

富国可转换债券证券投资基金

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保证本报告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。	
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。	
富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者有风险，投资需谨慎。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	富国可转换债券
基金代码	100051
交易代码	前端交易代码：100051 后端交易代码：100052
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2010年12月9日
报告期末基金份额总额(单位：份)	558,436,736.73
投资目标	本基金主要利用可转换债券兼具债券和股票的特性，通过“自下而上”和“宏观分析+中观行业”自上而下相结合的投资组合，力争在控制净值波动下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面通过利用可转债的债券特性，增强收益的确定性并降低波动；一方面通过可转债的权益特性(内含看涨期权)，分享股票价格上涨所产生的权益收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=天相转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中风险较低品种，其预期风险与预期收益高于货币型基金，低于混合型基金和股票型基金，本基金主要投资于可转债品种，本基金整体风险与收益水平较纯债型基金略高。
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

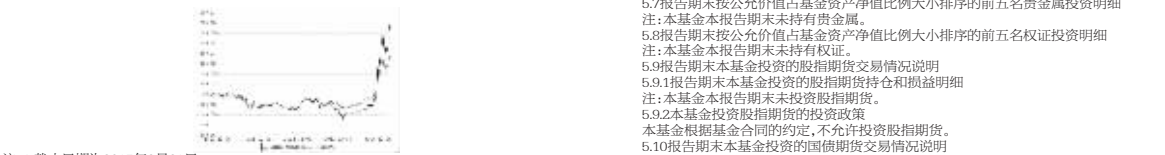
§3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1主要财务指标	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2015年01月01日-2015年03月31日)
1.本期已实现收益	136,063,797.07
2.本期利润	87,918,448.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.1207
4.期末基金资产净值	900,661,133.61
5.期末基金份额净值	1.613

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期公允价值变动收益。

3.2.1 本基金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 ①	净值增长率 比较基准收益率 ②-①	③ 净值增长率 比较基准收益率 ④-③	④-②
过去三个月	11.32%	2.30%	3.75%	1.49% 7.57% 0.81%

注：过去三个月指2015年1月1日-2015年3月31日
3.2.2日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



注：1.截止日期为2015年3月31日。
2.本基金于2010年12月9日成立，建仓期自2010年12月8日至2011年6月7日共6个月，建仓期结束各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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间	证券从业年限	说明
郑瑞强	本基金基金经理 现任富国基金管理有限公司投资管理部基金经理，2014年3-26	2014-3-26	8年	硕士，曾任华夏证券基金管理部研究员，2011年8月至2012年10月担任富国基金管理有限公司基金经理，2013年10月起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理。

4.2报告期末本基金运作遵规守信情况说明
本报告期，富国基金管理有限公司作为富国可转换债券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》、《富国可转换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值为目标，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权、均等交易机会，并持续组合的独立投资决策机制。

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价格的确定；2、二级市场，通过交易系统的投资准备、交易对手库及授权管理，对投资标的、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组合间交易，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组合。

事后评估及反馈主要包括组合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，并重点分析不同类别组合(股票型、混合型、债券型)内、不同产品间以及同一基金经理管理的不组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部需情况要求相关当事人做出合理解释，并按规定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、总经理审核后，归档保存，以留备查。

4.4报告期内本基金管理人遵守公平交易制度的情况，未出现违反公平交易制度的情况。
4.5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。
4.6报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明
本报告期无需说明预警情形。

报告期末基金资产组合情况	785,103.11
权益投资	785,103.11
其中：股票	785,103.11
固定收益	-
其中：债券	-
资产支持证券	-
贵金属投资	-
金融衍生品投资	-
买入返售金融资产	-
银行存款和结算备付金及拆出资金	772,800.00
其他资产	-

报告期末基金资产组合情况(货币单位：人民币元)

