

富国大盘价值量化精选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	中国工商银行股份有限公司
报告截止日期	2018年9月30日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司董事会及高级管理人员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。
基金管理人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。
本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》及基金合同的《基金合同》及基金合同的《基金合同》等相关规定，恪尽职守，勤勉尽责，诚实信用，保障基金资产的安全与完整，保护基金份额持有人的合法权益。基金管理人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。
基金管理人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。

§2 基金产品概况

基金名称	富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金
基金代码	000622
交易场所	上海证券交易所
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
基金发售起始日	2018年07月10日
基金合同生效日	2018年07月10日
本报告期末基金份额总额(单位：亿份)	63.773,799.80
本报告期末基金份额持有人户数(单位：户)	6,528

§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

	本报告期末	较期初(2018年07月31日-2018年09月30日)
1.本期利润总额	1,909,638.60	
2.本期净利润	1,283,505.09	
3.本期公允价值变动收益	689,137.51	
4.本期经营活动产生的现金流量净额	68,128,899.89	
5.本期基金份额持有人应得利润	4,268	

注：本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。
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

	基金净值增长率	业绩比较基准	差
本报告期	5.61%	6.01%	-0.40%
自基金合同生效起至今	1.01%	1.28%	-0.27%

注：本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。
自基金合同生效日至本报告期末期间净值增长率为：5.61%，业绩比较基准收益率为：6.01%。
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的比较

日期	基金净值增长率	业绩比较基准	差
2018-07-10	0.00%	0.00%	0.00%
2018-07-23	0.00%	0.00%	0.00%
2018-08-06	0.00%	0.00%	0.00%
2018-08-20	0.00%	0.00%	0.00%
2018-09-03	0.00%	0.00%	0.00%
2018-09-17	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-01	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-15	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-29	0.00%	0.00%	0.00%
2018-11-12	0.00%	0.00%	0.00%
2018-11-26	0.00%	0.00%	0.00%
2018-12-10	0.00%	0.00%	0.00%
2018-12-24	0.00%	0.00%	0.00%
2019-01-07	0.00%	0.00%	0.00%
2019-01-21	0.00%	0.00%	0.00%
2019-02-04	0.00%	0.00%	0.00%
2019-02-18	0.00%	0.00%	0.00%
2019-03-04	0.00%	0.00%	0.00%
2019-03-18	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-01	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-15	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-29	0.00%	0.00%	0.00%
2019-05-13	0.00%	0.00%	0.00%
2019-05-27	0.00%	0.00%	0.00%
2019-06-10	0.00%	0.00%	0.00%
2019-06-24	0.00%	0.00%	0.00%
2019-07-08	0.00%	0.00%	0.00%
2019-07-22	0.00%	0.00%	0.00%
2019-08-05	0.00%	0.00%	0.00%
2019-08-19	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-02	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-16	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-30	5.61%	6.01%	-0.40%

注：1.截止日期为2018年09月30日。
2.本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。本报告期为2018年7月10日至2018年9月30日。
4.1 基金经理(或基金经小组)简介
基金经理：王健
管理时间：2018-07-10 - 至今
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；前任基金经理聘任日期为基金合同生效日。
2.证券从业的释义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.3 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
7月上旬，中美双方分别对340亿美元进口商品进行征税，鉴于外部环境变化，宏观监管政策趋紧微调。其中，央行、银保监会分别出台资管新规细则，在过渡期对非标资产的管理不一刀切，监管尺度有所放宽，同时，银保监会出台的资管新规配套的财政政策、银保监会鼓励银行加大对小微企业的贷款、受相关信息提振，市场短期出现结构性反弹。8月上旬，美国商务部宣布新增对44家中国军工企业实施制裁，同时财政部宣布将对100亿美元进口的美国商品加征关税，市场随之出现回调。9月中旬，受土耳其汇率大幅贬值的影响，全球投资者对新兴市场陷入金融危机的担忧加剧，新兴市场整体跌幅较大，A股再次下跌。国内方面，债券市场调整后已逐渐企稳，信用债市场保持平稳，确定性是债市发展的核心，市场短期出现回调。9月中旬，受土耳其汇率大幅贬值的冲击，全球投资者对新兴市场陷入金融危机的担忧加剧，新兴市场整体跌幅较大，A股再次下跌。国内方面，债券市场调整后已逐渐企稳，信用债市场保持平稳，确定性是债市发展的核心，市场短期出现回调。
在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数跟踪和风险管理，积极把握超额收益。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期末基金份额净值为1.010元，较本报告期初增长率为1.01%，同期业绩比较基准收益率为1.28%。
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
本基金本报告期末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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	23,065,175.00	28.22
2	固定收益投资	21,064,174.00	26.22
3	银行存款	-	-
4	其他资产	-	-
5	负债及或有负债	-	-
6	报告期内权益类证券发行	26,362,143.27	32.92
7	报告期内固定收益类证券发行	57,023,109.00	70.90
8	合计	44,129,349.00	55.14

