富国安益货币市场基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:	2018年10月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国安益货币
基金主代码	000602
交易代码	000602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年05月26日
报告期末基金份额总额(单位:份)	10,290,191,820.59
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。 在投资管理过程中,基金管理人将基于"定性与定量相结合、保守与积极相结合"的原则,根据短期利率的变动和市场格局的变化,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	80,853,346.79
2.本期利润	80,853,346.79
3.期末基金资产净值	10,290,191,820.59

注:上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用(例如,开放式基金的转换费等),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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

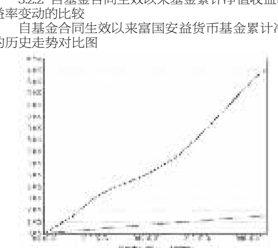
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7919%	0.0009%	0.0894%	0.0000%	0.7025%	0.0009%

注:过去三个月指2018年7月1日－2018年9月30日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国安益货币基金累计净值收益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2018年9月30日。

2、本基金于2014年5月26日成立,建仓期6个月,从2014年5月26日起至2014年11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		
张波	本基金基金经理	2018-08-16	–	6	硕士,2012年7月至2013年9月任上海耀之资产管理中心(有限合伙)交易员;2013年9月至2017年10月历任鑫元基金管理有限公司交易员、交易副总监(主持工作);2017年10月加入富国基金管理有限公司,2018年1月起任富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理,2018年6月起任富国富钱包货币市场基金基金经理,2018年8月起任富国安益货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。
万莉	本基金前任基金经理	2015-10-09	2018-09-14	12	硕士,自2006年7月至2008年6月在广州银行任债券交易员;自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作,历任债券交易员、基金经理助理、基金经理;自2013年7月至2014年6月在中融基金(原道富基金)管理有限公司工作,任现金管理投资总监;自2014年6月加入富国基金管理有限公司,自2014年6月至2015年10月任固定收益投资部现金管理主管;2015年10月至2018年9月任富国天时货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金基金经理;2015年12月至2018年9月任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理。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安益货币市场基金(原富国收益宝货币市场基金)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》、《富国安益货币市场基金基金合同》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

2018年3季度,全球经济增长分化,美国经济延续快速增长,欧洲经济增长略显疲弱,新兴市场则面临较大的货币贬值和财政压力,随着贸易摩擦升温,未来全球经济增长的不确定性加大。国内方面,经济保持平稳发展,新动能依旧保持较高增速,而老动能继续分化,依然具有一定韧性。外部需求方面,进出口依然表现良好;内部需求方面,固定资产投资增速小幅回落,社会消费品零售总额增速持稳,内需对经济增长的拉动不断提升。

货币市场方面,3季度国内流动性改善明显。7月降准释放了近7000亿元流动性,有效补充了市场中长期资金缺口。在降准、中期借贷便利和公开市场等多种货币政策工具作用下,3季度货币市场利率波动性大幅下降,整体保持低位平稳运行。央行货币政策委员会3季度会议指出,稳健的货币政策保持中性,要松紧适度,管好货币供给总闸门,保持流动性合理充裕,引导货币信贷及社会融资规模合理增长。整体来说,3季度货币市场流动性较为充裕。

报告期内,本基金秉承稳健投资原则谨慎操作,根据市场流动性情况灵活调整组合资产比例、杠杆比率和剩余期限,严控组合流动性风险、利率风险和信用风险,组合总体流动性状况良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值收益率为0.7919%,同期业绩比较基准收益率为0.0894%

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	固定收益投资	8,495,478,558.23	82.54
	其中:债券	8,495,478,558.23	82.54
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	1,544,863,557.30	15.01
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	202,513,714.24	1.97
4	其他资产	49,148,123.44	0.48
5	合计	10,292,003,953.21	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.75	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	35
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.42	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	22.66	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	0.39	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	3.89	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	4.18	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	99.54	–

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	249,033,369.36	2.42
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,331,536,831.32	12.94
	其中:政策性金融债	1,331,536,831.32	12.94
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	360,375,981.44	3.50
6	中期票据	–	–
7	同业存单	6,554,532,376.11	63.70
8	其他	–	–
9	合计	8,495,478,558.23	82.56
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111816227	18上海银行CD227	10,000,000.00	998,473,607.53	9.70
2	111820165	18广发银行CD165	10,000,000.00	995,497,587.90	9.67
3	111816237	18上海银行CD237	9,500,000.00	948,151,103.08	9.21
4	111810329	18兴业银行CD329	8,000,000.00	799,332,454.76	7.77
5	111820164	18广发银行CD164	5,500,000.00	547,618,260.84	5.32
6	111809217	18浦发银行CD217	4,700,000.00	469,237,794.17	4.56
7	111818203	18华夏银行CD203	4,700,000.00	469,041,908.54	4.56
8	170211	17国开11	3,800,000.00	379,931,291.97	3.69
9	111810338	18兴业银行CD338	3,300,000.00	329,503,458.44	3.20
10	071800032	18国信证券CP001	3,000,000.00	300,012,696.74	2.92