报告期末基金资产组合情况	558,436.46
--------------	------------

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

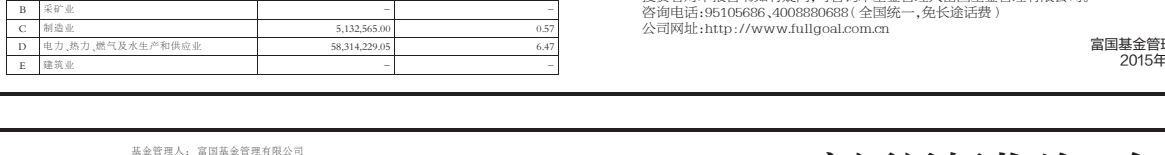
§5.1 报告期末本基金资产组合情况				7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	
§5.2 报告期内行业分类的股票投资组合					
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	报告期期初管理人持有的本基金份额	
				报告期期末买入/申购总份额	

§5.3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	68,052,728.98
2.本期利润	63,094,278.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257
4.期末基金资产净值	2,608,098,198.71
5.期末基金份额净值	1.049

6. 银行存款和结算备付金合计		26,203,653.27	1.81
7. 其他资产		23,220,884.83	1.60
8. 合计		1,450,824,363.30	100.00

§3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：过去三个月指2015年1月1日-2015年3月31日
3.2.2日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



注：1.截止日期为2015年3月31日。
2.本基金于2013年6月27日成立，建仓期6个月，从2013年6月27日至2013年12月26日，建仓期结束各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 1 重要提示				
<p>富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告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。</p> <p>基金管理人富国基金管理有限公司的董事会及董事保证于2015年4月16日所载于本报告中的财务数据、净值表和资产负债表等相关内容真实，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。</p> <p>基金管理人富国基金管理有限公司的董事会及董事保证于2015年4月16日所载于本报告中的基金资产净值、基金份额净值和基金份额持有人资产净值真实，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。</p> <p>基金的投资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研读本基金的招股说明书。</p> <p>本报告经会计师事务所审计，本报告自2015年1月1日起至2015年3月31日止。</p>				
§ 2 基金产品概况				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明

基金名称	国国日利收益一年期国债债券	注册日期	成立时间	...
基金代码	000197	基金管理人	泰达宏利资产管理	成立：经中国人民银行批准
交易代码	000197	基金投资策略	投资于固定收益类资产	资产管理：由 2014 年 9 月 1 日起
基金运作方式	契约型，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式	基金托管人	招商证券股份有限公司	资产管理：由 2014 年 10 月 1 日起
基金合同生效日	2013 年 06 月 27 日	基金运作期限	不定期开放	资产管理：由 2014 年 12 月 22 日
报告期末基金份额总额(单位：份)	2,485,290,870.52	基金投资组合	投资于固定收益类资产	资产管理：由 2014 年 12 月 22 日
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极灵活的资产配置，力争为持有人提供长期稳定的投资收益以及长期稳定的投资回报	基金管理人	泰达宏利资产管理	成立：经中国人民银行批准
	本基金在普通债券的投资中主要集中于国债对财政金融、货币政策的研究分析以	基金托管人	招商证券股份有限公司	资产管理：由 2014 年 10 月 1 日起

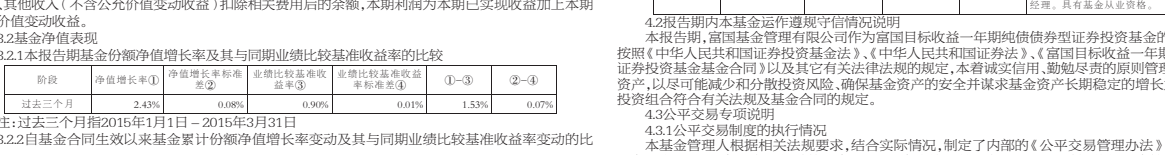
投资策略	<p>及时对宏观经济动态跟踪,尤其关注短期上下游行业动态投资策略,主要包括:长期配置、短期结构配置和波段操作。资产组合管理:股票资产主要投资于国内股票,以国内股票为主,适当配置海外股票,主要投资于中国</p>			
------	--	--	--	--

§5.3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	68,052,728.98
2.本期利润	63,094,278.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257
4.期末基金资产净值	2,608,098,198.71
5.期末基金份额净值	1.049

