

富国稳健增强债券型证券投资基金

2017

第 季 度 报 告

基金管理人：国富基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2017年04月22日

§ 1 重要提示

国富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。

基金管理人国富基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2017年04月20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，保证复核内容真实、准确。报告期内基金管理人不存在违法违规、损害基金份额持有人利益的行为。本报告的投资业绩数据不构成任何保证，基金的过往业绩并不预示其未来业绩的一定波动。

基金的投资有风险，投资者在作出投资决定前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期末未发生诉讼、仲裁事项。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金基本情况											
基金名称	国富稳健增强债券										
基金代码	000107										
基金运作方式	契约型开放式										
基金合同生效日	2015年06月23日										
报告期末基金份额总额	501,001,638.76										
投资目标	本基金追求本金安全，保持资产流动性以及有效规避风险的基础上，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收益。										
投资策略	本基金采用自上而下的方法对资产配置进行动态调整，将资产配置与属类资产配置相结合，再自上而下选择行业和公司(金融债发行机构)的基础上，根据具体资产配置策略在固定收益类资产的范围内，在充分分散投资于利率债及信用债的基础上，配置高信用等级债券对投资组合类别资产进行优化配置和风险控制。										
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%										
风险特征描述	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期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	国富基金管理有限公司										
基金托管人	中国工商银行股份有限公司										
下属分级基金的基本情况	<table><tr><th>国富稳健增强债券A/B</th><th>国富稳健增强债券C</th></tr><tr><td>阶段</td><td>后端</td></tr><tr><td>下属分级基金的代码</td><td>000107 000108 000109</td></tr><tr><td>报告期末下属分级基金的份额总额(单位：份)</td><td>461,462,569.14 44,368,679.62</td></tr></table>			国富稳健增强债券A/B	国富稳健增强债券C	阶段	后端	下属分级基金的代码	000107 000108 000109	报告期末下属分级基金的份额总额(单位：份)	461,462,569.14 44,368,679.62
国富稳健增强债券A/B	国富稳健增强债券C										
阶段	后端										
下属分级基金的代码	000107 000108 000109										
报告期末下属分级基金的份额总额(单位：份)	461,462,569.14 44,368,679.62										

注：1、2016年01月1日起，原国富稳健增强债券证券投资基金变更为国富稳健增强债券型证券投资基金，修改基金合同约定的基金名称、基金的投资范围、投资策略、业绩比较基准、资产负债划分、收益分配、管理费用等事项。修订后的《国富稳健增强债券证券投资基金基金合同》自2016年1月1日起正式生效。修改后的基金名称及基金合同全文见基金管理人网站。

3.1 主要财务指标 单位：人民币元	§3 主要财务指标	报告期（2017年01月01日至2017年03月31日）	A/内 后	报告期（2017年01月01日至2017年03月31日）	C/前
1.本期已实现收益		2,960,541.78		236,580.60	
2.本期利润		2,261,240.06		158,769.68	
3.取平均基金份额本期利润		0.0047		-0.0033	
4.期末基金份额净值		461.679,686.09		44.758,465.05	
5.基金份额净值增长率		1.011		1.009	

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，开户费和管理费申购费、基金转换费等），计入使用户实际收益。

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公允价值变动收益。

3.2 基金业绩归因	§3 基金业绩归因	报告期（2017年01月01日至2017年03月31日）	A/内 后	报告期（2017年01月01日至2017年03月31日）	C/前
1.本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/内后					
阶段	净增值率标准差	业绩比较基准收益标准差	①-③	②-④	
过去三个月	0.38%	0.06%	-0.09%	0.09%	1.07%
过去六个月	0.38%	0.07%	-0.09%	0.09%	1.07%
过去一年	0.38%	0.07%	-0.09%	0.09%	1.07%
(2) B/C/前					
阶段	净增值率标准差	业绩比较基准收益标准差	①-③	②-④	
过去三个月	0.38%	0.07%	-0.09%	0.09%	1.07%
过去六个月	0.38%	0.07%	-0.09%	0.09%	1.07%
过去一年	0.38%	0.07%	-0.09%	0.09%	1.07%

注：过去十二个月指自2017年1月1日至2017年3月31日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 本基金合同生效以来国富稳健增强债券A/B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

注：截止日为2017年3月31日。
注：截止日为2015年06月23日成立，截至每个月末，从2015年7月1日起至2016年11月20日，建仓期间各资产类别资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自2016年1月1日起，原国富稳健增强债券证券投资基金变更为国富稳健增强债券型证券投资基金，修改基金合同约定的基金名称、基金的投资范围、投资策略、业绩比较基准、资产负债划分、收益分配、管理费用等事项。修订后的《国富稳健增强债券证券投资基金基金合同》自2016年1月1日起正式生效。修改后的基金名称及基金合同全文见基金管理人网站。

4.1 基金管理人、基金管理人简介	§4 管理人	报告期（2017年01月01日至2017年03月31日）	A/内 后	报告期（2017年01月01日至2017年03月31日）	C/前
姓名	职务	任职日期	离任日期	任职年限	说明
李羿	基金经理兼资产管理部副经理	2017-03-24	-	4	

注：1、上述任期为自报告期公司披露的聘任日期起，截至自报告期公司所规定的聘期届满时止；若其基本符合自报告期至基金合同终止之日止的任期要求。

2、基金经理是指通过公开募集证券投资基金管理人资格认定的自然人或其授权代表，并符合中国证监会《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》以及有关法规和基金合同的有关规定，并经中国证监会核准从事基金管理业务的自然人。

3、2016年12月31日，国富基金管理有限公司资产管理规模如下表所示：

注：以上数据为截至2016年12月31日的数据，单位为亿元人民币。

4、截至2016年12月31日，国富基金管理有限公司管理的公募基金资产净值总额为1,011.46亿元。

5、截至2016年12月31日，国富基金管理有限公司管理的公募基金资产净值总额为1,011.46亿元。

6、截至2016年12月31日，国富基金管理有限公司管理的公募基金资产净值总额为1,011.46亿元。

7、截至2016年12月31日，国富基金管理有限公司管理的公募基金资产净值总额为1,011.46亿元。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,898,015.60	1.68
	其中:股票	8,898,015.60	1.68
2	固定收益投资	494,762,674.40	96.31
	其中:债券	494,762,674.40	96.31
	资产支持证券	-	-
3	货币投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	44,300,427.20	7.98
	其中:买入返售金融资产-逆回购金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,517,667.48	0.45
7	其他资产	20,644,099.58	3.68
8	合计	561,643,066.54	100.00

§5 报告期末按行业分类的公允价值投资组合

报告期末按公允价值列示的公允价值投资组合

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	医药	-	-
C	制造业	6,525,910.00	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,218,013.00	0.24
F	批发和零售业	1,154,962.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	公共服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		8,898,015.60	1.76

注：1、本报告期末公允价值投资组合中公允价值列示的

富国文体健康股票型证券投资基金

[illegible]

富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金

[illegible]

富国文体健康股票型证券投资基金

季 度 报 告