富国安益货币市场基金

【2017】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：	2017年04月22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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4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2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国安益货币
基金主代码	000602
交易代码	000602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年05月26日
报告期末基金份额总额（单位：份）	10,003,817,750.65
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 在投资管理过程中，基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

注：富国基金管理有限公司于2017年4月13日发布了《富国基金管理有限公司关于“富国收益宝货币市场基金”变更基金名称的公告》，自2017年4月13日起，本基金名称由“富国收益宝货币市场基金”变更为“富国安益货币市场基金”。富国基金管理有限公司将根据基金名称的变更，对法律文件的相应条款进行修改。变更事项自公告之日起生效。

§3 主要财务指标和基金净值表现

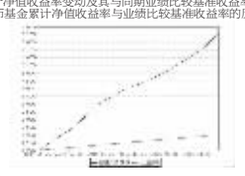
3.1主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年01月01日-2017年03月31日）
1.本期已实现收益	70,745,641.39
2.本期利润	70,745,641.39
3.期末基金资产净值	10,003,817,750.65

注：上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3.2基金净值表现
3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9033%	0.0008%	0.0875%	0.0000%	0.8158%	0.0008%

注：过去三个月指2017年1月1日－2017年3月31日。
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
自基金合同生效以来富国安益货币基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2017年3月31日。
2、本基金于2014年5月26日成立，建仓期6个月，从2014年5月26日起至2014年11月25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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万莉	本基金基金经理兼任固定收益投资部副总监，富国天时货币市场基金、富国天时货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理	2015-10-09	-	11	硕士，自2006年7月至2008年6月在广州银行任债券交易员；自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作，历任债券交易员、基金经理助理、基金经理；自2013年7月至2014年6月在中融基金（原通富基金）管理有限公司工作，任现金管理投资总监；自2014年6月加入富国基金管理有限公司，2014年6月至2015年10月任固定收益投资部现金管理主管，2015年10月起任富国天时货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年12月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理。现任固定收益投资部现金投资总监兼基金经理。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安益货币市场基金（原富国欧益宝货币市场基金）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》、《富国收益宝货币市场基金基金合同》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的增长为目标，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，监察稽核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
2017年1季度，央行分别上调了各货币政策工具的利率。调常备借贷便利(SLF)于2月3日起，隔夜、7天、1个月利率分别从2.75%、3.25%、3.6%上调至3.1%、3.35%和3.7%，又在3月16日，分别上调至3.3%、3.45%和3.8%。中期接待便利（MLF）于1月24日起，半年期和一年期分别从2.85%和3.00%上调至2.95%和3.10%，又在3月16日分别上调至3.05%和3.2%。公开市场操作（OMO）于2月3日起，7天、14天、28天分别上调10bp至2.35%、2.5%、2.65%，又在3月16日再上调10bp至2.45%、2.6%、2.75%。央行于春节前为保证资金投放的集中性需求，促进银行体系流动性和货币市场平稳运行，将通过“临时流动性便利（TLF）”操作，为在现金投放中占比高的几家大型商业银行，提供临时流动性支持。1季度银行MPA考核难度高于2016年，央行将表外理财纳入广义信贷范围以及取消4%的资本充足率资产权重，并且对不达标银行加大惩罚力度，导致季末整体资金一直处于偏紧状态。
在此基础上一年期AAA短期融资券的收益率在1月上半月下行并反弹回3.8%后，于2月初上升至4.0%附近，此后持续在4%附近波动，直至3月中旬4.3%附近。一年期国开债收益率一路震荡上行，2月初上升至3.4%附近，3月中旬上升至3.6%附近。
报告期内，本基金秉承稳健投资原则，谨慎操作，根据流动性情况保持了一定比例的银行存单、短期融资券、短期存款、银行间逆回购等大类资产的配置，并根据组合持仓情况进行了一定的调整，组合总体流动性较好。
4.5报告期内基金的业绩表现
本报告期，本基金份额净值收益率为0.9033%，同期业绩比较基准收益率为0.0875%
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	固定收益投资	9,951,454,647.30	99.46
	其中：债券	9,951,454,647.30	99.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	42,742,407.21	0.43
4	其他资产	11,749,568.77	0.12
5	合计	10,005,946,623.28	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

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	76,667,387.36	4.01
C	制造业	1,213,507,599.95	63.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,551,752.98	0.97
F	批发和零售业	40,346,071.20	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	4,814,314.89	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	231,790,412.24	12.12
J	金融业	82,236,964.78	4.30
K	房地产业	23,473,056.00	1.23
L	租赁和商务服务业	84,904,108.76	4.44
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	9,475,724.00	0.50
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	13,218,002.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	1,799,002,324.32	94.09

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	002271	东方雨虹	6,645,747	177,441,444.90	9.28
2	300310	宜通世纪	6,432,570	164,233,256.24	8.59
3	000581	威孚高科	6,783,576	155,004,711.60	8.11
4	002094	青岛金王	3,842,706	100,333,063.66	5.25
5	002117	东港股份	2,808,803	84,376,442.12	4.41
6	600309	万华化学	2,941,391	79,741,110.01	4.17
7	600519	贵州茅台	200,000	77,272,000.00	4.04
8	002572	索菲亚	1,000,000	68,900,000.00	3.60
9	600487	亨通光电	2,311,695	59,549,263.20	3.11
10	000630	铜陵有色	18,266,600	57,905,122.00	3.03

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,500,000.00	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,500,000.00	0.13

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	113011	光大转债	25,000	2,500,000.00	0.13