2.本期利润		63,994,278.90			
3.加权平均基金份额本期利润		0.0257			
4.期末基金资产净值		2,668,098,198.71			
5.期末基金份额净值		1.049			

阶段	本基金净值增长率 业绩比较基准	2013-06-27	2015-03-13	16年
过去三个月	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-2013.9.27	2015.3.13-2015.6.13	2016.1.1-2016.3.31
过去六个月	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-2013.12.27	2015.3.13-2015.9.13	2016.1.1-2016.6.30
过去一年	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-2014.6.27	2015.3.13-2016.3.13	2016.1.1-2016.12.31
过去两年	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-2015.6.27	2015.3.13-2017.3.13	2016.1.1-2017.12.31
过去三年	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-2016.6.27	2015.3.13-2018.3.13	2016.1.1-2018.12.31
过去五年	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-2018.6.27	2015.3.13-2020.3.13	2016.1.1-2020.12.31
成立以来	净值增长率 业绩比较基准	2013.6.27-至今	2015.3.13-至今	2016.1.1-至今

注：过去三个月指2015年1月1日-2015年3月31日
3.2.2日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



注：1.截止日期为2015年3月31日。
2.本基金于2013年6月27日成立，建仓期6个月，从2013年6月27日至2013年12月26日，建仓期结束各项资产配置比例符合基金合同约定。

