富国久利稳健配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:	2018年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国久利稳健配置混合型	
基金主代码	003877	
基金运作方式	契约型,开放式	
基金合同生效日	2016年12月27日	
报告期末基金份额总额	97,200,067.61	
投资目标	通过合理运用投资组合优化策略,在严格控制风险的基础上,力争实现基金收益的稳步提升。	
投资策略	本基金在大类资产配置中,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,采用稳健配置的策略,以时间不变性投资组合保险策略为基本框架,将固定收益资产作为组合的基础,通过控制权益资产的上限并对其进行动态止盈,力争实现控制组合波动性、获得稳健收益的目的。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*85%+沪深300指数收益率*15%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	富国久利稳健配置混合型A级	富国久利稳健配置混合型C级
下属分级基金的交易代码	003877	003878
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	64,855,980.90	32,344,086.71

§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	A级 报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)	C级 报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	63,633.17	-1,642.56
2.本期利润	414,454.68	170,160.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0049
4.期末基金资产净值	67,371,854.54	33,379,328.81
5.期末基金份额净值	1.0388	1.0320

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 基金净值表现

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

(1)A级

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.11%	0.25%	0.20%	0.31%	-0.09%

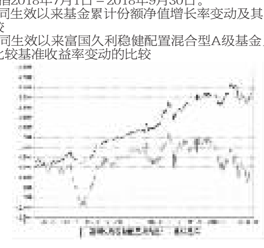
(2)C级

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.46%	0.11%	0.25%	0.20%	0.21%	-0.09%

注:过去三个月指2018年7月1日-2018年9月30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

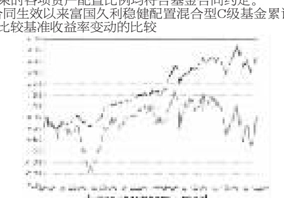
(1)自基金合同生效以来富国久利稳健配置混合型A级基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为2018年9月30日。

2、本基金于2016年12月27日成立,建仓期6个月,从2016年12月27日起至2017年6月26日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2)自基金合同生效以来富国久利稳健配置混合型C级基金累计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2018年9月30日。

2、本基金于2016年12月27日成立,建仓期6个月,从2016年12月27日起至2017年6月26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

4.1 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李羿	本基金基金经理	2017-09-21	-	5	硕士,2009年4月至2010年6月任上海浦东发展银行交易员;2010年6月至2013年7月任交银康联人寿保险有限公司高级投资经理;2013年7月至2016年6月任汇丰晋信基金管理有限公司投资经理、基金经理;2016年6月起加入富国基金管理有限公司,自2016年11月起任富国天盈债券型证券投资基金(LOF)基金经理,自2017年3月起任富国稳健增强债券型证券投资基金基金经理,自2017年8月起任富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理,自2017年9月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理,自2017年11月起任富国景利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,自2017年12月起任富国金利定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2018年1月起任富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内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久利稳健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法》、《富国久利稳健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,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收益为目标,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权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

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,确保公平对待其所管理的组合。

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,风险管理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、总经理审阅签字后,归档保存,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未出现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

三季度,宏观经济数据整体稳中继续回落,因低基数、上游原材料上涨、油价上涨、人民币小幅贬值等影响,物价有所升高,通胀预期继续抬升。三季度美联储继续加息步伐,中国央行按兵不动,继续降准和MLF释放流动性,市场流动性维持宽松,债券收益率总体有所下行。但信用上虽然之前的"宽货币、紧信用"特征有所好转,但信用违约事件再度集中爆发令市场对信用端十分谨慎。股市方面,三季度先抑后扬总体呈现下跌趋势。三季度我们维持了组合久期,降低了权益资产配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率A级为0.56%,C级为0.46%,同期业绩比较基准收益率A级为0.25%,C级为0.25%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,666,280.00	5.26
	其中:股票	5,666,280.00	5.26
2	固定收益投资	98,637,101.54	91.61
	其中:债券	98,637,101.54	91.61
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,673,341.82	1.55
7	其他资产	1,696,186.90	1.58
8	合计	107,672,910.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	338,000.00	0.34
C	制造业	1,933,280.00	1.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	429,400.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,285,400.00	2.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	680,200.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,666,280.00	5.62

