

# 富国全球债券证券投资基金

## 2015] 第一季度报告

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
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监事会对本报告书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责任。  
本基金托管人中国工商银行股份有限公司承诺以勤勉尽责、诚实信用的原则托管本基金，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。

本报告期自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：富国全球债券( QDII-FOF )

基金主代码：100006

交易代码：前缀交易代码：100006  
后缀交易代码：000163

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年10月20日

报告期末基金资产净值总额(单位：份)：35,093,699,058

投资目标：本基金主要投资于全球债券市场，通过运用基金货币基金( fund of funds )这种国际通行的投资模式，力求实现资产的组合化、风险配置精细化、风险调整最大化，从而寻求资金的长期稳健增值。

本基金采用资产分离策略与大类资产相对应的策略，通过“自上而下”的方式对大类资产进行配置，即首先根据宏观经济、利率、信用、流动性等宏观因素，决定大类资产配置比例；然后在大类资产内选择不同债券品种以及单一基金或代理人投资的债券，使“债券+债券”的组合更优化。

投资策略：本基金采用资产分离策略与大类资产相对应的策略，通过“自上而下”的方式对大类资产进行配置，即首先根据宏观经济、利率、信用、流动性等宏观因素，决定大类资产配置比例；然后在大类资产内选择不同债券品种以及单一基金或代理人投资的债券，使“债券+债券”的组合更优化。

业债比较基准：本基金的业绩比较基准为：Barclay Global Aggregate Index。

风险收益特征：本基金为债券型基金中基金，属于投资于股票基金中的中低风险品种，其预期风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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 -37,330.04

2.本期利润 466,314.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0115

4.期末基金份额净值 33,633,631.13

5.期末基金资产净值 33,633,631.13

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将低于列示数据。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 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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业债比较基准收益率(%) 业债比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.40% 0.22% -166% 0.36% 3.03% -0.14%

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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图：过去三个月2015年1月1日至2015年3月31日，本基金建仓期6个月，从2010年10月20日至2011年4月19日，建仓期结束后各时段资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 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

陈晓亮 本基金基金经理 2014-04-26 - 7年 毕业于西南财经大学，金融工程硕士。曾任国泰君安证券研究所研究员，2012年2月至4月任富国基金管理有限公司研究员，2012年4月至2013年1月任富国天利增长债券型基金基金经理，期间可赎回债券型基金规模最高达150亿元；2013年1月任富国天瑞增强收益债券型基金基金经理，期间可赎回债券型基金规模最高达100亿元；2014年4月起任富国天瑞增强收益债券型基金基金经理，期间可赎回债券型基金规模最高达100亿元。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本境外投资顾问无境外投资经验。

4.3 告知客户本基金遵循的交易规则说明

本报告期内，富国基金管理有限公司作为《富国全球债券证券投资基金》的基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券交易所法》、《富国全球债券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、勤勉尽责的原则和运用基金资产，以为投资者谋利益和分散风险，力保基金资产的安全，并谋求基金长期稳定收益为目标，管理运用基金资产，基金投资组合符合有关法律法规和基金合同的规定。

4.4 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.5 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.6 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为1.48%，同期业绩比较基准收益率为-1.65%。

4.7 报告期内基金的业绩评价

本报告期内，本基金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责任。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不保证基金一定盈利。

本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。

本报告期内，本基金未发生任何影响基金合同效力的重大事件。

4.8 报告期内基金的费用调整

本基金的费用调整由基金管理人根据相关法律法规规定，经基金托管人同意并公告后实施。

4.9 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.10 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.11 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.12 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.13 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.14 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.15 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.16 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.17 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.18 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.19 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.20 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.21 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.22 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.23 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.24 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.25 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.26 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.27 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.28 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.29 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.30 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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、事后评估及反馈的全流程管理。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，并保持各组合的公平投资决策。

4.31 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场价格相关的研究分析、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