

富国久利稳健配置混合型证券投资基金

二〇二三年第4季度报告

2023年12月31日

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：2024年01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 2024 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 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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	54,664,645.70份		
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	<p>本基金在大类资产配置中采用时间不变性投资组合保险策略（Time Invariant Portfolio Protection，以下简称“TIPP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；债券投资是本基金的投资重点，是实现组合收益的主要来源，本基金通过价值分析，采用自上而下确定投资策略，采取久期管理、类属配置和现金流管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值；在股票投资方面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法和“自下而上”的个股投资策略，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。在存托凭证投资方面，本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。本基金的中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略和股指期货投资策略详见法律文件。</p>		
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。		
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	富国久利稳健配置混合型C	富国久利稳健配置混合型E
下属分级基金的交易代码	003877	003878	019370
报告期末下属分级基金的份额总额	42,073,381.57份	8,356,253.11份	4,235,011.02份

§ 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（2023年10月01日-2023年12月31日）		
	富国久利稳健配置 混合型 A	富国久利稳健配 置混合型 C	富国久利稳健配 置混合型 E
1. 本期已实现收益	724,227.21	141,500.40	17,388.64
2. 本期利润	300,779.72	53,195.90	20,713.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0063	0.0159
4. 期末基金资产净值	41,421,627.55	8,121,161.06	4,169,323.92
5. 期末基金份额净值	0.9845	0.9719	0.9845

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

(1) 富国久利稳健配置混合型 A

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	0.76%	0.74%	-0.37%	0.13%	1.13%	0.61%
过去六个月	2.69%	0.67%	-0.93%	0.13%	3.62%	0.54%
过去一年	4.53%	0.62%	0.04%	0.13%	4.49%	0.49%
过去三年	-4.19%	0.52%	-1.74%	0.17%	-2.45%	0.35%
过去五年	13.01%	0.46%	8.46%	0.18%	4.55%	0.28%
自基金合同生效起至今	17.09%	0.39%	8.77%	0.17%	8.32%	0.22%

(2) 富国久利稳健配置混合型 C

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	0.76%	0.74%	-0.37%	0.13%	1.13%	0.61%
过去六个月	2.66%	0.67%	-0.93%	0.13%	3.59%	0.54%
过去一年	4.28%	0.62%	0.04%	0.13%	4.24%	0.49%

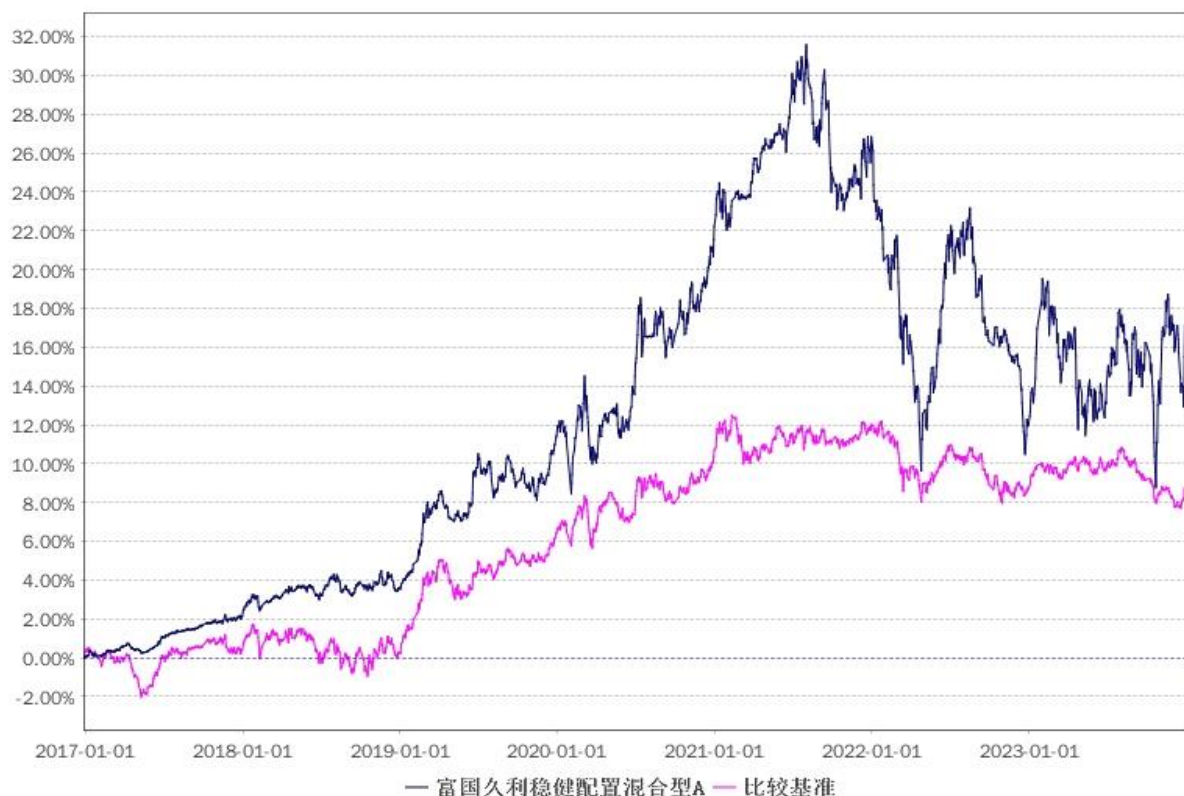
过去三年	-5.18%	0.52%	-1.74%	0.17%	-3.44%	0.35%
过去五年	10.96%	0.46%	8.46%	0.18%	2.50%	0.28%
自基金合同生效起至今	14.09%	0.39%	8.77%	0.17%	5.32%	0.22%

