

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

[2015]第一季度报告

基金托管人: 富国基金管理有限公司
基金托管人: 中国农业银行股份有限公司
报告送出日期: 2015年04月20日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事声明本报告所载资料存在重大虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同，于2015年4月6日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、基金资产净值和基金份额净值等信息，保证复核结果与基金管理人计算的结果一致。
基金管理人和基金托管人已认真履行了基金合同规定的各自职责，但不能保证基金一定盈利。
本基金过往业绩并不代表未来表现。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。

基金管理人: 富国基金管理有限公司
基金托管人: 中国农业银行股份有限公司
报告送出日期: 2015年4月20日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称: 富国天盛灵活配置混合

基金代码: 000634

交易代码: 前端交易代码:000634
后端交易代码:000635

基金运作方式: 约定期开放式

基金合同生效日: 2014/04/10日

报告期末基金份额总额(单位:份): 451,171,361.92

基金份额净值: 1.00

基金总资产: 396,900,000 元(收货币×95%+中行存款×5%)

基金总负债: 62,974,977.51 元(其中: 应付赎回费 1,794 元)

注: 上述基金业总资产不包括持有人认购或申购基金的交易费用(例如, 打开式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等), 计入份额后出现基金总资产低于单列数字。本期实现收益指扣除管理费后的收益。

本期已实现收益收入, 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已实现公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去三个月 21.80% 9.82% 1.19% 11.98% 0.58%

注: 过去三个月指2015年1月1日至2015年3月31日。

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较

§ 3 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标 报告期(2015年01月01日-2015年03月31日)

1.本期已实现收益 69,696,591.49

2.本期利润 117,091,503.69

3.加权平均基金份额本期利润率 0.2995

4.期末基金份额净值 628,974,977.51

5.期末可供分配基金份额净值 1.00

6.期末基金资产净值 396,900,000

注: 上述基金业总资产不包括持有人认购或申购基金的交易费用(例如, 打开式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等), 计入份额后出现基金总资产低于单列数字。本期实现收益指扣除管理费后的收益。

本期已实现收益收入, 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已实现公允价值变动收益。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金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

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去三个月 1.77% 9.82% 1.19% 11.98% 0.58%

注: 过去三个月指2015年1月1日至2015年3月31日。

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较

§ 4 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

黄宣 本基金基金经理 刘宜 本基金基金经理 2014-04-30 - 8年 博士, 曾任中国万国证券研究所有限公司宏观分析师, 高级研究员, 2012年1月加入富国基金管理有限公司, 任首席宏观策略分析师, 2013年1月加入富国基金管理有限公司, 任基金经理助理, 2014年4月担任基金经理, 现任基金经理。

4.2 报告期内本基金运作跟踪偏离情况说明

本基金报告期内作为富国天盛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投资基金销售行为规范》、《富国天盛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, 坚持诚实信用、勤勉尽责的原则, 选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争通过合理的资产配置, 在严格控制风险的前提下, 实现基金资产的增值。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理制度》, 对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投票决策、授权、交易执行、业绩评估等投资环节实行事前控制、事中监控、事后评估的全流程化管理, 在制度层面确保各组合享有同等信息知情权, 均享交易机会, 并保持各组合的独立投资决策权。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 通过对交易时机的选择、交易对手的选择、授权管理、对投资标的的交易对手的操作权限进行细化管理。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.33 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同产品之间的交易。若发现异常交易行为, 将及时调整交易策略, 必要时通过系统限制同一组合内不同产品之间的交易。

4.3.34 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行过程中, 不同产品之间以及同一基金经理管理的不同组合, 不进行对于同一时间、同一账户内不同