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

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	600887	伊利股份	40,000	1,027,200.00	1.02
2	601336	新华保险	20,000	1,009,600.00	1.00
3	600036	招商银行	30,000	920,700.00	0.91
4	601888	中国国旅	10,000	680,200.00	0.68
5	000852	石化机械	40,000	444,800.00	0.44
6	002352	顺丰控股	10,000	429,400.00	0.43
7	601601	中国太保	10,000	355,100.00	0.35
8	600583	海油工程	50,000	338,000.00	0.34
9	002916	深南电路	4,000	285,240.00	0.28
10	600066	宇通客车	12,000	176,040.00	0.17

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	43,413,625.00	43.09
	其中:政策性金融债	40,428,325.00	40.13
4	企业债券	23,911,200.00	23.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	2,346,276.54	2.33
8	同业存单	28,966,000.00	28.75
9	其他	-	-
10	合计	98,637,101.54	97.90

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180408	18农发08	100,000	10,146,000.00	10.07
2	091718001	17农发绿债01	100,000	10,121,000.00	10.05
3	018005	国开1701	100,000	10,060,000.00	9.99
4	018006	国开1702	100,000	10,051,000.00	9.98
5	111808233	18中信银行CD233	100,000	9,739,000.00	9.67

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细

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。

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

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 申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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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。

5.11.2 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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,709.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,673,188.27
5	应收申购款	8,288.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,696,186.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132007	16凤凰EB	945,000.00	0.94
2	132011	17浙报EB	449,900.00	0.45
3	113505	杭电转债	447,500.00	0.44
4	127005	长证转债	213,232.60	0.21
5	128032	双环转债	199,996.44	0.20
6	128018	时达转债	87,760.00	0.09
7	128034	江银转债	1,010.50	0.00

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未持有流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,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

单位:份

项目	A级	C级
报告期期初基金份额总额	76,870,122.08	37,352,423.68
报告期期间基金总申购份额	676,226.96	188,070.73
减:报告期期间基金总赎回份额	12,690,368.14	5,196,407.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	64,855,980.90	32,344,086.71

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国久利稳健配置混合型证券投资基金的文件

2、富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金合同

3、富国久利稳健配置混合型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国久利稳健配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 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

9.3 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

富国基金管理有限公司

2018年10月25日

富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	兴业银行股份有限公司
报告送出日期:	2018年10月25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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国聚利纯债定期开放债券型发起式
基金主代码	004978
交易代码	004978
基金运作方式	契约型,定期开放式
基金合同生效日	2017年08月10日
报告期末基金份额总额(单位:份)	510,000,000.00
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金奉行"自上而下"和"自下而上"相结合的主动式投资管理理念,采用价值分析方法,在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上,自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置;同时,采用"自下而上"的投资理念,在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上,自下而上的精选个券,把握固定收益类金融工具投资机会。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金,属于较低预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	兴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(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	16,388,075.44
2.本期利润	14,490,653.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0150
4.期末基金资产净值	538,541,136.34
5.期末基金份额净值	1.0560

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 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.48%	0.05%	1.37%	0.06%	0.11%	-0.01%

注:过去三个月指2018年7月1日-2018年9月30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

注:1、截止日期为2018年9月30日。

2、本基金于2017年8月10日成立,建仓期6个月,从2017年8月10日起至2018年2月9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

4.1 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李羿	本基金基金经理	2017-08-10	-	5	硕士,2009年4月至2010年6月任上海浦东发展银行交易员;2010年6月至2013年7月任交银康联人寿保险有限公司高级投资经理;2013年7月至2016年6月任汇丰晋信基金管理有限公司投资经理、基金经理;2016年6月起加入富国基金管理有限公司,自2016年11月起任富国天盈债券型证券投资基金(LOF)基金经理,自2017年3月起任富国稳健增强债券型证券投资基金基金经理,自2017年8月起任富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理,自2017年9月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理,自2017年11月起任富国景利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,自2017年12月起任富国金利定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2018年1月起任富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
范磊	本基金基金经理	2017-08-15	-	8	硕士,曾任深圳发展银行资金高级专员、安信证券交易员;2012年6月加入富国基金管理有限公司,历任债券研究员、投资经理,2016年8月起任富国优化增强债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金基金经理,2016年11月至2018年7月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,2017年3月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理,2017年8月起任富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内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聚利纯债定期开放债券型发起式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》、《富国聚利纯债定期开放债券型发起式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收益为目标,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权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