(3) 富国久利稳健配置混合型 E

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	0.76%	0.74%	-0.37%	0.13%	1.13%	0.61%
自基金分级生效日起至今	1.07%	0.71%	-0.78%	0.12%	1.85%	0.59%

3.2.2 自基金合同生效以来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

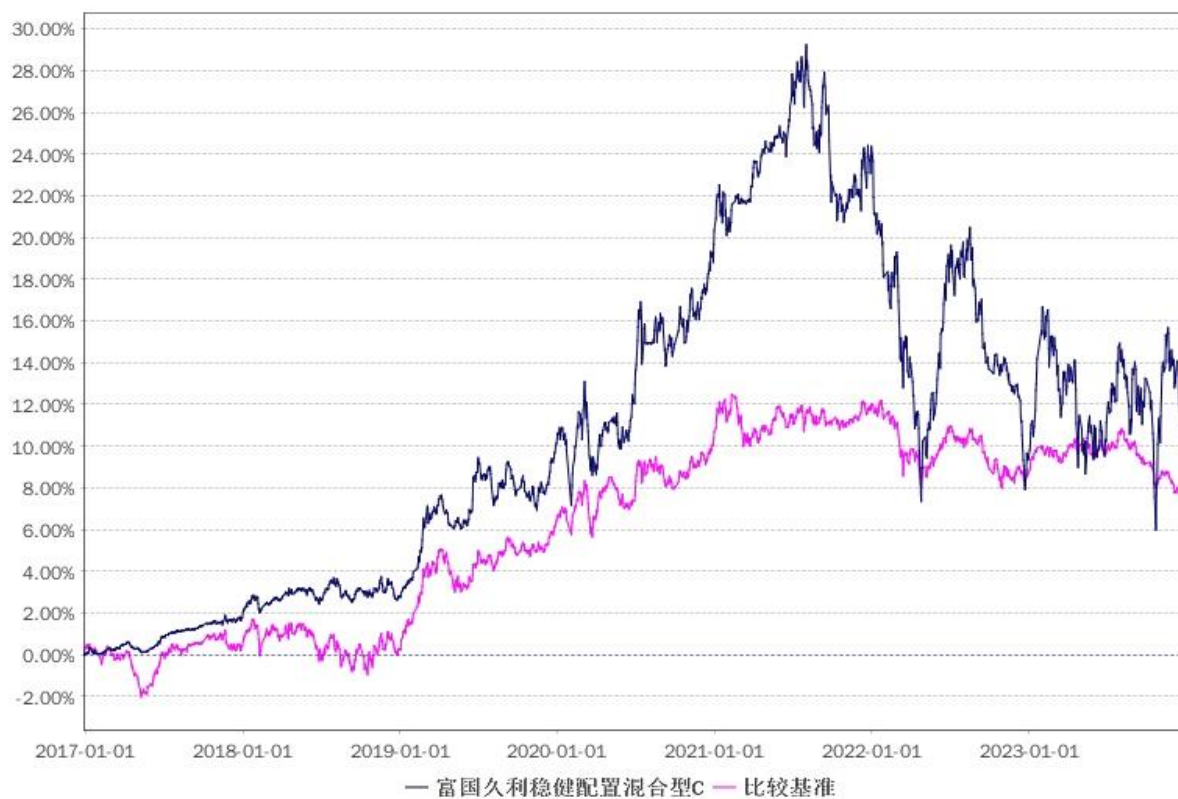
(1) 自基金合同生效以来富国久利稳健配置混合型 A 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2016 年 12 月 27 日成立，建仓期 6 个月，从 2016 年 12 月 27 日起至 2017 年 6 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。

