

富国改革动力混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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 跨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,中国经济在政策刺激和全球大宗商品价格影响之下,A股震荡下行,竞争力薄弱和经营风险较大的公司关注度未变。本基金在三季度进行了适度调仓,重点增加财务稳健竞争力较强的动力力量较强的公司,获得了一定的超额收益。未来本基金仍然按照该思路进行调整。

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-4.47%,同期业绩比较基准收益率为-1.43%。

4.6 报告期内管理人对于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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	2,127,027,827.14	86.44
2	固定收益投资	2,127,027,827.14	86.44
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	322,987,266.23	12.63
7	其他资产	706,030.03	0.03
8	合计	2,456,743,946.50	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

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A 农林牧渔	3,495,348.10	0.10
B 医药生物	6,812,064.36	0.28
C 制造业	1,219,426,014.85	52.76
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 信息技术	-	-
F 交通运输、仓储和邮政业	130,721,972.31	5.33
G 交通运输、仓储和邮政业	34,362,000.00	1.40
H 住宿和餐饮业	-	-
I 信息、软件和信息技术服务业	210,239,488.16	8.57
J 金融业	246,998,402.12	10.07
K 采矿业	87,303,000.00	3.55
L 房地产业	194,116,280.00	7.89
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 农林牧渔、医药、公用事业	-	-
P 教育	-	-
Q 综合类	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 国防	-	-
合计	2,127,027,827.14	86.07

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	000059	五粮液	6,280,449	210,239,488.16	8.57
2	300026	贝瑞生物	10,200,074	191,286,276.60	7.80
3	000029	中航电子	3,200,000	162,282,000.00	6.63
4	000039	贵州茅台	172,300	126,053,000.00	5.12
5	002018	中航工业	1,408,211	122,902,624.00	5.06
6	002023	碧水源	6,999,595	115,075,767.00	4.69
7	002624	完美世界	2,288,399	110,277,818.00	4.48
8	000031	三一重工	11,909,903	106,869,120.00	4.34
9	002019	中航光电	20,000,000	92,400,000.00	3.77

5.4 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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160207	16国开07	2,280,144,219	92.39
2	160208	16国开08	2,280,144,219	92.39
3	160209	16国开09	2,280,144,219	92.39
4	160210	16国开10	2,280,144,219	92.39
5	160211	16国开11	2,280,144,219	92.39

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贵金属投资明细

无。

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五名权证投资明细

无。

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。

6 开放式基金份额变动

项目	基金份额总额(单位:份)
报告期末基金份额总额	1,252,051,914.31
报告期内基金份额总额增加	21,268,625.65
报告期内基金份额总额减少	148,440,225.51
报告期内基金份额总额变动(申购赎回+转换+净赎回)	1,230,880,264.30

7 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额(单位:份)	占基金总份额比例(%)
报告期末基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-
报告期内基金管理人持有本基金份额	-

8 报告期内基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

无。