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1500%
报告期内偏离度的最低值	0.0239%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0784%

注:以上数据按工作日统计

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.9.2 声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"18国信证券CP001"的发行主体国信证券股份有限公司(以下简称"公司")于2018年6月22日公告,公司于2018年6月21日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2018]46号),因公司保荐业务、并购重组财务顾问业务违反证券法律法规,中国证监会决定对公司做出如下行政处罚:对公司保荐业务处以责令改正,给予警告,没收保荐业务收入100万元,并处人民币300万元罚款的行政处罚;对公司并购重组财务顾问业务行为处以责令改正、没收并购重组财务顾问业务收入600万元,并处以1800万元罚款的行政处罚。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"18兴业银行CD338"的发行主体兴业银行股份有限公司(以下简称"公司"),由于公司存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2018年4月19日对公司处以罚款5870万元的行政处罚。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"18兴业银行CD329"的发行主体兴业银行股份有限公司(以下简称"公司"),由于公司存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2018年4月19日对公司处以罚款5870万元的行政处罚。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"18浦发银行CD217"的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"公司"),由于公司存在:内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节;理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求;提供不实说明材料;不配合调查取证;以贷转存,虚增存贷款;票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严;国内信用证业务贸易背景审查不严;贷款管理严重缺失,导致大额不良贷款;违规通过同业投资转存款方式,虚增存款;票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理;对代理收付资金的信托计划提供保本承诺;以存放同业业务名义开办委托定向投资业务,并少计风险资产;投资多款同业理财产品未尽职审查,涉及金额较大;修改总行理财合同标准文本,导致理财资金实际投向与合同约定不符;为非保本理财产品出具保本承诺函;向关系人发放信用贷款;向客户收取服务费,但未提供实质性服务,明显质价不符;收费超过服务价格目录,向客户转嫁成本等违法违规事实,中国银监会于2018年2月12日对公司处以罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元的行政处罚。

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6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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	49,148,123.44
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	49,148,123.44

5.9.4 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	10,209,745,218.94
报告期期间基金总申购份额	80,853,346.79
减:报告期期间基金总赎回份额	406,745.14
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	10,290,191,820.59

注:红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本期总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的来源,统一计入本期总赎回份额。

§7 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	分红再投	–	–	–	–
合计			–	–	

§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	2018-07-01至2018-09-30	10,206,599,075.58	80,746,127.92	–	10,287,345,203.50	100.00%
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。							

§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收益宝货币市场基金的文件

2、富国收益宝货币市场基金基金合同

3、富国收益宝货币市场基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国收益宝货币市场基金财务报表及报表附注

6、《富国基金管理有限公司关于富国收益宝货币市场基金变更基金名称的公告》

7、富国安益货币市场基金基金合同

8、富国安益货币市场基金托管协议

9、富国安益货币市场基金财务报表及报表附注

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

2018年10月25日

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

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10月25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10月23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2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国宝利增强债券
基金主代码	005078
交易代码	005078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年02月08日
报告期末基金份额总额(单位:份)	27,052,527.16
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
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。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理,在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上,通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券,以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种,加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资,灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略,在保证基金流动性的前提下,积极把握固定收益证券市场中投资机会,获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与预期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(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-132,241.69
2.本期利润	397,599.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0146
4.期末基金资产净值	27,515,425.75
5.期末基金份额净值	1.0171

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。

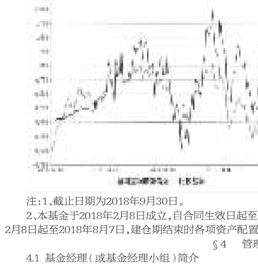
3.2 基金净值表现

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	1.55%	0.26%	0.36%	0.14%	1.19%	0.12%

注:过去三个月指2018年7月1日－2018年9月30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2018年9月30日。