15.1.1	基金管理人	基金管理人
15.1.2	基金托管人	基金托管人
15.1.3	基金销售机构	基金销售机构
15.1.4	基金服务机构	基金服务机构
15.1.5	基金服务机构	基金服务机构
15.1.6	基金服务机构	基金服务机构
15.1.7	基金服务机构	基金服务机构
15.1.8	基金服务机构	基金服务机构
15.1.9	基金服务机构	基金服务机构
15.1.10	基金服务机构	基金服务机构
15.1.11	基金服务机构	基金服务机构
15.1.12	基金服务机构	基金服务机构
15.1.13	基金服务机构	基金服务机构
15.1.14	基金服务机构	基金服务机构
15.1.15	基金服务机构	基金服务机构
15.1.16	基金服务机构	基金服务机构
15.1.17	基金服务机构	基金服务机构
15.1.18	基金服务机构	基金服务机构
15.1.19	基金服务机构	基金服务机构
15.1.20	基金服务机构	基金服务机构
15.1.21	基金服务机构	基金服务机构
15.1.22	基金服务机构	基金服务机构
15.1.23	基金服务机构	基金服务机构
15.1.24	基金服务机构	基金服务机构
15.1.25	基金服务机构	基金服务机构
15.1.26	基金服务机构	基金服务机构
15.1.27	基金服务机构	基金服务机构
15.1.28	基金服务机构	基金服务机构
15.1.29	基金服务机构	基金服务机构
15.1.30	基金服务机构	基金服务机构
15.1.31	基金服务机构	基金服务机构
15.1.32	基金服务机构	基金服务机构
15.1.33	基金服务机构	基金服务机构
15.1.34	基金服务机构	基金服务机构
15.1.35	基金服务机构	基金服务机构
15.1.36	基金服务机构	基金服务机构
15.1.37	基金服务机构	基金服务机构
15.1.38	基金服务机构	基金服务机构
15.1.39	基金服务机构	基金服务机构
15.1.40	基金服务机构	基金服务机构
15.1.41	基金服务机构	基金服务机构
15.1.42	基金服务机构	基金服务机构
15.1.43	基金服务机构	基金服务机构
15.1.44	基金服务机构	基金服务机构
15.1.45	基金服务机构	基金服务机构
15.1.46	基金服务机构	基金服务机构
15.1.47	基金服务机构	基金服务机构
15.1.48	基金服务机构	基金服务机构
15.1.49	基金服务机构	基金服务机构
15.1.50	基金服务机构	基金服务机构
15.1.51	基金服务机构	基金服务机构
15.1.52	基金服务机构	基金服务机构
15.1.53	基金服务机构	基金服务机构
15.1.54	基金服务机构	基金服务机构
15.1.55	基金服务机构	基金服务机构
15.1.56	基金服务机构	基金服务机构
15.1.57	基金服务机构	基金服务机构
15.1.58	基金服务机构	基金服务机构
15.1.59	基金服务机构	基金服务机构
15.1.60	基金服务机构	基金服务机构
15.1.61	基金服务机构	基金服务机构
15.1.62	基金服务机构	基金服务机构
15.1.63	基金服务机构	基金服务机构
15.1.64	基金服务机构	基金服务机构
15.1.65	基金服务机构	基金服务机构
15.1.66	基金服务机构	基金服务机构
15.1.67	基金服务机构	基金服务机构
15.1.68	基金服务机构	基金服务机构
15.1.69	基金服务机构	基金服务机构
15.1.70	基金服务机构	基金服务机构
15.1.71	基金服务机构	基金服务机构
15.1.72	基金服务机构	基金服务机构
15.1.73	基金服务机构	基金服务机构
15.1.74	基金服务机构	基金服务机构
15.1.75	基金服务机构	基金服务机构
15.1.76	基金服务机构	基金服务机构
15.1.77	基金服务机构	基金服务机构
15.1.78	基金服务机构	基金服务机构
15.1.79	基金服务机构	基金服务机构
15.1.80	基金服务机构	基金服务机构
15.1.81	基金服务机构	基金服务机构
15.1.82	基金服务机构	基金服务机构
15.1.83	基金服务机构	基金服务机构
15.1.84	基金服务机构	基金服务机构
15.1.85	基金服务机构	基金服务机构
15.1.86	基金服务机构	基金服务机构
15.1.87	基金服务机构	基金服务机构
15.1.88	基金服务机构	基金服务机构
15.1.89	基金服务机构	基金服务机构
15.1.90	基金服务机构	基金服务机构
15.1.91	基金服务机构	基金服务机构
15.1.92	基金服务机构	基金服务机构
15.1.93	基金服务机构	基金服务机构
15.1.94	基金服务机构	基金服务机构
15.1.95	基金服务机构	基金服务机构
15.1.96	基金服务机构	基金服务机构
