

富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

2015年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2016年1月20日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事、监事及高级管理人员所载资料不存在虚假记载、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。

基金托管人和基金管理人根据有关法律法规及基金合同的规定，于2016年1月18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事项，保证本基金净值信息的真实准确，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就本基金的定期报告、招募说明书、基金合同和基金招募说明书的说明书中存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，将承担法律责任。

富国基金管理有限公司在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金
报告期结束日：2015年12月31日	
基金类型	股票型
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

报告期期末基金份额总额：194,183,063.00份

报告期期末基金资产净值：300,683,249.57元

报告期期末基金份额净值：1.52元

投资目标 本基金通过通过灵活的大类资产配置与专业的选股选择，实现基金资产较高的长期回报。

投资策略 本基金主要采用“自上而下”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析相结合，综合运用基本面分析、公司估值分析以及行业配置等方法，分析宏观经济形势、行业发展趋势、公司经营情况、公司估值水平等，以期在不同市场环境下获得较优的投资回报。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×65%+中债企业债指数收益率×35%

风险收益特征 本基金为积极型基金，其预期收益及风险高于货币市场基金、低风险债券基金，属于高风险和高预期回报率的理财产品。

基金管理人 富国基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 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10月01日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 34,967,666.47

2.本期利润 45,648,231.09

3.期初现金差额 -2,097,000.00

4.期末现金差额 247,056,164.07

5.期末基金份额净值 1.52

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购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不计费用的净值。

本报告期实现收益扣除非经常性损益后的净利润为-1,000,000.00元。

以上述基金业绩指标扣除非经常性损益后的净利润为依据计算，本报告期实现收益扣除非经常性损益后的净利润为-1,000,000.00元。

基金净值变动幅度以扣除非经常性损益后的净利润为依据计算。

基金净值变动幅度以扣除非经常性损益后的净利润为依据计算。

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为数及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：截至日期为2015年12月31日。

本基金于2014年4月12日成立，建仓期6个月，从2013年10月12日起至2013年10月11日，建仓期间各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

汪孟海 管理人 2013-04-12 -

本基金基金经理

本基金基金经理