富国汇利回报分级债券型证券投资基金

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:	中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	富国汇利回报分级债券		
场内简称	富国汇利		
基金主代码	161014		
基金运作方式	契约型开放式。		
基金合同生效日	2013年09月09日		
报告期末基金份额总额(单位:份)	1,634,831,548.44		
投资目标	本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。		
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会,发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种;另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险,从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。		
业绩比较基准	中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。		
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,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	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国汇利回报分级债券A	富国汇利回报分级债券B	富国汇利分级债券
下属分级基金场内简称	汇利A	汇利B	汇利分级
下属分级基金的交易代码	150020	150021	161014
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	358,454,790.00	153,623,482.00	1,122,753,276.44
下属分级基金的风险收益特征	汇利A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征	汇利B份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征	从基金资产整体运作来看,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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

§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	15,332,583.30
2.本期利润	-215,575.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0001
4.期末基金资产净值	1,711,982,129.08
5.期末基金份额净值	1.047

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。

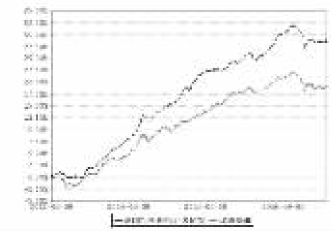
3.2基金净值表现

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	0.00%	0.08%	-0.34%	0.07%	0.34%	0.01%

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2013年9月9日成立,建仓期6个月,从2013年9月9日起至2014年3月8日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3其他指标

其他指标	报告期末(2017年03月31日)
富国汇利A与富国汇利B基金份额配比	7:3
期末富国汇利A份额参考净值	1.054
期末富国汇利A份额累计参考净值	1.054
期末富国汇利B份额参考净值	1.031
期末富国汇利B份额累计参考净值	1.031
富国汇利A的预计年收益率	3.90%

§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		
黄纪亮	本基金基金经理兼任富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国产业债债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理	2014-03-26	-	9	硕士,曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员;2012年11月至2013年2月任富国基金管理有限公司债券研究员;2013年2月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起任富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金经理和富国天利增长债券投资基金基金经理,2014年6月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理,2016年8月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2016年9月起任富国产业债债券型证券投资基金、富国睿利定期开放混合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汇利回报分级债券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》、《富国汇利回报分级债券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,以为投资者减少和分散风险、确保基金资产的安全并谋求基金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,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年一季度,经济和通胀保持平稳,流动性维持紧平衡。受央行提高公开市场操作利率影响,债券市场在短暂回暖后,延续调整,各品种收益率均有所上行。本基金适时调整组合,减持部分信用债券,并调整部分转债仓位。2017年二季度本基金将优化持仓结构,注重票息收入,把握债券市场调整后的趋势行情,争取为基金持有人带来可持续的投资回报。

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0.0%,同期业绩比较基准收益率为-0.34%

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,306,362,232.60	90.59
	其中:债券	2,306,362,232.60	90.59
	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	155,350,473.03	6.10
	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	35,966,291.28	1.41
7	其他资产	48,192,535.62	1.89
8	合计	2,545,871,532.53	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	71,237,000.00	4.16
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,076,293,448.30	121.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	58,250,000.00	3.40
7	可转债(可交换债)	52,366,784.30	3.06
8	同业存单	-	-
9	其他	48,215,000.00	2.82
10	合计	2,306,362,232.60	134.72

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	122865	10苏海发	610,000	61,183,000.00	3.57
2	1180092	11泰医高债	500,000	51,775,000.00	3.02
3	1380167	13武汉新港债	500,000	51,685,000.00	3.02
4	123306	14财通02	500,000	51,115,000.00	2.99
5	122067	11南钢债	500,000	50,355,000.00	2.94

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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定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	19,974.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	48,172,560.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,192,535.62

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	110035	白云转债	17,093,767.60	1.00
2	113008	电气转债	10,069,840.00	0.59
3	110032	三一转债	8,010,757.80	0.47
4	110033	国贸转债	3,447,300.00	0.20
5	132004	15国盛EB	2,475,741.60	0.14
6	127003	海印转债	1,241,192.70	0.07
7	128011	汽模转债	695,961.70	0.04
8	113009	广汽转债	446,859.00	0.03

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	1,634,831,548.44
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	-
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	1,634,831,548.44

§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汇利分级债券型证券投资基金的文件
2、富国汇利分级债券型证券投资基金基金合同
3、富国汇利分级债券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、富国汇利分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注
6、富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金合同
7、富国汇利回报分级债券型证券投资基金托管协议
8、富国汇利回报分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注
9、中国证券监督管理委员会《关于富国汇利分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》
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