(2) 自基金合同生效以来富国久利稳健配置混合型 C 基金累计净值增长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 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2016 年 12 月 27 日成立，建仓期 6 个月，从 2016 年 12 月 27 日起至 2017 年 6 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。

(3) 自基金 E 级份额生效以来富国久利稳健配置混合型 E 基金累计净值增长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 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金自 2023 年 9 月 12 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 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		
吕春杰	本基金现任基金经理	2022-09-23	—	15	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司研究员/董事，中国人保资产股份有限公司高级投资经理，上海证券有限责任公司资产管理总部副总经理；自2021年6月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部副总经理，兼任富国基金固定收益基金经理。自2021年08月起任富国长江经济带纯债债券型证券投资基金基金经理；自2021年08月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2021年11月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理；自2021年12月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；自2021年12月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理；自2022年06月起任富国碳中和一年定期开放债券型发

					起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国汇享三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 09 月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 10 月起任富国汇泽一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
刘兴旺	本基金现任基金经理	2022-12-08	—	18	硕士，曾任申银万国证券股份有限公司固定收益研究员，华宝兴业基金管理有限公司基金经理助理兼债券研究员，泰信基金管理有限公司基金经理，国投瑞银基金管理有限公司基金经理，国联证券股份有限公司资产管理部副总经理，长安基金管理有限公司固定收益总监；自 2021 年 11 月加入富国基金管理有限公司，自 2022 年 5 月起历任固定收益投资经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2022 年 07 月起任富国裕利债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 09 月起任富国双利增强债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富

					国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 05 月起任富国稳健添利债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 07 月起任富国兴享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
蔡耀华	本基金现任基金经理	2023-08-07	—	13	学士，自 2011 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任基金会计（TA）助理、基金会计、风控员、基金经理助理、固定收益基金经理；现任富国基金固定收益策略研究部固定收益基金经理。自 2023 年 08 月起任富国久利稳健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决定确定的聘任日期，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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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、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 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，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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 2 次同日反向交易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

2023 年四季度，债市受宏观基本面、资金面和政策扰动，收益率先上后下。10 月份，特殊再融资债券发行节奏较快，资金面持续偏紧，叠加三季度经济数据超预期，万亿国债增发预期发酵并落地，债券收益率持续上行，十年期国债调整至 2.72%附近。11 月份，资金面分层现象明显，经济内生动能偏弱、利好房企政策频出，收益率整体在高位波动，短端表现弱于长端，收益率曲线平坦化变动。进入 12 月份，政治局会议和中央经济工作会议并未释放强刺激信号，收益率有所下行，15 日央行大幅超额续作 MLF，跨年资金面超预期宽松，年末国有大行再次下调存款利率，市场降息预期升温，债市做多情绪较高，收益率震荡下行，十年国债收于 2.56%附近。投资操作上，本基金注重大类资产配置，维持组合权益适中仓位，择机优化转债持仓，调整组合久期，适当运用杠杆，报告期内净值有所增长。

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 0.76%，C 级为 0.76%，E 级为 0.76%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-0.37%，C 级为-0.37%，E 级为-0.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

自 2023 年 10 月 9 日至 2023 年 11 月 10 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§ 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	16,312,833.29	22.58
	其中：股票	16,312,833.29	22.58
2	固定收益投资	53,536,321.20	74.10
	其中：债券	53,536,321.20	74.10
	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	245,000.00	0.34
	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	1,216,549.62	1.68
7	其他资产	939,734.45	1.30
8	合计	72,250,438.56	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	13,477,025.24	25.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
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	1,354,410.00	2.52
J	金融业	—	—
K	房地产业	487,320.00	0.91
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	628,418.05	1.17
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	365,660.00	0.68
	合计	16,312,833.29	30.37