15.1.97	基金服务机构	基金服务机构
15.1.98	基金服务机构	基金服务机构
15.1.99	基金服务机构	基金服务机构
15.2	基金管理人	基金管理人
15.3	基金托管人	基金托管人
15.4	基金销售机构	基金销售机构
15.5	基金服务机构	基金服务机构
15.6	基金服务机构	基金服务机构
15.7	基金服务机构	基金服务机构
15.8	基金服务机构	基金服务机构
15.9	基金服务机构	基金服务机构
15.10	基金服务机构	基金服务机构
15.11	基金服务机构	基金服务机构
15.12	基金服务机构	基金服务机构
15.13	基金服务机构	基金服务机构
15.14	基金服务机构	基金服务机构
15.15	基金服务机构	基金服务机构
15.16	基金服务机构	基金服务机构
15.17	基金服务机构	基金服务机构
15.18	基金服务机构	基金服务机构
15.19	基金服务机构	基金服务机构
15.20	基金服务机构	基金服务机构
15.21	基金服务机构	基金服务机构
15.22	基金服务机构	基金服务机构
15.23	基金服务机构	基金服务机构
15.24	基金服务机构	基金服务机构
15.25	基金服务机构	基金服务机构
15.26	基金服务机构	基金服务机构
15.27	基金服务机构	基金服务机构
15.28	基金服务机构	基金服务机构
15.29	基金服务机构	基金服务机构
15.30	基金服务机构	基金服务机构
15.31	基金服务机构	基金服务机构
15.32	基金服务机构	基金服务机构
15.33	基金服务机构	基金服务机构
15.34	基金服务机构	基金服务机构
15.35	基金服务机构	基金服务机构
15.36	基金服务机构	基金服务机构
15.37	基金服务机构	基金服务机构
15.38	基金服务机构	基金服务机构
15.39	基金服务机构	基金服务机构
15.40	基金服务机构	基金服务机构
15.41	基金服务机构	基金服务机构
15.42	基金服务机构	基金服务机构
15.43	基金服务机构	基金服务机构
15.44	基金服务机构	基金服务机构
15.45	基金服务机构	基金服务机构
15.46	基金服务机构	基金服务机构
15.47	基金服务机构	基金服务机构
15.48	基金服务机构	基金服务机构
15.49	基金服务机构	基金服务机构
15.50	基金服务机构	基金服务机构
15.51	基金服务机构	基金服务机构
15.52	基金服务机构	基金服务机构
15.53	基金服务机构	基金服务机构
15.54	基金服务机构	基金服务机构
15.55	基金服务机构	基金服务机构
15.56	基金服务机构	基金服务机构
15.57	基金服务机构	基金服务机构
15.58	基金服务机构	基金服务机构
15.59	基金服务机构	基金服务机构
15.60	基金服务机构	基金服务机构
15.61	基金服务机构	基金服务机构
15.62	基金服务机构	基金服务机构
15.63	基金服务机构	基金服务机构
15.64	基金服务机构	基金服务机构
15.65	基金服务机构	基金服务机构
15.66	基金服务机构	基金服务机构
15.67	基金服务机构	基金服务机构
15.68	基金服务机构	基金服务机构
15.69	基金服务机构	基金服务机构
15.70	基金服务机构	基金服务机构
15.71	基金服务机构	基金服务机构
15.72	基金服务机构	基金服务机构
15.73	基金服务机构	基金服务机构
15.74	基金服务机构	基金服务机构
15.75	基金服务机构	基金服务机构
15.76	基金服务机构	基金服务机构
15.77	基金服务机构	基金服务机构
15.78	基金服务机构	基金服务机构
15.79	基金服务机构	基金服务机构
15.80	基金服务机构	基金服务机构
15.81	基金服务机构	基金服务机构
15.82	基金服务机构	基金服务机构
15.83	基金服务机构	基金服务机构
15.84	基金服务机构	基金服务机构
15.85	基金服务机构	基金服务机构
15.86	基金服务机构	基金服务机构
15.87	基金服务机构	基金服务机构
15.88	基金服务机构	基金服务机构
15.89	基金服务机构	基金服务机构
15.90	基金服务机构	基金服务机构
15.91	基金服务机构	基金服务机构
15.92	基金服务机构	基金服务机构
15.93	基金服务机构	基金服务机构
15.94	基金服务机构	基金服务机构
15.95	基金服务机构	基金服务机构
15.96	基金服务机构	基金服务机构
15.97	基金服务机构	基金服务机构
15.98	基金服务机构	基金服务机构
15.99	基金服务机构	基金服务机构
16	基金管理人	基金管理人
16.1	基金管理人	基金管理人
16.2	基金管理人	基金管理人
16.3	基金管理人	基金管理人
16.4	基金管理人	基金管理人