2、本基金于2018年2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2018年2月8日起至2018年8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		
钟智伦	本基金基金经理	2018-02-08	–	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;2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员;2006年6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基金经理;2015年3月至2018年7月任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;2017年6月至2018年7月任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、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理;2017年11月起任富国泰利定期开放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,兼任固定收益投资部固定收益投资副总监。具有基金从业资格。
陈斯扬	本基金基金经理	2018-03-19	–	6	硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券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宝利增强债券型发起式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》、《富国宝利增强债券型发起式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

三季度以来,股票市场整体延续下跌,而债券市场则有所震荡调整。期间市场的关注重点主要在三个方面:一是7月份资管新规终于落地,债市在悲观预期已经充分计价的基础上,对此事件表现较为平淡;二是贸易战担忧在整个三季度不断升级,股票市场因此继续受到负面冲击,而债券则得到支撑,不过在9月末美国对华2000亿出口商品加征关税落地后,情绪的超调得以修复,股市触底反弹;三是国内财政和基建政策放松与经济放缓压力之间的博弈。今年上半年由于融资条件的收紧触发了社会融资总量的断崖式下跌,导致市场对经济担忧加重,加之贸易战的升级,引发了国内货币和财政政策的宽松转向。8-9月份债券市场开始出现对经济下行不及预期和通胀反弹的担忧,并引发了收益率的反弹。

三季度在债券操作上,组合降低了中长久期利率债的仓位。信用债配置仍以高等级为主,对静态收益率略有向上调整。在股票操作上,组合维持产品目标,仍以沪深300指数增强仓位做配置,但整体仓位有所低配,最低降低至16%左右,在9月末重新加仓至接近20%。整体来看,三季度债券仓位的收益抵御了股票部分的下跌,加之股票多因子择券的超额收益和大类资产仓位上的控制,从而为组合带来了良好的超额收益。

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1.55%,同期业绩比较基准收益率为0.36%

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

本基金为发起式基金,且截至本报告期末,本基金基金合同生效未满3年,暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效三年后继续存续的,自基金合同生效满三年后的基金存续期内,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金合同应当终止,无须召开基金份额持有人大会。

§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	5,343,046.90	14.66
	其中:股票	5,343,046.90	14.66
2	固定收益投资	29,726,793.80	81.56
	其中:债券	29,726,793.80	81.56
	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	900,954.70	2.47
7	其他资产	476,809.62	1.31
8	合计	36,447,605.02	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	14,724.00	0.05
B	采矿业	175,720.00	0.64
C	制造业	2,237,942.10	8.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	209,573.00	0.76
E	建筑业	13,380.00	0.05
F	批发和零售业	252,606.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	41,150.00	0.15
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	214,438.50	0.78
J	金融业	1,798,111.00	6.53
K	房地产业	286,805.00	1.04
L	租赁和商务服务业	19,402.80	0.07
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	10,758.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	43,537.50	0.16
R	文化、体育和娱乐业	24,899.00	0.09
S	综合	–	–
	合计	5,343,046.90	19.42

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	601318	中国平安	6,200	424,700.00	1.54
2	600036	招商银行	6,900	211,761.00	0.77
3	000651	格力电器	4,100	164,820.00	0.60
4	600519	贵州茅台	200	146,000.00	0.53
5	601398	工商银行	23,700	136,749.00	0.50
6	600030	中信证券	7,600	126,844.00	0.46
7	601288	农业银行	32,000	124,480.00	0.45
8	600585	海螺水泥	3,000	110,370.00	0.40
9	601998	中信银行	17,800	107,868.00	0.39
10	600406	国电南瑞	5,900	104,135.00	0.38

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	5,982.20	0.02
2	央行票据	–	–
3	金融债券	8,161,081.60	29.66
	其中:政策性金融债	8,161,081.60	29.66
4	企业债券	21,559,730.00	78.36
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	29,726,793.80	108.04

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	018005	国开1701	41,000	4,124,600.00	14.99
2	018006	国开1702	40,160	4,036,481.60	14.67
3	143482	18京资01	25,000	2,580,250.00	9.38
4	136601	16穗建02	25,000	2,480,500.00	9.01
5	143499	18深航02	20,000	2,043,400.00	7.43

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 申明本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	11,860.52
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	464,949.10
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	476,809.62

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	29,018,719.49
报告期期间基金总申购份额	5,043,172.67
减:报告期期间基金总赎回份额	7,009,365.00
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	27,052,527.16

§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	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.97