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。
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	411,145.28
2	应收证券清算款	10,520,646.60
3	应收股利	-
4	应收利息	39,324.20
5	应收申购款	533,178.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,503,295.03

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	300310	宜通世纪	24,466,422.08	1.28	非公开发行股票

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	1,504,079,687.62
报告期期间基金总申购份额	13,578,604.21
减：报告期期间基金总赎回份额	45,830,490.02
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	1,471,827,801.81

§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	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告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汉博证券投资基金的文件
2、汉博证券投资基金基金合同
3、汉博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、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
6、富国天博创新主题混合型证券投资基金基金合同
7、富国天博创新主题混合型证券投资基金托管协议
8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注
9、富国天博创新主题混合型证券投资基金财务报表及报表附注
10、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
2017年04月22日

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.00	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。
5.3基金投资组合平均剩余期限
5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

序号	项目	天数
	报告期末投资组合平均剩余期限	69
	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
	报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。
5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	62.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	0.16	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-120天	0.75	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）-397天（含）	18.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.90	-

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。
5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	1,126,785,857.13	11.26
	其中：政策性金融债	1,126,785,857.13	11.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,824,668,790.17	88.21
8	其他	-	-
9	合计	9,951,454,647.30	99.48
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111717079	17光大银行CD079	7,800,000.00	763,347,000.06	7.63
2	111708009	17中信银行CD009	6,000,000.00	598,451,150.76	5.98
3	111707032	17招商银行CD032	6,000,000.00	598,451,150.76	5.98
4	111717010	17光大银行CD010	6,000,000.00	598,451,150.76	5.98
5	111709024	17浦发银行CD024	6,000,000.00	598,346,081.91	5.98
6	111710015	17兴业银行CD015	5,000,000.00	499,415,643.15	4.99
7	111718077	17华夏银行CD077	5,000,000.00	496,031,954.97	4.96
8	111710115	17兴业银行CD115	5,000,000.00	496,031,954.97	4.96
9	111714097	17江苏银行CD097	5,000,000.00	495,731,490.70	4.96
10	111712006	17北京银行CD006	4,700,000.00	469,443,704.22	4.69

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0790%
报告期内偏离度的最低值	-0.0869%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0432%

注：以上数据按工作日统计
报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
注：本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
注：本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。
5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
5.9投资组合报告附注
5.9.1基金计价方法说明。
本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。
本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。
5.9.2声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。
5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,749,568.77
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,749,568.77

5.9.4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	1,000,943,530.52
报告期期间基金总申购份额	9,070,775,369.68
减：报告期期间基金总赎回份额	67,901,149.55
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	10,003,817,750.65

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	-	13.36	13.36	-
2	赎回	2017-02-07	-2,814.76	-2,814.76	-
合计			-2,801.40	-2,801.40	

注：由于本基金“每日分配、按日支付”，故红利再投金额为2017年1月1日至2017年3月31日期间每日红利再投金额总和，且无相应申购费用。

§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者超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-03至2017-03-31	1,000,024,504.93	9,069,868.98227	-67,802.373.36	10,002,091.09.94	99.99%
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，申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。							

§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收益宝货币市场基金的文件
2、富国收益宝货币市场基金基金合同
3、富国收益宝货币市场基金托管协议
4、《富国基金管理有限公司关于富国收益宝货币市场基金变更基金名称的公告》
5、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
6、富国收益宝货币市场基金财务报表及报表附注
7、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
2017年04月22日

富国天博创新主题混合型证券投资基金

【2017】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：	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：	2017年04月22日

§1 重要提示

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2017年4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2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天博创新混合
基金主代码	519035
交易代码	前端交易代码：519035 后端交易代码：519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年04月27日
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,471,827,801.81
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司，在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上，力争实现资本的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%＋中债综合全价指数收益率×15%＋同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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

§3 主要财务指标和基金净值表现

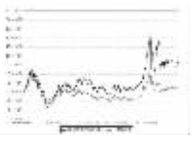
3.1主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年01月01日-2017年03月31日）
1.本期已实现收益	-86,335,254.17
2.本期利润	74,996,118.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0502
4.期末基金资产净值	1,912,060,466.66
5.期末基金份额净值	1.2991

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	3.99%	0.84%	3.34%	0.41%	0.65%	0.43%

注：过去三个月指2017年1月1日－2017年3月31日。
3.2.2自基金转型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2017年3月31日。
2、本基金于2007年4月27日由原汉博证券投资基金转型而成，建仓期6个月，从2007年4月27日至2007年10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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毕天宇	本基金基金经理兼任权益投资副总监、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金基金经理	2007-04-27	-	17	硕士，曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理；中国北方工业上海公司经理助理；兴业证券股份有限公司研究员；2002年3月至2005年10月任富国基金管理有限公司行业研究员，2005年11月至2007年4月任汉博证券投资基金基金经理，2007年4月至今任富国天博创新主题混合型证券投资基金基金经理，2014年6月起兼任富国高端制造行业股票型证券投资基金基金经理，2015年6月起兼任富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金基金经理；2016年2月起兼任富国城镇发展股票型证券投资基金基金经理；兼任权益投资副总监。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天博创新主题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》、《富国天博创新主题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的增长为目标，管理和运用基金资产，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，监察稽核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
一季度沪深300指数上涨4.4%，创业板下跌2.7%。市场风格分化明显，高分红、低估值蓝筹类个股延续了去年上涨趋势，中小盘个股整体表现不佳。
天博基金期初组合在行业和风格方面配置相对均衡，重