富国价值优势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:	中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	富国价值优势混合
基金主代码	002340
交易代码	002340
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年04月08日
报告期末基金份额总额(单位:份)	155,737,944.67
投资目标	本基金运用价值投资方法,通过精选个股和严格风险控制,力争获取中长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置,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,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%
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	中国农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(2017年01月01日-2017年03月31日)
1.本期已实现收益	-635,388.67
2.本期利润	3,864,079.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0383
4.期末基金资产净值	180,183,651.26
5.期末基金份额净值	1.157

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。

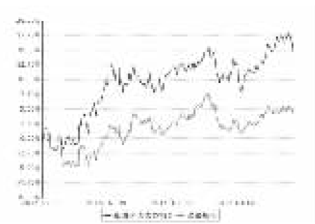
3.2基金净值表现

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	4.42%	0.74%	2.74%	0.44%	1.68%	0.30%

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2016年4月8日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,从2016年4月8日起至2016年10月7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		
王海军	本基金基金经理兼任富国国家安全主题混合型证券投资基金基金经理	2016-04-08	-	10	硕士,曾任中国建银投资证券有限公司高级分析师;2010年3月至2012年6月担任富国基金管理有限公司高级行业研究员,2012年6月至2015年11月担任富国高新技术产业混合型证券投资基金基金经理,2015年5月起任富国国家安全主题混合型证券投资基金基金经理,2016年4月起任富国价值优势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价值优势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》、《富国价值优势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,以为投资者减少和分散风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标,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

2017年第一季度里,国内宏观环境相对平稳,供给侧改革继续维持积极的发展趋势。本基金通过自下而上对行业和具体投资标的进行筛选,继续对具有价值优势的公司进行跟踪和配置,以降低整个基金产品净值的波动率。

本基金秉承追求风险可控、持续较长时间的相对收益为目标,继续维持对质地优良、竞争壁垒较高、管理层执行力强、分红回报率较好、估值较低的公司进行配置,可能的配置方向为食品饮料、化工、电子、计算机、银行、保险、医药、家电、汽车、机械、环保等行业。

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4.42%,同期业绩比较基准收益率为2.74%

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	权益投资	166,708,230.51	92.22
	其中:股票	166,708,230.51	92.22
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	10,970,183.22	6.07
7	其他资产	3,098,701.96	1.71
8	合计	180,777,115.69	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	-	-
C	制造业	112,880,267.23	62.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,158,796.64	2.86
F	批发和零售业	10,675,573.94	5.92
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	11,069,300.66	6.14
J	金融业	14,360,497.02	7.97
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,775,977.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	9,770,887.86	5.42
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	166,708,230.51	92.52

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	600703	三安光电	1,026,003	16,405,787.97	9.11
2	600887	伊利股份	474,967	8,981,625.97	4.98
3	600036	招商银行	467,606	8,964,007.02	4.97
4	300287	飞利信	562,252	5,779,950.56	3.21
5	002466	天齐锂业	131,624	5,686,156.80	3.16
6	000963	华东医药	61,082	5,659,247.30	3.14
7	600309	万华化学	207,156	5,615,999.16	3.12
8	000423	东阿阿胶	83,978	5,508,956.80	3.06
9	600056	中国医药	232,900	5,505,756.00	3.06
10	002465	海格通信	461,300	5,415,662.00	3.01

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

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,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	78,485.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,167.53
5	应收申购款	3,017,049.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,098,701.96

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

报告期期初基金份额总额	82,920,004.69
报告期期间基金总申购份额	97,466,964.65
减:报告期期间基金总赎回份额	24,649,024.67
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	155,737,944.67

§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	8,840,848.81
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	8,840,848.81
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.68

7.2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	申购	2017-02-17	8,840,848.81	10,000,000.00	-
合计			8,840,848.81	10,000,000.00	

注:申购适用固定费率1000元。

§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价值优势混合型证券投资基金的文件
2、富国价值优势混合型证券投资基金基金合同
3、富国价值优势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、富国价值优势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
2017年04月22日

富国久利稳健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	603,995,657.29	
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)	501,421,699.43	102,573,957.86

§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(2017年01月01日-2017年03月31日)	C级 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)
1.本期已实现收益	2,961,301.47	498,340.09
2.本期利润	3,009,924.13	502,858.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0046
4.期末基金资产净值	504,511,001.30	103,097,473.29
5.期末基金份额净值	1.0062	1.0051

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

主要财务指标	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

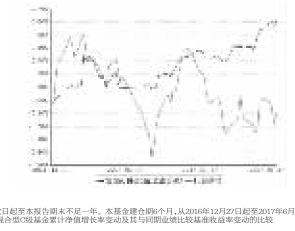
(2)C级

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	0.47%	0.05%	-0.41%	0.11%	0.88%	-0.06%

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

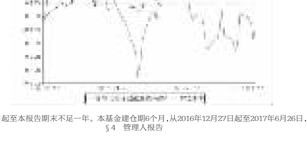
(1)自基金合同生效以来富国久利稳健配置混合型A级基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为2017年3月31日。

