系统的投资各选库、交易对手库及接权管理,对投资标户实现的重要包括组合同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。
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,积分不得进行。对于同日同向交易、加过交平性交易分数价的,必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令,每个一个净,不同年代及废证主要包括组合间的交易公平性进行的水场集累。1、通过公平性交易的股份分别行为进行分所评估,分析对除路盖公务。对涉及全产产品,并重点分析同类组合。仅需型、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所,对所进入的发现异常交易行为为、监察解解视情记,是对非关的一个关键,并被法有是实现等实验分析对的专项说明。本报告期内太空间体于基金严格遵守公司的相关交易等等,并没有完全间,因组合流动性管理或投资策略调整完全基金经产或多价方的专项说明。本报告期内未会现于基金所有的重视,是是公下行的反对的企业,是是公下行的更效的预测,不是有一个企业的企业,是是公下的企业的通过,是有一个企业的企业,是有一个企业的企业,是有一个企业的企业,是有一个企业的企业,是有一个企业的企业,是有一个企业的企业,是是公下的企业的企业,是有一个企业的企业,是是公下的压力的企业,是有一个企业的企业,是是公下的压力的,是是不够的企业的企业,是是公下的压力的不一个。我们从为尽管流动性有互继续保持。然,但是经济下行的压力仍在,流动性负责的的发生规划的企业,是是经济下行的压力的不,流动性负责的。本程台市从规划基金资产单值和整情形的说明。本报台期,基金设产的比例(6)。

5.1	报告	期末基金资产组合情况		
	序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
	1	权益投资	621,838,341.38	59.1
		其中:股票	621,838,341.38	59.1
	2	固定收益投资	330,192,000.00	31.3
		其中:债券	330,192,000.00	31.3
		资产支持证券	-	
	3	贵金属投资	-	
	4	金融衍生品投资	-	
	5	买人返售金融资产	-	
_				

	其中:买断;	式回购的买人进	(售金融资产		-	-
6	银行存款和	结算备付金合	it		81,606,932.02	7.76
7	其他资产				18,216,527.63	1.73
8	승计				1.051.853.801.03	100.00
5.2报告	期末按行	业分类的股	票投资组合		,,	
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			_	_
В	采矿业				-	_
С	制造业				171,302,977.58	17.91
D		8气及水生产和	供应业		6,760,000.00	0.71
E	建筑业				17,051,364.00	1.78
F	批发和零售』				15,330,628.01	1.60
G	交通运输、仓				_	-
Н	住宿和餐饮业				12,226,762.08	1.28
I		件和信息技术	H 95 M2		112,361,659.11	11.75
J	金融业				151,339,581.00	15.83
K L	房地产业 租赁和商务用	H.Ar. Jlu		_	68,784,472.60	7.19
M	科学研究和打			_	46,889,550.00	4.90
N		公共设施管理:	IIV	_	13,840,000.00	1.45
0		理和其他服务:			13,840,000.00	1.45
p	教育	ALL THE CHARGE				_
Q	卫生和社会日	C/F			_	_
R	文化、体育和				5,869,347.00	0.61
S	综合				82,000.00	0.01
	合计				621,838,341.38	65.03
.3报告	期末按公	允价值占基	金资产净值	比例フ	大小排序的前十名股	票投资明细
序号	股票代码	股票名称	数量(股)		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁软件		575,000	47,229,750.00	4.94
2	600415	小商品城	3,6	595,000	46,889,550.00	4.90
3	000712	锦龙股份	1,4	418,800	38,591,360.00	4.04
4	000732	泰禾集团	1.1	367,788	30,725,112.60	3.21
5	601318	中国平安		109,400	30,586,274.00	3.20
6	000671	阳光城	2.0	000,000	27,740,000.00	2.90
7	002318	久立特材	-	910,401	27,202,781.88	2.84
8	002563	森马服饰		590,846	19,645,629.50	2.05
9	601166	兴业银行	1,	182,300	19,507,950.00	2.04
10	601800	中国交建	1,0	227,600	17,051,364.00	1.78
.4报告	期末按债	券品种分类	的债券投资	组合		
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	国家债券			29,955,000.00	3.13
2	央行票据				-	-
3	金融债券				300,237,000.00	31.40
	其中:政策性	金融债			300,237,000.00	31.40
4	企业债券				-	-
5	企业短期融资	资券			_	-
6	中期票据				_	-
7	可转债				_	_

141,722,0

5 019317 13国债17 300,000 29,955,000.00 5.6报告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组

本基证本保管期末未定以同时即40.6 5.11投資給各售的時一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 目前一年内受到公开证置。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,或在报告编制日前一年内 受到公开谴责,处罚的情形。 5.112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是否超出基金合同规定的备选股票库。 12,148,126.8 9 自计
5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末持有的处于转股期的可转换债券。
5.11.5报告期末前十名股票中存任范逋受股情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中存任范逋受股情况。
5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四畬五人原因,投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四畬五人原因,投资组合报告中值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。
因四畬五人原因,投资组合报告中省值方净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。 报告期期初基金份额总额

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 注:本报告期间本基金管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。 8.8 备查文件目录 8.1 备查文件目录
1.中国证监会批准设立富国天源平衡混合型证券投资基金的文件
2.富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同
3.富国天源平衡混合型证券投资基金指信协议
4.中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
5.富国天源平衡混合型证券投资基金财税表及报表股报
6.报告期内在指定报刊上披露的各项公告
9.2 次的地点 6.报告期内在指定被判上按照印台代本 C 8.2存放地点 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 8.3查阅方式 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:95105686,400880688(全国统一,免长途话费) 公司网址:http://www.fullgoal.com.cn