16.5	基金管理人	基金管理人
16.6	基金管理人	基金管理人
16.7	基金管理人	基金管理人
16.8	基金管理人	基金管理人
16.9	基金管理人	基金管理人
16.10	基金管理人	基金管理人
16.11	基金管理人	基金管理人
16.12	基金管理人	基金管理人
16.13	基金管理人	基金管理人
16.14	基金管理人	基金管理人
16.15	基金管理人	基金管理人
16.16	基金管理人	基金管理人
16.17	基金管理人	基金管理人
16.18	基金管理人	基金管理人
16.19	基金管理人	基金管理人
16.20	基金管理人	基金管理人
16.21	基金管理人	基金管理人
16.22	基金管理人	基金管理人
16.23	基金管理人	基金管理人
16.24	基金管理人	基金管理人
16.25	基金管理人	基金管理人
16.26	基金管理人	基金管理人
16.27	基金管理人	基金管理人
16.28	基金管理人	基金管理人
16.29	基金管理人	基金管理人
16.30	基金管理人	基金管理人
16.31	基金管理人	基金管理人
16.32	基金管理人	基金管理人
16.33	基金管理人	基金管理人
16.34	基金管理人	基金管理人
16.35	基金管理人	基金管理人
16.36	基金管理人	基金管理人
16.37	基金管理人	基金管理人
16.38	基金管理人	基金管理人
16.39	基金管理人	基金管理人
16.40	基金管理人	基金管理人
16.41	基金管理人	基金管理人
16.42	基金管理人	基金管理人
16.43	基金管理人	基金管理人
16.44	基金管理人	基金管理人
16.45	基金管理人	基金管理人
16.46	基金管理人	基金管理人
16.47	基金管理人	基金管理人
16.48	基金管理人	基金管理人
16.49	基金管理人	基金管理人
16.50	基金管理人	基金管理人
16.51	基金管理人	基金管理人
16.52	基金管理人	基金管理人
16.53	基金管理人	基金管理人
16.54	基金管理人	基金管理人
16.55	基金管理人	基金管理人
16.56	基金管理人	基金管理人
16.57	基金管理人	基金管理人
16.58	基金管理人	基金管理人
16.59	基金管理人	基金管理人
16.60	基金管理人	基金管理人
16.61	基金管理人	基金管理人
16.62	基金管理人	基金管理人
16.63	基金管理人	基金管理人
16.64	基金管理人	基金管理人
16.65	基金管理人	基金管理人
16.66	基金管理人	基金管理人
16.67	基金管理人	基金管理人
16.68	基金管理人	基金管理人
16.69	基金管理人	基金管理人
16.70	基金管理人	基金管理人
16.71	基金管理人	基金管理人
16.72	基金管理人	基金管理人
16.73	基金管理人	基金管理人
16.74	基金管理人	基金管理人
16.75	基金管理人	基金管理人
16.76	基金管理人	基金管理人
16.77	基金管理人	基金管理人
16.78	基金管理人	基金管理人
16.79	基金管理人	基金管理人
16.80	基金管理人	基金管理人
16.81	基金管理人	基金管理人
16.82	基金管理人	基金管理人
16.83	基金管理人	基金管理人
16.84	基金管理人	基金管理人
16.85	基金管理人	基金管理人
16.86	基金管理人	基金管理人
16.87	基金管理人	基金管理人
16.88	基金管理人	基金管理人
16.89	基金管理人	基金管理人
16.90	基金管理人	基金管理人
16.91	基金管理人	基金管理人
16.92	基金管理人	基金管理人
16.93	基金管理人	基金管理人
16.94	基金管理人	基金管理人
16.95	基金管理人	基金管理人
16.96	基金管理人	基金管理人
16.97	基金管理人	基金管理人
16.98	基金管理人	基金管理人
16.99	基金管理人	基金管理人
17	基金管理人	基金管理人
17.1	基金管理人	基金管理人
17.2	基金管理人	基金管理人
17.3	基金管理人	基金管理人
17.4	基金管理人	基金管理人
17.5	基金管理人	基金管理人
17.6	基金管理人	基金管理人
17.7	基金管理人	基金管理人
17.8	基金管理人	基金管理人
17.9	基金管理人	基金管理人
17.10	基金管理人	基金管理人
17.11	基金管理人	基金管理人
17.12	基金管理人	基金管理人
17.13	基金管理人	基金管理人
17.14	基金管理人	基金管理人
17.15	基金管理人	基金管理人
17.16	基金管理人	基金管理人
17.17	基金管理人	基金管理人
17.18	基金管理人	基金管理人
17.19	基金管理人	基金管理人
17.20	基金管理人	基金管理人
17.21	基金管理人	基金管理人
17.22	基金管理人	基金管理人
