富国创业板指数分级证券投资基金

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	富国创业板指数分级		
场内简称	创业分级		
基金主代码	161022		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年09月12日		
报告期末基金份额总额	5,689,655,551.65		
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪创业板指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪创业板指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
业绩比较基准	95%×创业板指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。		
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	富国创业板指数分级A	富国创业板指数分级B	富国创业板指数分级
下属分级基金场内简称	创业板A	创业板B	创业分级
下属分级基金的交易代码	150152	150153	161022
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	1,897,894,615.00	1,897,894,615.00	1,893,866,321.65
下属分级基金的风险收益特征	富国创业板A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	富国创业板B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

§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	-561,098,910.27
2.本期利润	-785,747,367.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1004
4.期末基金资产净值	5,381,781,144.59
5.期末基金份额净值	0.946

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。

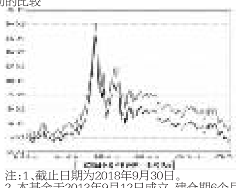
3.2 基金净值表现

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	-12.13%	1.41%	-11.55%	1.45%	-0.58%	-0.04%

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2013年9月12日成立，建仓期6个月，从2013年9月12日起至2014年3月11日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末（2018年09月30日）
创业板A与创业板B基金份额配比	1:1
期末创业板A份额参考净值	1.007
期末创业板A份额累计参考净值	1.283
期末创业板B份额参考净值	0.885
期末创业板B份额累计参考净值	2.217
富国创业板A的预计年收益率	5.00%

§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：任职日期	任本基金的基金经理期限：离任日期	证券从业年限	说明
方昱	本基金基金经理	2015-05-13	–	9	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，2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年7月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。
王保合	本基金基金经理	2013-09-12	–	12	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任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基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起任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基金经理，2015年5月起任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基金经理，2017年9月起任富国丰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；兼任量化投资部总经理。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创业板指数分级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》、《富国创业板指数分级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

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，宏观监管政策迎来微调。其中，央行、银保监会分别出台资管新规细则，在过渡期内对非标资产的清理不再一刀切，监管尺度有所放松。同时，国务院常委会决定实施更加积极的财政政策，银保监会鼓励银行加大对小微企业的贷款。受相关信息提振信心，市场迎来阶段性反弹。8月上旬，美国商务部宣布新增对44家中国军工企业技术封锁，同时美国政府宣布将对2000亿美元中国进口商品的惩罚性关税税率从之前建议的10%提高到25%。8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股也再次下跌。9月中旬，国务院强调把已定减税降费措施切实落实到位，确保社保费现有征收政策稳定，并表态进一步支持民营企业的发展。同时，美国宣布自9月24日起对华2000亿美元输美商品加征10%关税，2019年1月1日起加征关税税率提高到25%。随着中美贸易摩擦阶段性靴子落地，A股开启反弹行情。总体来看，2018年3季度上证综指下跌0.92%，沪深300下跌2.05%，创业板指下跌12.16%。在投资管理上，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。

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-12.13%，同期业绩比较基准收益率为-11.55%

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	4,880,149,620.96	90.37
	其中：股票	4,880,149,620.96	90.37
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	220,000,000.00	4.07
	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	296,981,411.56	5.50
7	其他资产	3,200,843.34	0.06
8	合计	5,400,331,875.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	80,802,311.57	1.50
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	21,437,990.00	0.40
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
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	102,240,301.57	1.90

5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	486,912,022.20	9.05
B	采矿业	–	–
C	制造业	2,308,678,095.86	42.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	84,399,336.27	1.57
F	批发和零售业	41,137,512.76	0.76
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	1,147,863,183.52	21.33
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	30,341,146.10	0.56
M	科学研究和技术服务业	14,573,520.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	137,499,384.77	2.55
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	269,980,177.87	5.02
R	文化、体育和娱乐业	256,524,940.04	4.77
S	综合	–	–
	合计	4,777,909,319.39	88.78