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	36.97	10,000,000.00	36.97	3年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,000.00	36.97	10,000,000.00	36.97	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2018-07-01至2018-09-30	21,999,000.00	–	–	21,999,000.00	81.32%
	2	2018-07-01至2018-07-03	6,999,000.00	–	6,999,000.00	–	–
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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国宝利增强债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国宝利增强债券型发起式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、富国宝利增强债券型发起式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

10.2 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

10.3 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10月25日

富国产业升级混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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10月25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10月23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2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国产业升级混合
基金主代码	004183
交易代码	004183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月09日
报告期末基金份额总额(单位:份)	115,000,063.37
投资目标	本基金主要投资于产业升级主题相关股票,通过精选个股和风险控制,力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
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	本基金的业绩比较基准为:沪深300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低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,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(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-2,281,807.46
2.本期利润	-6,291,787.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0531
4.期末基金资产净值	119,035,451.05
5.期末基金份额净值	1.0351

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。

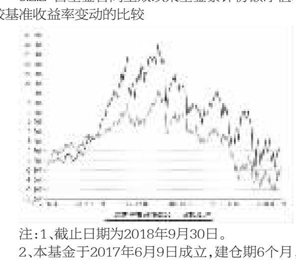
3.2 基金净值表现

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	-4.70%	1.70%	-1.44%	1.09%	-3.26%	0.61%

注:过去三个月指2018年7月1日－2018年9月30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2018年9月30日。

2、本基金于2017年6月9日成立,建仓期6个月,从2017年6月9日起至2017年12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。

§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		
章旭峰	本基金基金经理	2017-06-09	–	23	学士,曾任职于华龙证券上海证券部、大鹏证券上海经纪业务总部、上海证券报信息披露中心、北京世华国际金融有限公司基金债券部;自2007年9月至2015年4月在天治基金管理有限公司工作,历任行业研究员、基金经理助理、基金经理;自2015年4月加入富国基金管理有限公司,2015年8月至2017年10月任富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金基金经理,2017年6月任富国产业升级混合型证券投资基金基金经理,2018年3月起任富国军工主题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产业升级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》、《富国产业升级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

三季度,国内宏观经济相对稳定,但国内外干扰因素不断,如中美贸易战导致2000亿关税的落地、金融去杠杆的延续、汇率的贬值等,都在持续地影响A股市场的风险偏好及短期趋势。上证指数、中小板指、创业板分别下跌0.92%、11.22%、12.16%。期间,涨幅前列行业依次是石油石化、银行、钢铁、国防军工、非银;跌幅前列行业依次是纺服、家电、电子、轻工、医药等。

报告期内,本基金在高位大幅减持获利丰厚的生物医药,规避了行业调整的风险。继续保持泛消费的核心配置,尤其在食品饮料、农业、轻工等细分领域重点配置。同时,在国防军工、石油石化、5G、激光产业链、计算机等先进制造业龙头公司进行了组合优化。

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-4.70%,同期业绩比较基准收益率为-1.44%

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	112,132,890.54	93.85
	其中:股票	112,132,890.54	93.85
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	6,723,070.00	5.63
7	其他资产	621,632.97	0.52
8	合计	119,477,593.51	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	1,228,338.00	1.03
B	采矿业	2,389,702.00	2.01
C	制造业	89,506,675.08	75.19
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	13,460,046.92	11.31
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	5,548,128.54	4.66
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	112,132,890.54	94.20

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	600760	中航沈飞	257,000	9,791,700.00	8.23
2	600967	内蒙一机	598,345	8,281,094.80	6.96
3	002013	中航机电	913,076	7,669,838.40	6.44
4	601233	桐昆股份	397,916	6,541,739.04	5.50
5	002008	大族激光	144,191	6,109,372.67	5.13
6	600372	中航电子	418,019	6,044,554.74	5.08
7	002027	分众传媒	651,954	5,548,128.54	4.66
8	300253	卫宁健康	369,800	5,332,516.00	4.48
9	600562	国睿科技	344,020	5,321,989.40	4.47
10	002368	太极股份	151,412	4,634,721.32	3.89

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,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。

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	66,214.49
2	应收证券清算款	474,684.23
3	应收股利	–
4	应收利息	1,530.80
5	应收申购款	79,203.45
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	621,632.97

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	124,422,185.78
报告期期间基金总申购份额	4,991,800.71
减:报告期期间基金总赎回份额	14,413,923.12
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	115,000,063.37

§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产业升级混合型证券投资基金的文件

2、富国产业升级混合型证券投资基金基金合同

3、富国产业升级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、富国产业升级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

2018年10月25日