

富国宏观策略灵活配置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	中国工商银行股份有限公司
报告期截至日期	2017年03月31日

§ 1 重要提示
富国基金管理有限公司的董事会及高级管理人员保证本基金披露的信息真实、准确、完整、及时。但本基金披露的信息不构成任何投资建议，投资者依据该信息进行投资决策，风险自担。
本基金基金管理人承诺以诚实信用、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预示其未来表现。投资者投资于本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金财务资料未经审计。

本报告书财务资料未经审计。

本报告书由2017年1月1日起至2017年3月31日。

§ 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

基金主代码 000029

前端费用率 0.65%+0.15%

后端费用率 0.00%

基金的投资方式 契约型开放式

基金合同生效日 2013年04月12日

报告期基金单位净值(单位:元) 144.859 0.3762

投资目标 本基金通过深入挖掘合理的大型资产配置与专业的个股选择，实现基金资产的长期回报。

投资范围 本基金将投资于“自下而上”相结合的资产配置管理策略，将资产分析与配置分析贯穿于资产配置、行业配置、个股选择等各个环节。

投资策略 本基金将利用“自下而上”相结合的资产配置管理策略，将资产分析与配置分析贯穿于资产配置、行业配置、个股选择等各个环节。

业绩比较基准 95%×沪深300指数+5%+银行存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为混合型基金，其风险收益特征介于股票型基金与货币市场基金，低于股票型基金，高于货币市场基金。

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

§ 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 4,548,570.02

2.本期利润 8,857,103.60

3.加权平均基金份额本期利润 0.0628

4.期末基金资产净值 204,106,794.00

5.期末基金份额净值 1.409

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),计划买入后收益水平将低于上述列数据。

本报告期已实现收益指基金利息收入、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

3.2.1 本基金基金份额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 份额增长(%) 份额增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.76% 0.04% 2.74% 0.34% 2.02% 0.02%

注:过去三个月指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

3.2.3 本基金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

序号 基金代码 基金名称 份额(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000029 富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金 116,540 7,645,024.00 3.75

2 002611 中银中国 233,050 6,002,306.00 3.23

3 300107 银华领先 311,176 4,049,748.00 2.04

4 000013 汇添富基金 467,000 4,991,630.00 2.37

5 001117 信诚基金 365,000 4,991,630.00 2.37

6 000011 信诚基金 400,000 4,952,300.00 2.09

7 000707 方正富邦 480,000 5,945,244.00 1.03

8 000491 南方进取 349,000 3,941,440.00 1.03

9 000602 安信基金 403,000 3,960,630.00 1.00

10 002286 华商基金 170,400 3,762,422.00 1.04

5.4 份额申购/赎回价格品种分布的基金投资组合

序号 基金代码 基金名称 份额(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国泰基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

2 大成基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

3 金鹰基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

4 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

5 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

6 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

7 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

8 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

9 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

10 金信基金 0.991,000,000 0.991,000,000 4.09

5.5 份额申购/赎回价格品种分布的基金投资组合

序号 基金代码 基金名称 份额(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000029 富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金 100,000,000 100,000,000 4.09

2 002611 中银中国 100,000,000 100,000,000 4.09

3 300107 银华领先 100,000,000 100,000,000 4.09

4 000013 汇添富基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5 001117 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

6 000011 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

7 000707 方正富邦 100,000,000 100,000,000 4.09

8 000491 南方进取 100,000,000 100,000,000 4.09

9 000602 安信基金 100,000,000 100,000,000 4.09

10 002286 华商基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5.6 份额申购/赎回价格品种分布的基金投资组合

序号 基金代码 基金名称 份额(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000029 富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金 100,000,000 100,000,000 4.09

2 002611 中银中国 100,000,000 100,000,000 4.09

3 300107 银华领先 100,000,000 100,000,000 4.09

4 000013 汇添富基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5 001117 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

6 000011 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

7 000707 方正富邦 100,000,000 100,000,000 4.09

8 000491 南方进取 100,000,000 100,000,000 4.09

9 000602 安信基金 100,000,000 100,000,000 4.09

10 002286 华商基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5.7 份额申购/赎回价格品种分布的基金投资组合

序号 基金代码 基金名称 份额(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000029 富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金 100,000,000 100,000,000 4.09

2 002611 中银中国 100,000,000 100,000,000 4.09

3 300107 银华领先 100,000,000 100,000,000 4.09

4 000013 汇添富基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5 001117 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

6 000011 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

7 000707 方正富邦 100,000,000 100,000,000 4.09

8 000491 南方进取 100,000,000 100,000,000 4.09

9 000602 安信基金 100,000,000 100,000,000 4.09

10 002286 华商基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5.8 份额申购/赎回价格品种分布的基金投资组合

序号 基金代码 基金名称 份额(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000029 富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金 100,000,000 100,000,000 4.09

2 002611 中银中国 100,000,000 100,000,000 4.09

3 300107 银华领先 100,000,000 100,000,000 4.09

4 000013 汇添富基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5 001117 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

6 000011 信诚基金 100,000,000 100,000,000 4.09

7 000707 方正富邦 100,000,000 100,000,000 4.09

8 000491 南方进取 100,000,000 100,000,000 4.09

9 000602 安信基金 100,000,000 100,000,000 4.09

10 002286 华商基金 100,000,000 100,000,000 4.09

5.9 备查文件目录

5.10 本报告期无重大关联交易。

5.11 本报告期无关联交易的说明。

5.12 本报告期无重大关联交易的说明。

5.13 本报告期无重大关联交易的说明。

5.14 本报告期无重大关联交易的说明。