富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

2017年第四季度报告

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01月20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1月18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10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国新兴成长量化精选混合（LOF）
场内简称	成长量化
基金主代码	161038
交易代码	161038
基金运作方式	契约型，开放式。
基金合同生效日	2017年07月21日
报告期末基金份额总额（单位:份）	149,810,320.23
投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用数量化投资方法建立新兴成长行业投资模型，将投资思想通过具体的财务指标、行情指标和模型参数体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔等优势，切实贯彻自上而下的大类资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率×47.5%＋创业板指数收益率×47.5%＋银行活期存款利率（税后）×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10月01日-2017年12月31日）
1.本期已实现收益	9,277,214.00
2.本期利润	-1,940,765.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0105
4.期末基金资产净值	153,091,606.07
5.期末基金份额净值	1.0219

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	-2.27%	0.88%	-5.42%	0.97%	3.15%	-0.09%

注：过去三个月指2017年10月1日－2017年12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12月31日。

2、本基金于2017年7月21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2017年7月21日起至2018年1月20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		
方旻	本基金基金经理兼任量化投资副总监，富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国沪深300指数证券投资基金、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理	2017-07-21	-	8	硕士，自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015年5月起任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金的基金经理，2015年10月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017年6月起任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；兼任量化投资副总监，具有基金从业资格。
张圣烨	本基金基金经理兼任量化投资部副总监，富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证工业4G指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理	2017-07-21	-	11	硕士，自2007年7月至2015年3月任上海申银万国证券研究所有限公司分析师；自2015年3月至2015年6月任富国基金管理有限公司基金经理助理；2015年6月起任富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理；自2015年8月起任富国中证工业4G指数分级证券投资基金、富国中证工业4G指数分级证券投资基金基金经理，2016年2月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理兼量化投资部副总监助理，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新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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》、《富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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

由于国庆期间美国股市在超预期的经济数据带动下出现大幅上涨，同时国内9月PMI数据也超预期，10月初以来A股稳步上涨。进入10月中旬，随着“十九大”会议的召开，市场总体表现平稳。10月下旬，受贵州茅台发布超预期三季报的提振，上证50及白酒板块迎来大幅上涨。而受乐视季报大幅亏损的影响，创业板指数出现大幅下跌。进入11月中旬，随着贵州茅台持续创新高，引发媒体和监管层关注，同时伴随着10月经济数据低于预期，市场迎来一轮快速调整。在经历11月下旬的快速调整后，12月以来，市场进入震荡整理阶段。从结构看，以贵州茅台、中国平安等为代表的白马股仍是市场集中抱团的主要对象，以中证500、创业板指为代表的中小股票表现仍较弱。总体来看，2017年4季度市场结构分化依旧，其中上证综指下跌1.25%，沪深300上涨5.07%，创业板指下跌6.12%，中证500指数下跌5.34%。

在投资管理上，我们坚持采取主动量化策略进行指数增强和风险管理，积极获取超额收益率。

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-2.27%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%

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	138,368,776.30	89.69
	其中:股票	138,368,776.30	89.69
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	9,249,829.42	6.00
7	其他资产	6,657,634.34	4.32
8	合计	154,276,240.06	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	1,503,374.00	0.98
B	采矿业	2,419,692.00	1.58
C	制造业	82,392,380.61	53.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,912,198.00	1.90
E	建筑业	4,103,370.00	2.68
F	批发和零售业	5,961,826.00	3.89
G	交通运输、仓储和邮政业	2,711,606.00	1.77
H	住宿和餐饮业	2,267,725.77	1.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,864,726.72	11.02
J	金融业	2,504,244.00	1.64
K	房地产业	8,510,500.00	5.56
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	3,004,774.20	1.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,329,644.00	1.52
R	文化、体育和娱乐业	892,715.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	138,368,776.30	90.38

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	600519	贵州茅台	6,100	4,254,689.00	2.78
2	000858	柳工	393,400	3,395,702.00	2.19
3	002146	荣盛发展	347,100	3,307,863.00	2.16
4	000681	威孚高科	131,500	3,156,000.00	2.06
5	600580	卧龙电气	386,000	3,091,860.00	2.02
6	600502	安徽水利	444,600	3,063,294.00	2.00
7	000338	潍柴动力	364,000	3,035,760.00	1.98
8	000157	中联重科	676,000	3,021,720.00	1.97
9	600060	华侨城A	333,100	2,828,019.00	1.85
10	600449	宁夏建材	245,200	2,790,668.00	1.82

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

本基金根据合同约定，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	176,546.92
2	应收证券清算款	6,446,465.70
3	应收股利	-
4	应收利息	709.15
5	应收申购款	33,922.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,657,634.34

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	286,785,622.81
报告期期间基金总申购份额	6,237,623.19
减:报告期期间基金总赎回份额	143,212,925.77
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	149,810,320.23

§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新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）的文件

2、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同

3、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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01月20日

富国新优享灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

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：	2018年01月20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2018年1月18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10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国新优享灵活配置混合
基金主代码	004737
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月09日
报告期末基金份额总额	326,362,356.20
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
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、公司价值评估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*20%+中债综合指数收益率*80%
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