2、本基金于2016年12月27日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,从2016年12月27日起至2017年6月26日,本期末建仓期还未结束。

(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2017年3月31日。

2、本基金于2016年12月27日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,从2016年12月27日起至2017年6月26日,本期末建仓期还未结束。

§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		
陈连权	本基金基金经理兼任固定收益投资总监、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金基金经理	2016-12-27	-	10	硕士,自2007年8月至2015年5月在交银施罗德基金管理有限公司工作,历任数量分析师、信用分析师/宏观债券分析师、专户投资部专户副总经理兼投资经理;2015年5月加入富国基金管理有限公司,历任固定收益研究部总经理、固定收益专户投资部总经理,2016年5月起任富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理,2016年6月起任富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金,2016年12月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理,2017年1月起任富国富利稳健配置混合型证券投资基金基金经理;兼固定收益投资总监。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,确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,经济增长总体延续2016年四季度的特征,宏观上仍然呈现底部震荡特征,而中观上维持着较高的景气度。1-2月份工业增加同比增长6.3%,尚未显著脱离2016年以来的L型特征,制造业PMI由2016年12月份的51.4反弹至3月份的51.8,铁路货运量等中观行业指标也保持着较高景气度。价格方面,PPI继续上扬至2月份的7.8%,但部分工业品价格似乎有筑顶的迹象,消费品价格维持平稳,2月份CPI下降至0.8%。需求方面,冷热不均的状况没有根本改变,2月份,房地产开发投资累计同比上升至8.9%,基建与制造业投资数据亦有所上升,而社会消费品零售总额同比则下降至9.5%。海外方面,全球通胀预期仍然存在,美联储延续加息,并开始讨论缩表,全球流动性仍然处于动荡的状态。

在上述背景下,国内债券收益率处于阶段性筑顶过程当中,由于金融层面的去杠杆约束未根本解除,无风险利率与信用利差都呈现出阶段性高位震荡的特征。

一季度,本基金处于成立初期的安全垫构筑阶段,超配了短端品种,提升基础资产的静态收益,同时,在风险预算控制下,适度参与长端、信用、权益品种的交易机会。

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0.58%,C级为0.47%,同期业绩比较基准收益率A级为-0.41%,C级为-0.41%

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	权益投资	2,537,638.00	0.33
	其中:股票	2,537,638.00	0.33
2	固定收益投资	719,878,600.00	94.79
	其中:债券	719,878,600.00	94.79
	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	24,153,321.26	3.18
7	其他资产	12,891,692.16	1.70
8	合计	759,461,251.42	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

序号	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	-	-
C	制造业	1,915,652.00	0.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	621,986.00	0.10
F	批发和零售业	-	-
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	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	2,537,638.00	0.42

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	600585	海螺水泥	31,300	649,162.00	0.11
2	000423	东阿阿胶	9,800	642,880.00	0.11
3	600117	西宁特钢	101,400	623,610.00	0.10
4	601390	中国中铁	70,600	621,986.00	0.10

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	39,820,000.00	6.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	224,956,000.00	37.02
	其中:政策性金融债	194,872,000.00	32.07
4	企业债券	83,776,000.00	13.79
5	企业短期融资券	39,910,000.00	6.57
6	中期票据	18,111,600.00	2.98
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	313,305,000.00	51.56
9	其他	-	-
10	合计	719,878,600.00	118.48

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	160213	16国开13	1,900,000	175,180,000.00	28.83
2	111716004	17上海银行CD004	600,000	58,770,000.00	9.67
3	111707033	17招商银行CD033	500,000	49,480,000.00	8.14
4	111711031	17平安银行CD031	500,000	48,980,000.00	8.06
5	160024	16附息国债24	400,000	39,820,000.00	6.55

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。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"13兴业03"的发行主体兴业证券股份有限公司(以下简称"公司")于2016年7月28日公告称公司于2016年7月27日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚决定书》(〔2016〕91号),因公司在推荐欣泰电气首次公开发行股票并在创业板上市过程中,未遵守业务规则和行业规范,未勤勉尽责地对欣泰电气IPO申请文件及公开发行募集文件进行审慎核查,中国证监会决定对公司给予警告,没收保荐业务收入1,200万元,并处以2,400万元罚款;没收承销股票违法所得2,078万元,并处以60万元罚款。

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	4,759.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,460,336.07
5	应收申购款	2,426,596.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,891,692.16

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	542,327,118.21	112,492,643.08
报告期期间基金总申购份额	371,459.10	2,531,249.72
减:报告期期间基金总赎回份额	41,276,877.88	12,449,934.94
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	501,421,699.43	102,573,957.86

§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
2017年04月22日