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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	300498	温氏股份	20,969,510	486,912,022.20	9.05
2	300059	东方财富	21,858,874	245,912,332.50	4.57
3	300003	乐普医疗	5,129,337	155,675,377.95	2.89
4	300124	汇川技术	5,530,038	153,182,052.60	2.85
5	300015	爱尔眼科	4,661,491	150,333,084.75	2.79
6	300142	沃森生物	6,575,079	143,336,722.20	2.66
7	300408	三环集团	6,088,699	126,584,052.21	2.35
8	300122	智飞生物	2,450,455	119,974,276.80	2.23
9	300136	信维通信	4,455,950	118,751,067.50	2.21
10	300024	机器人	6,777,397	110,674,893.01	2.06

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300750	宁德时代	503,160	36,730,680.00	0.68
2	300036	超图软件	755,400	16,732,110.00	0.31
3	300616	尚品宅配	160,837	14,380,436.17	0.27
4	300476	胜宏科技	868,100	13,334,016.00	0.25
5	300666	江丰电子	202,514	9,453,353.52	0.18

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	1,445,535.44
2	应收证券清算款	200,701.83
3	应收股利	–
4	应收利息	-37,737.79
5	应收申购款	1,592,343.86
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,200,843.34

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

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	富国创业板指数分级A	富国创业板指数分级B	富国创业板指数分级
报告期期初基金份额总额	4,017,655,780.00	4,017,655,780.00	2,417,220,353.62
报告期期间基金总申购份额	–	–	2,095,662,637.65
减：报告期期间基金总赎回份额	–	–	2,886,426,827.70
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-2,119,761,165.00	-2,119,761,165.00	267,410,158.08
报告期期末基金份额总额	1,897,894,615.00	1,897,894,615.00	1,893,866,321.65

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§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创业板指数分级证券投资基金的文件

2、富国创业板指数分级证券投资基金基金合同

3、富国创业板指数分级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、富国创业板指数分级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

富国纯债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	富国纯债债券发起式		
基金主代码	100066		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年11月22日		
报告期末基金份额总额	50,673,897.26		
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资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	基金将采用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。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的变化，动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。		
业绩比较基准	中债综合指数		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国纯债债券发起式A/B		富国纯债债券发起式C
下属分级基金的交易代码	前端	后端	
			100068
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	12,591,072.33		38,082,824.93

§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/B级 报告期（2018年07月01日－2018年09月30日）	C级 报告期（2018年07月01日－2018年09月30日）
1.本期已实现收益	226,326.35	744,121.05
2.本期利润	302,815.21	969,081.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0265	0.0252
4.期末基金资产净值	13,545,389.10	40,740,363.48
5.期末基金份额净值	1.076	1.070

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/B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	2.57%	0.09%	1.48%	0.06%	1.09%	0.03%

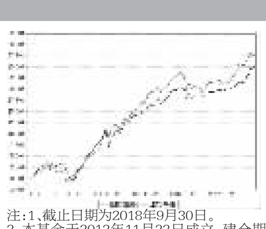
（2）C级

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	2.49%	0.09%	1.48%	0.06%	1.01%	0.03%

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

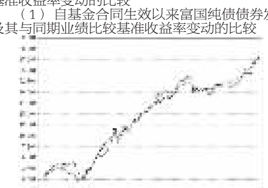
（1）自基金合同生效以来富国纯债债券发起式A/B基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2018年9月30日。

2、本基金于2012年11月22日成立，建仓期6个月，从2012年11月22日起至2013年5月21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纯债债券发起式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2018年9月30日。