下属分级基金的基金简称	富国新优享灵活配置混合A	富国新优享灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	004737	004747
报告期末下属分级基金的份额总额（单位:份）	110,678,970.36	215,683,385.84

§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10月01日-2017年12月31日）	C级 报告期（2017年10月01日-2017年12月31日）
1.本期已实现收益	4,130,488.08	7,083,585.01
2.本期利润	4,946,452.37	5,062,938.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.0227
4.期末基金资产净值	116,308,496.92	225,266,255.81
5.期末基金份额净值	1.0509	1.0444

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	3.18%	0.27%	0.68%	0.16%	2.50%	0.11%

（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	2.83%	0.27%	0.68%	0.16%	2.15%	0.11%

注：过去三个月指2017年10月1日－2017年12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新优享灵活配置混合A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12月31日。

2、本基金于2017年8月9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2017年8月9日起至2018年2月8日，本期末建仓期还未结束。

（2）自基金合同生效以来富国新优享灵活配置混合C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12月31日。

2、本基金于2017年8月9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2017年8月9日起至2018年2月8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		
钟智锐	本基金基金经理兼固定收益投资部总经理，富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型证券投资基金、富国新利灵活配置混合型证券投资基金、富国新锐利灵活配置混合型证券投资基金、富国新兴灵活配置混合型证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新利灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新锐利灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国定期开放债券型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国景利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理	2017-08-09	-	24	硕士，曾任华安证券自营投资部证券研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2008年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2008年11月至2009年3月任富国天时货币市场基金基金经理；2008年10月至今任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；2015年3月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2015年5月起任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型证券投资基金、富国新利灵活配置混合型证券投资基金、富国新锐利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月起任富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年6月起任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国景利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理；2017年11月起任富国泰利定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；兼任固定收益投资部总经理，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新优享灵活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》、《富国新优享灵活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

今年以来宏观数据整体好于前期的市场预期。明年经济韧性仍在，在中央经济工作会议“重质量，不重增速”“调节好货币的闸门”的定调下，亦难见大水漫灌。消费、出口表现较好，能够抵销投资端继续小幅回落的影响；信贷仍强，压缩银行配债力量。CPI中枢抬升，在国际原油价格不断上涨的背景下，存在输入型通胀的隐患。

欧、美经济因素对国内的影响主要体现在外贸上，目前未见对国内有资本流出和汇率的压力。

货币政策：海外，美联储预计在2018年加息3-4次；国内，2018年3月两会中央领导换届，中性偏紧的货币政策和去杠杆仍在路上。持续性的金融监管，仍将是主导债市的重要因素。

股票市场：四季度上证综指跌幅1.25%，创业板指数跌幅6.12%，存量博弈背景下，2017年全年的风格分化非常显著，50和1000指数两极分化。食品饮料、白电、保险等业绩增速稳定、确定性强的行业持续受到追捧，港股通带来的北上资金对估值定价的影响也越来越显著。

债券市场：目前各类债券收益率已达历史70-90%分位，有很明显的配置价值，特别在短端。以票息策略为主，少做波段。加配短久期、中等资质国企债券。超额收益机会更多来自转债，关注有基本面支持的被错杀品种。未来将有更多的监管细则出台，应对金融去杠杆(银行端同业套利)、理财资金、地方政府债务等问题。这将持续制约债券的资金来源和情绪。

报告期内，本基金基本维持了前期的仓位配置，对股票投资组合的结构进行动态调整，同时积极参与新股的网下配售。

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3.18%，C级为2.83%，同期业绩比较基准收益率A级为0.68%，C级为0.68%

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	82,632,922.70	23.59
	其中:股票	82,632,922.70	23.59
2	固定收益投资	248,824,783.90	71.02
	其中:债券	248,824,783.90	71.02
	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	5,300,000.00	1.51
	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	2,516,784.92	0.72
7	其他资产	11,063,845.39	3.16
8	合计	350,338,336.91	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	49,868,852.57	14.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,454,694.13	4.23
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	7,444,025.00	2.18
K	房地产业	10,849,207.80	3.18
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	82,632,922.70	24.19

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	600066	宇通客车	477,200	11,486,204.00	3.36
2	600622	光大嘉宝	603,740	10,849,207.80	3.18
3	600998	九州通	485,283	9,196,112.85	2.69
4	601233	桐昆股份	386,200	8,685,638.00	2.54
5	002366	台海核电	300,000	7,935,000.00	2.32
6	600104	上汽集团	197,808	6,337,768.32	1.86
7	002493	荣盛石化	393,100	5,640,985.00	1.65
8	600153	建发股份	472,894	5,258,681.28	1.54
9	000703	恒逸石化	192,600	4,154,382.00	1.22
10	601398	工商银行	632,800	3,923,360.00	1.15

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	154,475,333.30	45.22
	其中:政策性金融债	147,521,133.30	43.19
4	企业债券	74,388,450.60	21.78
5	企业短期融资券	10,006,000.00	2.93
6	中期票据	-	-
7	可转