富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	招商银行股份有限公司
送出日期:	2018年08月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国嘉利稳健配置定期开放混合
基金主代码	004460
交易代码	004460
基金运作方式	契约型,开放式。本基金以定期开放方式运作,即本基金以封闭期和开放期相结合的方式运作。
基金合同生效日	2017年09月26日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	234,486,095.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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×85%+沪深300指数×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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686,4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16,17层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期已实现收益	2,637,374.07
本期利润	3,903,840.98
加权平均基金份额本期利润	0.0166
本期基金份额净值增长率	1.66%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0171
期末基金资产净值	238,948,198.45
期末基金份额净值	1.0190

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.24%	0.06%	-0.88%	0.19%	1.12%	-0.13%
过去三个月	0.66%	0.07%	-0.66%	0.18%	1.32%	-0.11%
过去六个月	1.66%	0.06%	-0.15%	0.18%	1.81%	-0.12%
自基金合同生效日起至今	1.90%	0.05%	-0.27%	0.16%	2.17%	-0.11%

注:本基金业绩比较基准:中债综合全价指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15% 。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,1日收益率(benchmarkt)按下列公式计算:benchmarkt = [中债综合全价指数t/(中债综合全价指数t-1)-1] *85% + [沪深 300 指数t/(沪深 300 指数t-1)-1] *15%;其中,t=1,2,3,…,T,T表示时间截至日;期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark t)]-1 其中,T=2,3,4,…;∏Tt=1(1+benchmark t)表示1日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2018年6月30日。

2、本基金于2017年9月26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9月26日起至2018年3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 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一,公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行(BMO)参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中,第一家中外合资的基金管理公司。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金(LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国全球科技互联网股票型证券投资基金(QDII)、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债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、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网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、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、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、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合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、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、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、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健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、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)、富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国金利定期开放混合型证券投资基金、富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金、富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金、富国成长优选三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、富国军工主题混合型证券投资基金、富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国转型机遇混合型证券投资基金、富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)等一百一十二只证券投资基金。

4.1.2 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
钟智伦	本基金基金经理	2017-09-29	-	24	硕士,曾任平安证券有限责任公司部门经理。上海新世纪投资服务有限公司研究员;海通证券股份有限公司投资经理;2006年6月任富国基金管理有限公司债券研究员;2006年6月至2008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2014年6月任富国天时货币市场基金基金经理;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;2011年12月至2016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;2016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月起任富国新回报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基金经理;2017年3月起任富国收益增强债券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、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理;2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理;2017年8月起任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年9月起任富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国聚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、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2018年1月起任富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理;2018年2月起任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理;2018年3月起任兼任富国新趋势灵活配置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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国嘉利稳健配置定期开放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》、《富国嘉利稳健配置定期开放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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,风险管理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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,国内经济走弱,经济数据一路向下,社会融资规模增量比上年同期减少2.03万亿元,货币市场前紧后松,流动性总体较为宽松,人民币对美元汇率贬值,利率债和高等级信用债收益率大幅下行,但信用违约事件使得信用利差分化严重,中低等级信用利差扩大,债券发行困难。市场风险偏好降低,避险情绪扩散,催生利率债牛市,而股票市场则自2月始持续下跌,报告期沪深300指数跌幅达到12.90%。

报告期本基金增加了债券配置比例,但随着债券的自然到期,期末债券投资比例有所下降,同时,基金的风险垫有所增厚,期末适度增加了股票的投资比例,并对组合结构进行了适度调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为1.0190元;份额累计净值为1.0190元;本报告期,本基金份额净值增长率为1.66%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计下半年经济继续缓慢回落,流动性维持宽松的格局,如果“紧信用”边际上得到改善,则信用压力将会减缓,信用利差将会得到修复,债券市场不排除会出现震荡行情,股票市场单边下跌的态势也有望出现转机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定,以及基金合同对估值程序的相关约定,对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成,并与基金托管人进行账务核对,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况,本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

招商银行股份有限公司

2018年8月27日

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
资 产:		
银行存款	111,482.52	128,743.92
结算备付金	1,431,378.64	803,969.12
存出保证金	11,209.44	7,083.06
交易性金融资产	206,938,760.90	258,221,983.10
其中:股票投资	8,707,373.00	-
基金投资	-	-
债券投资	198,231,387.90	258,221,983.10
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	27,900,000.00	12,100,000.00
应收证券清算款	6,783.12	4,343.07
应收利息	3,064,869.37	6,114,990.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	239,464,483.99	277,381,113.06
负债和所有者权益	本期末(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	41,800,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	195,968.37	199,398.73
应付托管费	29,395.27	29,909.80
应付销售服务费	117,580.98	119,639.21
应付交易费用	38,219.75	8,993.13
应交税费	10,820.42	-
应付利息	-	68,814.72
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	124,300.75	110,000.00
负债合计	516,285.54	42,336,755.59
所有者权益:		
实收基金	234,486,095.19	234,486,095.19
未分配利润	4,462,103.26	558,262.28
所有者权益合计	238,948,198.45	235,044,357.47
负债和所有者权益总计	239,464,483.99	277,381,113.06

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额净值1.0190元,基金份额总额234,486,095.19份。

6.2 利润表

会计主体:富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)
一、收入	6,592,856.36
1.利息收入	5,535,622.16
其中:存款利息收入	17,997.75
债券利息收入	5,378,444.88
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	139,179.53
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-209,232.71
其中:股票投资收益	-586,613.43
基金投资收益	-
债券投资收益	371,778.72
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具投资收益	-
股利收益	5,602.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,266,466.91
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-
减:二、费用	2,689,015.38
1. 管理人报酬	1,176,829.97
2. 托管费	176,524.46
3. 销售服务费	706,097.97
4. 交易费用	77,885.26
5. 利息支出	442,393.59
其中:卖出回购金融资产支出	442,393.59
6. 税金及附加	8,111.10
7. 其他费用	101,173.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	3,903,840.98
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	3,903,840.98

注:本基金合同生效日为2017年9月26日,无上年度同期对比数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	234,486,095.19	558,262.28	235,044,357.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,903,840.98	3,903,840.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	234,486,095.19	4,462,103.26	238,948,198.45

注:本基金合同生效日为2017年9月26日,无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

陈 戈 林志松 徐慧

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017] 247号文《关于准予富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为管理人自2017年8月15日至2017年9月19日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第60467606_B17号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年9月26日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币234,449,247.64元,在募集期间产生的存款利息为人民币36,847.55元,以上实收基金(本息)合计为人民币234,486,095.19元,折合234,486,095.19份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、衍生工具(权证、股指期货等)以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不超过基金资产的30%。在开放期内,每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受前述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数×85%+沪深300指数×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确金面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称“资管产品运营业务”),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
申万宏源证券有限公司(“申万宏源”)	基金管理人的股东、基金代销机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
申万宏源	16,659,695.16	30.58

注:本基金合同生效日为2017年09月26日,无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2017年09月26日,无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申万宏源	6,064,582.34	6.79

注:本基金合同生效日为2017年09月26日,无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.4 回购交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2017年09月26日,无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期(2018年01月01日