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,确保公平对待其所管理的组合。

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,风险管理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、总经理审阅签字后,归档保存,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未出现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

三季度,宏观经济数据整体稳中继续回落,因低基数、上游原材料上涨、油价上涨、人民币小幅贬值等影响,物价有所升高,通胀预期继续抬升。三季度美联储继续加息步伐,中国央行按兵不动,继续降准和MLF释放流动性,市场流动性维持宽松,债券收益率总体有所下行。但信用上虽然之前的"宽货币、紧信用"特征有所好转,但信用违约事件再度集中爆发令市场对信用端十分谨慎。三季度我们维持了组合久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,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1.37%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金,且截至本报告期末,本基金基金合同生效未满3年,暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效三年后继续存续的,自基金合同生效满三年后的基金存续期内,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	517,436,463.10	95.73
	其中:债券	517,436,463.10	95.73
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	12,000,000.00	2.22
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,264,730.26	0.60
7	其他资产	7,794,905.42	1.44
8	合计	540,496,098.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票资产。

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资产。

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,693,850.50	44.69
	其中:政策性金融债	215,313,000.00	39.98
4	企业债券	276,742,612.60	51.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	517,436,463.10	96.08

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180207	18国开07	1,000,000	100,240,000.00	18.61
2	180209	18国开09	1,000,000	100,170,000.00	18.60
3	122046	10中铁G2	500,000	50,580,000.00	9.39
4	124063	12国网03	400,000	40,464,000.00	7.51
5	122736	12石油03	400,000	40,192,000.00	7.46

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细

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。

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

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

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

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 申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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"16银河G1"的发行主体中国银河证券股份有限公司(以下简称"公司")于2018年7月31日公告,公司于2018年7月27日收到中国人民银行出具的《行政处罚决定书》(银反洗罚决字[2018]第4号),中国人民银行对公司未按照规定履行客户身份识别义务的行为处人民币50万元罚款,与身份不明的客户进行交易的行为处人民币50万元罚款,合计处人民币100万元罚款的行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未出现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。

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,796.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,764,108.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,794,905.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有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在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,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

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,010,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	500,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	510,000,000.00

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.96

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.96	10,000,000.00	1.96	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	1.96	10,000,000.00	1.96	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018-07-01至2018-09-30	1,000,000,000.00	-	500,000,000.00	500,000,000.00	98.04%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 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

10.3 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

富国基金管理有限公司

2018年10月25日

富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:	2018年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式
基金主代码	001641
交易代码	001641
基金运作方式	契约型,本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。
基金合同生效日	2015年09月17日
报告期末基金份额总额(单位:份)	149,730,971.97
投资目标	在有效控制风险的基础上,利用股指期货等金融工具对冲市场波动风险,力争为投资人实现较高的投资收益。
投资策略	本基金根据对市场的判断,采用"多空对冲"等投资策略,在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期银行定期存款基准利率(税后)+3%(如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整)
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,利用股指期货等金融工具对冲市场波动风险,相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准,由于绝对收益策略投资结果的不确定性,因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。
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(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-5,461,641.17
2.本期利润	-3,403,256.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0146
4.期末基金资产净值	160,393,148.59
5.期末基金份额净值	1.071

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。

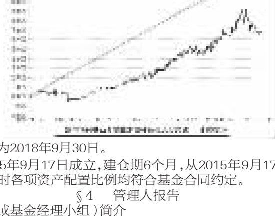
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.20%	0.25%	1.13%	0.01%	-2.33%	0.24%

注:过去三个月指2018年7月1日-2018年9月30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



注:1、截止日期为2018年9月30日。

2、本基金于2015年9月17日成立,建仓期6个月,从2015年9月17日起至2016年3月16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

4.1 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
于鹏	本基金基金经理	2015-11-26	-	11	博士,自2007年3月至2010年8月在HSBC BANK PLC(汇丰银行)任固定收益证券策略分析师;自2011年8月至2012年2月在中国国际金融(香港)有限公司任高级固定收益证券策略分析师;自2012年2月至2012年12月在Millennium Capital Partners LLP任固定收益策略分析师;自2013年4月加入富国基金管理有限公司,2013年4月至2015年10月任投资经理,2015年11月起任富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理,2017年11月起任富国研究量化精选混合型证券投资基金基金经理,2018年3月起任富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内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富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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》、《富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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收益为目标,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权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