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；前任基金经理聘任日期为基金合同生效日。
2.证券从业的释义遵从行业协会《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大盘价值量化精选混合型证券投资基金的基金管理人，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》、《富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金合同》以及其他有关法律、法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为投资者争取份额和回报，切实维护基金持有人的合法权益，基金管理人承诺严格遵守基金合同，基金管理人严格遵守基金合同。
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律法规，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交易知情权、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，通过标准化的办理流程，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限制为限制行为，为非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执行行为进行分析评估，分析对象涵盖公募基金、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解释，并按法规要求上报相关监管机构。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季度国内宏观经济开始出现增速的放缓，其中基建投资在去杠杆的背景下放缓比较明显，地产在持续的严厉政策调控下开始放缓，房价开始调控，国际贸易摩擦仍然没有缓解，整体市场估值已经处于历史底部附近，但是市场风险偏好仍然不高，市场情绪非常悲观。
本基金在三季度表现不好，主要是持股中与国际贸易摩擦和宏观经济相关性较多，这部分仓位下较低。
本基金未来将淡化择时，选择基本面优质的公司，注重公司的核心竞争力和护城河，重视公司业绩的持续性和质量，重视公司的企业文化治理和合规文化，长期持有分享企业成长的价值。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期末基金份额净值为1.010元，较本报告期初增长率为1.01%，同期业绩比较基准收益率为1.28%。

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

	本报告期末	较期初(2018年07月31日-2018年09月30日)
1.本期利润总额	1,909,638.60	
2.本期净利润	1,283,505.09	
3.本期公允价值变动收益	689,137.51	
4.本期经营活动产生的现金流量净额	68,128,899.89	
5.本期基金份额持有人应得利润	4,268	

注：本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。
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

	基金净值增长率	业绩比较基准	差
本报告期	5.61%	6.01%	-0.40%
自基金合同生效起至今	1.01%	1.28%	-0.27%

注：本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。
自基金合同生效日至本报告期末期间净值增长率为：5.61%，业绩比较基准收益率为：6.01%。
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的比较

日期	基金净值增长率	业绩比较基准	差
2018-07-10	0.00%	0.00%	0.00%
2018-07-23	0.00%	0.00%	0.00%
2018-08-06	0.00%	0.00%	0.00%
2018-08-20	0.00%	0.00%	0.00%
2018-09-03	0.00%	0.00%	0.00%
2018-09-17	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-01	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-15	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-29	0.00%	0.00%	0.00%
2018-11-12	0.00%	0.00%	0.00%
2018-11-26	0.00%	0.00%	0.00%
2018-12-10	0.00%	0.00%	0.00%
2018-12-24	0.00%	0.00%	0.00%
2019-01-07	0.00%	0.00%	0.00%
2019-01-21	0.00%	0.00%	0.00%
2019-02-04	0.00%	0.00%	0.00%
2019-02-18	0.00%	0.00%	0.00%
2019-03-04	0.00%	0.00%	0.00%
2019-03-18	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-01	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-15	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-29	0.00%	0.00%	0.00%
2019-05-13	0.00%	0.00%	0.00%
2019-05-27	0.00%	0.00%	0.00%
2019-06-10	0.00%	0.00%	0.00%
2019-06-24	0.00%	0.00%	0.00%
2019-07-08	0.00%	0.00%	0.00%
2019-07-22	0.00%	0.00%	0.00%
2019-08-05	0.00%	0.00%	0.00%
2019-08-19	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-02	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-16	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-30	5.61%	6.01%	-0.40%

注：1.截止日期为2018年09月30日。
2.本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。本报告期为2018年7月10日至2018年9月30日。
4.1 基金经理(或基金经小组)简介
基金经理：王健
管理时间：2018-07-10 - 至今
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；前任基金经理聘任日期为基金合同生效日。
2.证券从业的释义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

	本报告期末	较期初(2018年07月31日-2018年09月30日)
1.本期利润总额	1,909,638.60	
2.本期净利润	1,283,505.09	
3.本期公允价值变动收益	689,137.51	
4.本期经营活动产生的现金流量净额	68,128,899.89	
5.本期基金份额持有人应得利润	4,268	

注：本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。
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

	基金净值增长率	业绩比较基准	差
本报告期	5.61%	6.01%	-0.40%
自基金合同生效起至今	1.01%	1.28%	-0.27%

注：本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。
自基金合同生效日至本报告期末期间净值增长率为：5.61%，业绩比较基准收益率为：6.01%。
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的比较