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	002353	杰瑞股份	48,500	1,363,335.00	2.54
2	300707	威唐工业	62,600	1,163,734.00	2.17
3	002653	海思科	50,000	1,157,500.00	2.16
4	300848	美瑞新材	53,000	1,013,890.00	1.89
5	002092	中泰化学	150,000	915,000.00	1.70
6	605128	上海沿浦	15,100	876,555.00	1.63
7	300785	值得买	37,500	819,750.00	1.53
8	603105	芯能科技	61,400	711,012.00	1.32
9	605060	联德股份	38,000	710,600.00	1.32
10	603878	武进不锈	84,200	635,710.00	1.18

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	14,710,387.16	27.39
2	央行票据	—	—
3	金融债券	883,116.06	1.64
	其中：政策性金融债	883,116.06	1.64
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）	37,942,817.98	70.64
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	53,536,321.20	99.67

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	019693	22 国债 28	51,000	5,114,479.81	9.52
2	019691	22 国债 26	50,000	5,015,056.16	9.34
3	110075	南航转债	17,850	2,142,120.79	3.99
4	128109	楚江转债	18,199	2,142,089.61	3.99
5	019676	22 国债 11	15,000	1,521,394.11	2.83

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

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

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	18,003.34
2	应收证券清算款	919,612.71
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,118.40
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	939,734.45

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	110075	南航转债	2,142,120.79	3.99
2	128109	楚江转债	2,142,089.61	3.99
3	113066	平煤转债	1,296,175.62	2.41
4	113063	赛轮转债	1,092,979.60	2.03
5	127087	星帅转2	1,089,107.05	2.03
6	123120	隆华转债	1,078,802.51	2.01
7	127076	中宠转2	1,076,306.55	2.00
8	127043	川恒转债	1,074,754.85	2.00
9	128083	新北转债	1,069,310.79	1.99
10	113654	永02转债	1,063,118.41	1.98
11	127035	濮耐转债	1,063,090.25	1.98

12	127027	能化转债	1,062,992.19	1.98
13	123169	正海转债	1,061,109.36	1.98
14	123194	百洋转债	1,056,417.28	1.97
15	113064	东材转债	1,048,291.37	1.95
16	127069	小熊转债	1,038,385.94	1.93
17	127070	大中转债	1,031,009.21	1.92
18	123184	天阳转债	1,018,782.29	1.90
19	118009	华锐转债	1,011,628.38	1.88
20	110074	精达转债	1,002,221.34	1.87
21	128130	景兴转债	1,001,840.98	1.87
22	127040	国泰转债	995,402.52	1.85
23	127006	敖东转债	993,981.78	1.85
24	110093	神马转债	919,718.57	1.71
25	123166	蒙泰转债	897,891.78	1.67
26	123096	思创转债	723,206.44	1.35
27	127074	麦米转 2	712,967.87	1.33
28	127015	希望转债	648,628.44	1.21
29	123172	漱玉转债	613,728.74	1.14
30	111000	起帆转债	534,303.27	0.99
31	123198	金埔转债	532,377.49	0.99
32	123196	正元转 02	528,324.24	0.98
33	123162	东杰转债	527,349.55	0.98
34	111007	永和转债	523,601.24	0.97
35	113660	寿 22 转债	366,416.71	0.68
36	113664	大元转债	344,092.71	0.64
37	123119	康泰转 2	283,751.30	0.53
38	110068	龙净转债	274,560.82	0.51
39	127054	双箭转债	263,127.69	0.49
40	110059	浦发转债	229,328.35	0.43
41	123183	海顺转债	141,528.22	0.26
42	111012	福新转债	93,900.51	0.17
43	113545	金能转债	82,243.02	0.15

44	127071	天箭转债	44,602.31	0.08
----	--------	------	-----------	------

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	富国久利稳健配置混合型 A	富国久利稳健配置混合型 C	富国久利稳健配置混合型 E
报告期期初基金份额总额	42,535,410.35	8,688,068.04	1,026.59
报告期期间基金总申购份额	361,771.90	21,405.98	4,233,984.43
报告期期间基金总赎回份额	823,800.68	353,220.91	—
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	42,073,381.57	8,356,253.11	4,235,011.02

§ 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	1,026.59
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	1,026.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

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

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	2023-10-01 至 2023-12-31	25,335,028.89	—	414,842.00	24,920,186.89	45.59%
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，审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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§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

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 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
2024 年 01 月 22 日