17.23	基金管理人	基金管理人
17.24	基金管理人	基金管理人
17.25	基金管理人	基金管理人
17.26	基金管理人	基金管理人
17.27	基金管理人	基金管理人
17.28	基金管理人	基金管理人
17.29	基金管理人	基金管理人
17.30	基金管理人	基金管理人
17.31	基金管理人	基金管理人
17.32	基金管理人	基金管理人
17.33	基金管理人	基金管理人
17.34	基金管理人	基金管理人
17.35	基金管理人	基金管理人
17.36	基金管理人	基金管理人
17.37	基金管理人	基金管理人
17.38	基金管理人	基金管理人
17.39	基金管理人	基金管理人
17.40	基金管理人	基金管理人
17.41	基金管理人	基金管理人
17.42	基金管理人	基金管理人
17.43	基金管理人	基金管理人
17.44	基金管理人	基金管理人
17.45	基金管理人	基金管理人
17.46	基金管理人	基金管理人
17.47	基金管理人	基金管理人
17.48	基金管理人	基金管理人
17.49	基金管理人	基金管理人
17.50	基金管理人	基金管理人
17.51	基金管理人	基金管理人
17.52	基金管理人	基金管理人
17.53	基金管理人	基金管理人
17.54	基金管理人	基金管理人
17.55	基金管理人	基金管理人
17.56	基金管理人	基金管理人
17.57	基金管理人	基金管理人
17.58	基金管理人	基金管理人
17.59	基金管理人	基金管理人
17.60	基金管理人	基金管理人
17.61	基金管理人	基金管理人
17.62	基金管理人	基金管理人
17.63	基金管理人	基金管理人
17.64	基金管理人	基金管理人
17.65	基金管理人	基金管理人
17.66	基金管理人	基金管理人
17.67	基金管理人	基金管理人
17.68	基金管理人	基金管理人
17.69	基金管理人	基金管理人
17.70	基金管理人	基金管理人
17.71	基金管理人	基金管理人
17.72	基金管理人	基金管理人
17.73	基金管理人	基金管理人
17.74	基金管理人	基金管理人
17.75	基金管理人	基金管理人
17.76	基金管理人	基金管理人
17.77	基金管理人	基金管理人
17.78	基金管理人	基金管理人
17.79	基金管理人	基金管理人
17.80	基金管理人	基金管理人
17.81	基金管理人	基金管理人
17.82	基金管理人	基金管理人
17.83	基金管理人	基金管理人
17.84	基金管理人	基金管理人
17.85	基金管理人	基金管理人
17.86	基金管理人	基金管理人
17.87	基金管理人	基金管理人
17.88	基金管理人	基金管理人
17.89	基金管理人	基金管理人
17.90	基金管理人	基金管理人
17.91	基金管理人	基金管理人
17.92	基金管理人	基金管理人
17.93	基金管理人	基金管理人
17.94	基金管理人	基金管理人
17.95	基金管理人	基金管理人
17.96	基金管理人	基金管理人
17.97	基金管理人	基金管理人
17.98	基金管理人	基金管理人
17.99	基金管理人	基金管理人
18	基金管理人	基金管理人
18.1	基金管理人	基金管理人
18.2	基金管理人	基金管理人
18.3	基金管理人	基金管理人
18.4	基金管理人	基金管理人
18.5	基金管理人	基金管理人
18.6	基金管理人	基金管理人
18.7	基金管理人	基金管理人
18.8	基金管理人	基金管理人
18.9	基金管理人	基金管理人
18.10	基金管理人	基金管理人
18.11	基金管理人	基金管理人
18.12	基金管理人	基金管理人
18.13	基金管理人	基金管理人
18.14	基金管理人	基金管理人
18.15	基金管理人	基金管理人
18.16	基金管理人	基金管理人
18.17	基金管理人	基金管理人
18.18	基金管理人	基金管理人
18.19	基金管理人	基金管理人
18.20	基金管理人	基金管理人
18.21	基金管理人	基金管理人
18.22	基金管理人	基金管理人
18.23	基金管理人	基金管理人
18.24	基金管理人	基金管理人
18.25	基金管理人	基金管理人
18.26	基金管理人	基金管理人
18.27	基金管理人	基金管理人
18.28	基金管理人	基金管理人
18.29	基金管理人	基金管理人
18.30	基金管理人	基金管理人
18.31	基金管理人	基金管理人
18.32	基金管理人	基金管理人
18.33	基金管理人	基金管理人
18.34	基金管理人	基金管理人
18.35	基金管理人	基金管理人
18.36	基金管理人	基金管理人
18.37	基金管理人	基金管理人
18.38	基金管理人	基金管理人
18.39	基金管理人	