日期	基金净值增长率	业绩比较基准	差
2018-07-10	0.00%	0.00%	0.00%
2018-07-23	0.00%	0.00%	0.00%
2018-08-06	0.00%	0.00%	0.00%
2018-08-20	0.00%	0.00%	0.00%
2018-09-03	0.00%	0.00%	0.00%
2018-09-17	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-01	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-15	0.00%	0.00%	0.00%
2018-10-29	0.00%	0.00%	0.00%
2018-11-12	0.00%	0.00%	0.00%
2018-11-26	0.00%	0.00%	0.00%
2018-12-10	0.00%	0.00%	0.00%
2018-12-24	0.00%	0.00%	0.00%
2019-01-07	0.00%	0.00%	0.00%
2019-01-21	0.00%	0.00%	0.00%
2019-02-04	0.00%	0.00%	0.00%
2019-02-18	0.00%	0.00%	0.00%
2019-03-04	0.00%	0.00%	0.00%
2019-03-18	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-01	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-15	0.00%	0.00%	0.00%
2019-04-29	0.00%	0.00%	0.00%
2019-05-13	0.00%	0.00%	0.00%
2019-05-27	0.00%	0.00%	0.00%
2019-06-10	0.00%	0.00%	0.00%
2019-06-24	0.00%	0.00%	0.00%
2019-07-08	0.00%	0.00%	0.00%
2019-07-22	0.00%	0.00%	0.00%
2019-08-05	0.00%	0.00%	0.00%
2019-08-19	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-02	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-16	0.00%	0.00%	0.00%
2019-09-30	5.61%	6.01%	-0.40%

注：1.截止日期为2018年09月30日。
2.本基金于2018年7月10日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。本报告期为2018年7月10日至2018年9月30日。
4.1 基金经理(或基金经小组)简介
基金经理：王健
管理时间：2018-07-10 - 至今
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；前任基金经理聘任日期为基金合同生效日。
2.证券从业的释义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

富国低碳环保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	中国工商银行股份有限公司
报告截止日期	2018年9月30日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司董事会及高级管理人员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。
基金管理人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。
本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》及基金合同的《基金合同》等相关规定，恪尽职守，勤勉尽责，诚实信用，保障基金资产的安全与完整，保护基金份额持有人的合法权益。基金管理人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。
基金管理人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。

§2 基金产品概况

基金名称	富国低碳环保混合型证券投资基金
基金代码	000815
交易场所	上海证券交易所
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
基金发售起始日	2016年09月01日
基金合同生效日	2016年09月01日
本报告期末基金份额总额(单位：亿份)	13,296,465,795.26
本报告期末基金份额持有人户数(单位：户)	42,883

§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

	本报告期末	较期初(2018年07月31日-2018年09月30日)
1.本期利润总额	-380,196,164.64	
2.本期净利润	-488,184,841.42	
3.本期公允价值变动收益	198,326,570.42	
4.本期经营活动产生的现金流量净额	5,136,206,262.05	
5.本期基金份额持有人应得利润	2,368	

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

	基金净值增长率	业绩比较基准	差
本报告期	-1.27%	-1.47%	0.20%
自基金合同生效起至今	1.22%	1.04%	0.18%

注：过去三个月期间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增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

日期	基金净值增长率	业绩比较基准	差
2016-09-01	0.00%	0.00%	0.00%
2016-09-15	0.00%	0.00%	0.00%
2016-09-29	0.00%	0.00%	0.00%
2016-10-13	0.00%	0.00%	0.00%
2016-10-27	0.00%	0.00%	0.00%
2016-11-10	0.00%	0.00%	0.00%
2016-11-24	0.00%	0.00%	0.00%
2016-12-08	0.00%	0.00%	0.00%
2016-12-22	0.00%	0.00%	0.00%
2017-01-05	0.00%	0.00%	0.00%
2017-01-19	0.00%	0.00%	0.00%
2017-02-02	0.00%	0.00%	0.00%
2017-02-16	0.00%	0.00%	0.00%
2017-03-02	0.00%	0.00%	0.00%
2017-03-16	0.00%	0.00%	0.00%
2017-03-30	0.00%	0.00%	0.00%
2017-04-13	0.00%	0.00%	0.00%
2017-04-27	0.00%	0.00%	0.00%
2017-05-11	0.00%	0.00%	0.00%
2017-05-25	0.00%	0.00%	0.00%
2017-06-08	0.00%	0.00%	0.00%
2017-06-22	0.00%	0.00%	0.00%
2017-07-06	0.00%	0.00%	0.00%
2017-07-20	0.00%	0.00%	0.00%
2017-08-03	0.00%	0.00%	0.00%
2017-08-17	0.00%	0.00%	0.00%
2017-08-31	0.00%	0.00%	0.00%
2017-09-14	0.00%		