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,确保公平对待其所管理的组合。

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,风险管理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、总经理审阅签字后,归档保存,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未出现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

今年以来,股指期货市场的流动性小幅改善,但成交量和持仓量依旧维持低位。虽然今年年初部分期货合约出现升水的状态,但三季度由于市场波动,导致股指期货合约再度迈入贴水区间。在当前市场环境下,本基金保持一定的股票现货仓位积极进行对冲策略操作,并根据基差状态进行动态调整。

本报告期内净值曲线出现了小幅回撤。主要原因在于股指期货升贴水有所波动,影响股票对冲策略的操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-1.20%,同期业绩比较基准收益率为1.13%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	111,604,219.70	67.76
	其中:股票	111,604,219.70	67.76
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,616,090.13	21.63
7	其他资产	17,472,743.76	10.61
8	合计	164,693,053.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	3,970,216.15	2.48
C	制造业	46,601,718.84	29.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,588,376.52	3.48
E	建筑业	4,744,557.23	2.96
F	批发和零售业	3,078,668.26	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	2,658,004.14	1.66
H	住宿和餐饮业	232,320.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	957,703.36	0.60
J	金融业	35,363,659.24	22.05
K	房地产业	4,609,442.46	2.87
L	租赁和商务服务业	921,875.50	0.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	156,288.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	483,846.75	0.30
R	文化、体育和娱乐业	2,237,543.25	1.40
S	综合	-	-
	合计	111,604,219.70	69.58

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

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	601318	中国平安	145,489	9,965,996.50	6.21
2	600036	招商银行	187,414	5,751,735.66	3.59
3	601288	农业银行	1,286,401	5,004,099.89	3.12
4	601398	工商银行	657,658	3,794,686.66	2.37
5	601688	华泰证券	208,624	3,285,828.00	2.05
6	600519	贵州茅台	4,161	3,037,530.00	1.89
7	600030	中信证券	174,400	2,910,736.00	1.81
8	000333	美的集团	52,331	2,108,939.30	1.31
9	600887	伊利股份	72,101	1,851,553.68	1.15
10	600309	万华化学	40,680	1,727,679.60	1.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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细

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。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1812	IF1812	-29.00	-29,914,080.00	-461,506.00	-
IF1811	IF1811	-25.00	-25,764,000.00	-320,884.62	-
IH1810	IH1810	-29.00	-22,660,020.00	-1,243,909.69	-
IC1811	IC1811	-10.00	-9,550,800.00	-34,280.00	-
IC1810	IC1810	-10.00	-9,606,000.00	-151,251.43	-
IC1812	IC1812	-9.00	-8,546,760.00	-2,480.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-2,214,311.74
股指期货投资本期收益(元)					5,372,126.38
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-6,252,866.38

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金不允许投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 申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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"招商银行"的发行主体招商银行股份有限公司(以下简称"公司"),由于公司存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户、为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保、未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目、高管人员在获得任职资格核准前履职、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务、未严格审查贸易背景真实性开立信用证、违规签订保本合同销售同业非保本理财产品、非真实转让信贷资产、违规向典当行发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等违法违规事实,中国银监会于2018年2月12日对公司处以罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元的行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未出现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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,430,584.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,177.43
5	应收申购款	19,981.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,472,743.76

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有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在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	2,108,939.30	1.31	筹划重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,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

单位:份

报告期期初基金份额总额	237,122,972.70
报告期期间基金总申购份额	13,388,966.42
减:报告期期间基金总赎回份额	100,780,967.15
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	149,730,971.97

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,007,200.72
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,007,200.72
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.68

注:买入/申购含红利再投资、转换入份额;卖出/赎回含转换出份额。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,007,200.72	6.68	10,007,200.72	6.68	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,007,200.72	6.68	10,007,200.72	6.68	-

注:本公司运用固有资金认购富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金份额10007200.72份。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018-07-01至2018-09-25	78,632,690.92	9,362,359.55	68,625,490.20	19,369,560.27	12.94%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的文件

2、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同

3、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 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

10.3 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

富国基金管理有限公司

2018年10月25日