2、本基金于2012年11月22日成立，建仓期6个月，从2012年11月22日起至2013年5月21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：任职日期	任本基金的基金经理期限：离任日期	证券从业年限	说明
王颀亮	本基金前任基金经理	2016-02-06	2018-07-04	8	硕士，曾任上海国利货币经纪有限公司经纪人，自2010年9月至2013年7月在富国基金管理有限公司任交易员；2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2014年8月至2016年6月任富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年4月至2016年1月任富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理，2015年4月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2015年4月至2016年6月任富国富钱包货币市场基金基金、富国天时货币市场基金基金经理；2015年11月至2018年1月任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理；2015年12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，2016年2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，2016年5月起任富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2016年8月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理，2016年12月起任富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
钟智伦	本基金前任基金经理	2015-03-13	2018-07-04	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。
范磊	本基金前任基金经理	2016-11-08	2018-07-04	8	硕士，曾任深圳发展银行资金高级专员、安信证券交易员；2012年6月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、投资经理，2016年8月起任富国优化增强债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金基金经理，2016年11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，2017年3月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年8月起任富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
武磊	本基金基金经理	2018-07-04	–	7	博士，2011年7月至2012年3月任华泰联合证券有限责任公司研究员；2012年4月至2013年7月任华泰证券股份有限公司投资经理；2013年8月至2014年10月任国泰君安证券股份有限公司资本市场部董事；2014年11月至2016年12月任上海国泰君安证券资产管理有限公司投资经理；2016年12月加入富国基金管理有限公司，2017年3月起任富国产业债债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起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，2018年4月起任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018年7月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018年8月起任富国中债-1-3年国开行债券指数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纯债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》、《富国纯债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

2018年三季度中国经济总体平稳，固定资产投资、工业生产、消费等宏观指标有所回落，中美贸易争端使得宏观经济面临一定的不确定性，政策适当调整以稳定预期。货币政策方面，央行继续通过中期借贷便利（MLF）操作和公开市场操作等方式平抑资金波动，流动性总体较为平稳。债券市场走势向好，"宽信用"和"稳基建"预期下，利率债走势震荡，信用债有所回暖。本基金通过优化持仓结构，适时调整久期和杠杆，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/B级为2.57%，C级为2.49%，同期业绩比较基准收益率A/B级为1.48%，C级为1.48%

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	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	73,048,565.00	95.56
	其中：债券	73,048,565.00	95.56
	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	1,867,653.67	2.44
7	其他资产	1,528,965.67	2.00
8	合计	76,445,184.34	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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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	427,300.00	0.79
2	央行票据	–	–
3	金融债券	40,112,700.00	73.89
	其中：政策性金融债	40,112,700.00	73.89
4	企业债券	29,474,965.00	54.30
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	3,033,600.00	5.59
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	73,048,565.00	134.56

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	180204	18国开04	200,000	20,582,000.00	37.91
2	180210	18国开10	100,000	9,873,000.00	18.19
3	018005	国开1701	66,000	6,639,600.00	12.23
4	136101	15合景01	45,000	4,495,950.00	8.28
5	101800720	18苏沙钢MTN002	30,000	3,033,600.00	5.59

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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,319.09
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,276,280.45
5	应收申购款	231,366.13
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,528,965.67

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：本基金本报告期末未持有股票。

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	A/B级	C级
报告期期初基金份额总额	11,449,601.73	37,784,393.94
报告期期间基金总申购份额	2,883,079.53	19,833,252.70
减：报告期期间基金总赎回份额	1,741,608.93	19,534,821.71
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	12,591,072.33	38,082,824.93

§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（%）	–

注：买入/申购含红利再投、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 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	–	–	–	–	—
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	–	–	–	–	—

注：截至本报告期末，本基金未有本公司运用固有资金认购的份额。

§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

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。

§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纯债债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国纯债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、富国纯债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

富国丰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:	交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	富国丰利增强债券
基金主代码	004902
交易代码	004902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年09月05日
报告期末基金份额总额（单位：份）	207,734,430.96
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	本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率*80%+中证500指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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	交通银行股份有限公司

§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	1,143,045.77
2.本期利润	414,960.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0019
4.期末基金资产净值	208,257,364.21
5.期末基金份额净值	1.0025