注：截止日期为2015年3月31日。

本基金于2013年6月27日成立，至本报告期末，从2013年6月27日至2015年12月26日，本报告期末资产配置比例符合基金合同约定。

析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募基金、年金、社保及重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）、同、不同产品以及同一基金经营管理不同行为，发现违规异常行为，为监察稽核提供情况要求相关当事人做出合理解释，并按法规规定监管稽核。2、季度公平交易分析分析报告按照监管规定报送中国证监会，并经督察长、总经理

1.1 基金经理（或基金经理小组）简介	§4 管理人报告	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4.3.2异常交易行为的专项说明
---------------------	----------	--

§5.3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	68,052,728.98
2.本期利润	63,094,278.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257
4.期末基金资产净值	2,608,098,198.71
5.期末基金份额净值	1.049

§3.2基金净值表现						
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期公允价值变动收益。						
3.2.1本基金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① 净值增长率 比较基准收益率 ②-①	③ 净值增长率 比较基准收益率 ④-③	④-②			
过去三个月	2.40%	0.08%	0.00%	0.01%	1.53%	0.07%

注：过去三个月指2015年1月1日-2015年3月31日
3.2.2日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

注：1.截止日期为2015年3月31日。
2.本基金于2013年6月27日成立，建仓期6个月，从2013年6月27日至2013年12月26日，建仓期结束各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
朱彤	本基金基金经理 现任富国基金管理有限公司投资管理部基金经理，2014-12-22	2014-12-22	4年	硕士，曾任华夏证券基金管理部研究员，2011年8月至2012年10月担任富国基金管理有限公司基金经理，2013年10月起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理。

§5 投资组合报告			
5.1报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	167,329,649.48	11.53
2	固定收益	167,329,649.48	11.53
3	其中：债券	1,234,060,175.72	85.06
4	资产支持证券	1,234,060,175.72	85.06
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金及拆出资金	23,203,653.27	1.61
9	其他资产	23,203,653.28	1.60
10	合计	1,450,821,863.20	100.00

§5.2报告期内行业分类的股票投资组合			
代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	制造业	5,125,565.00	0.57
C	金融业	58,124,229.68	6.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

§5.3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	68,052,728.98
2.本期利润	63,094,278.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257
4.期末基金资产净值	2,608,098,198.71
5.期末基金份额净值	1.049

§3.2基金净值表现						
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期公允价值变动收益。						
3.2.1本基金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① 净值增长率 比较基准收益率 ②-①	③ 净值增长率 比较基准收益率 ④-③	④-②			
过去三个月	2.40%	0.08%	0.00%	0.01%	1.53%	0.07%

注：过去三个月指2015年1月1日-2015年3月31日
3.2.2日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

注：1.截止日期为2015年3月31日。
2.本基金于2013年6月27日成立，建仓期6个月，从2013年6月27日至2013年12月26日，建仓期结束各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
朱彤	本基金基金经理 现任富国基金管理有限公司投资管理部基金经理，2014-12-22	2014-12-22	4年	硕士，曾任华夏证券基金管理部研究员，2011年8月至2012年10月担任富国基金管理有限公司基金经理，2013年10月起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理，2015年1月1日起任富国天利理财基金基金经理。

§5 投资组合报告			
5.1报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	167,329,649.48	11.53
2	固定收益	167,329,649.48	11.53
3	其中：债券	1,234,060,175.72	85.06
4	资产支持证券	1,234,060,175.72	85.06
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金及拆出资金	23,203,653.27	1.61
9	其他资产	23,203,653.28	1.60
10	合计	1,450,821,863.20	100.00

§5.2报告期内行业分类的股票投资组合			
代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、		