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	0.12%	0.25%	-1.11%	0.25%	1.23%	0.00%

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9月5日成立，建仓期6个月，从2017年9月5日起至2018年3月4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：任职日期	任本基金的基金经理期限：离任日期	证券从业年限	说明
王保合	本基金基金经理	2017-09-05	–	12	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任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基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起任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基金经理，2015年5月起任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基金经理，2017年9月起任富国丰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；兼任量化投资部总经理。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丰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》、《富国丰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。

三季度组合在债券操作上，组合降低了长久期利率债的仓位，进行了一定的择时操作，不过债券利率震荡反复，择时表现较难。信用债则延续分化，组合整体仍以高等级为主，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，仍以中证500指数增强仓位做配置，但整体仓位有所低配。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0.12%，同期业绩比较基准收益率为-1.11%

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，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

§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	39,670,292.33	14.09
	其中：股票	39,670,292.33	14.09
2	固定收益投资	226,567,146.00	80.48
	其中：债券	226,567,146.00	80.48
	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	2,350,000.00	0.83
	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	5,306,721.71	1.88
7	其他资产	7,637,048.07	2.71
8	合计	281,531,208.11	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	588,700.00	0.28
B	采矿业	1,472,699.00	0.71
C	制造业	23,893,495.90	11.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,118,607.00	0.54
E	建筑业	389,535.00	0.19
F	批发和零售业	2,650,280.00	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	938,945.00	0.45
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,242,001.11	1.56
J	金融业	1,010,499.92	0.49
K	房地产业	3,067,323.40	1.47
L	租赁和商务服务业	467,382.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	108,951.00	0.05
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	442,545.00	0.21
S	综合	279,328.00	0.13
	合计	39,670,292.33	19.05

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	601717	郑煤机	91,400	642,542.00	0.31
2	300146	汤臣倍健	31,100	637,550.00	0.31
3	002353	杰瑞股份	26,500	577,170.00	0.28
4	600426	华鲁恒升	31,600	543,836.00	0.26
5	603589	口子窖	10,400	535,600.00	0.26
6	600823	世茂股份	123,700	523,199.00	0.25
7	601233	桐昆股份	31,820	523,120.80	0.25
8	600521	华海药业	22,940	502,156.60	0.24
9	000401	冀东水泥	45,400	490,320.00	0.24
10	002195	二三四五	112,040	481,772.00	0.23

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	54,094,776.00	25.97
	其中：政策性金融债	54,094,776.00	25.97
4	企业债券	111,605,370.00	53.59
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	60,867,000.00	29.23
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	226,567,146.00	108.79

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	180409	18农发09	200,000	20,276,000.00	9.74
2	101800075	18凤凰传媒MTN001	100,000	10,344,000.00	4.97
3	101800788	18长发集团MTN001	100,000	10,171,000.00	4.88
4	101551006	15京汽MTN001	100,000	10,156,000.00	4.88
5	143449	18航租01	100,000	10,154,000.00	4.88

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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定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	22,958.44
2	应收证券清算款	3,894,581.25
3	应收股利	–
4	应收利息	3,719,508.38
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,637,048.07

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	211,108,558.84
报告期期间基金总申购份额	26,334,808.95
减：报告期期间基金总赎回份额	29,708,936.83
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	207,734,430.96

§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	10,006,200.62
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	10,006,200.62
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.82

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	10,006,200.62	4.82	10,006,200.62	4.82	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	10,006,200.62	4.82	10,006,200.62	4.82	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：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	报告期末持有基金情况：持有份额	份额占比
机构	1	2018-07-01至2018-09-30	79,908,683.35	–	–	79,908,683.35	38.47%
机构	2	2018-07-01至2018-09-30	69,364,825.36	4,993,008.39	19,712,692.21	54,645,141.54	26.31%

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丰利增强债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国丰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、富国丰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