

## 信息披露

## 富国军工主题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
报告送出日期	2018年10月26日

## §1 重要提示

富国基金管理有限公司董事会及监事会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。自2018年10月25日披露之日起，本报告由本司网站（www.fund001.com.cn）及中国证监会指定信息披露网站（www.cninfo.com.cn）予以公告，投资者可通过上述渠道查阅本报告全文。基金的投资业绩并不代表其未来表现，投资者在阅读本报告时应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及基金产品资料概要等文件。本报告所载数据截止日为2018年9月30日。

基金名称	富国军工主题混合
基金代码	000609
交易代码	000609
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月16日
报告期末基金份额总额(单位:份)	302,589,279.27
投资目标	本基金主要投资于军工主题相关证券,通过个股和个股组合,力争为基金份额持有人实现长期资本增值,并力争在控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的方式进行资产配置,着重于个股和个股组合的精选,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	中证军工指数收益率×80%+中国国债收益率收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于证券投资基金中较高风险和收益的品种。本基金投资范围包括科创板股票,科创板股票具有上市首日涨跌幅限制放宽等特殊风险,本基金投资科创板股票可能面临科创板个股流动性不足、科创板个股业绩波动较大、科创板个股估值较高等特殊风险。
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

主要财务指标	报告期(2018年07月01日至2018年09月30日)
1.本期利润总额	-6,497,028.94
2.本期净利润	-2,967,628.74
3.本期基金份额净值增长率	-0.01%
4.本期基金份额净值	1.04,144,880.00
5.期末基金份额净值	0.8803

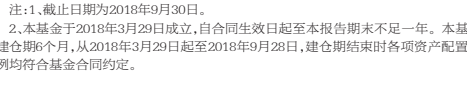
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## §2 基金净值表现

3.1 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对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	0.03%	0.03%	0.03%	0.03%	0.00%	0.00%

注:过去三个月指2018年7月1日至2018年9月30日。  
3.2 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



注:1.截止日期为2018年9月30日。  
2.本基金于2016年12月16日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年,本基金建仓六个月,从2016年3月29日起至2018年9月28日,建仓期间各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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26日

## §1 重要提示

富国基金管理有限公司董事会及监事会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。自2018年10月25日披露之日起,本报告由本司网站(www.fund001.com.cn)及中国证监会指定信息披露网站(www.cninfo.com.cn)予以公告,投资者可通过上述渠道查阅本报告全文。基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在阅读本报告时应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及基金产品资料概要等文件。本报告所载数据截止日为2018年9月30日。

基金名称	富国可转债债券
基金代码	000601
交易代码	000601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月16日
报告期末基金份额总额(单位:份)	305,869,436.00
投资目标	本基金主要投资于可转债等具有较好投资特性的品种,通过“自上而下”与“自下而上”相结合的方式,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:中证转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险和收益相对较低的品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币型基金。本基金投资范围包括科创板股票,科创板股票具有上市首日涨跌幅限制放宽等特殊风险,本基金投资科创板股票可能面临科创板个股流动性不足、科创板个股业绩波动较大、科创板个股估值较高等特殊风险。
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

主要财务指标	报告期(2018年07月01日至2018年09月30日)
1.本期利润总额	-6,453,774.62
2.本期净利润	-2,610,448.29
3.本期基金份额净值增长率	0.06%
4.期末基金份额净值	1.07

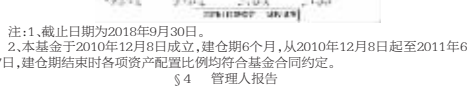
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## §2 基金净值表现

3.1 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对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	0.07%	0.03%	0.07%	0.03%	0.00%	0.00%

注:过去三个月指2018年7月1日至2018年9月30日。  
3.2 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



注:1.截止日期为2018年9月30日。  
2.本基金于2016年12月16日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年,本基金建仓六个月,从2016年3月29日起至2018年9月28日,建仓期间各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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26日

## §1 重要提示

富国基金管理有限公司董事会及监事会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。自2018年10月25日披露之日起,本报告由本司网站(www.fund001.com.cn)及中国证监会指定信息披露网站(www.cninfo.com.cn)予以公告,投资者可通过上述渠道查阅本报告全文。基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在阅读本报告时应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及基金产品资料概要等文件。本报告所载数据截止日为2018年9月30日。

基金名称	富国可转债债券
基金代码	000601
交易代码	000601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月16日
报告期末基金份额总额(单位:份)	305,869,436.00
投资目标	本基金主要投资于可转债等具有较好投资特性的品种,通过“自上而下”与“自下而上”相结合的方式,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:中证转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险和收益相对较低的品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币型基金。本基金投资范围包括科创板股票,科创板股票具有上市首日涨跌幅限制放宽等特殊风险,本基金投资科创板股票可能面临科创板个股流动性不足、科创板个股业绩波动较大、科创板个股估值较高等特殊风险。
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

主要财务指标	报告期(2018年07月01日至2018年09月30日)
1.本期利润总额	96,516,790.08
2.本期净利润	46,516,790.08
3.本期基金份额净值增长率	0.00%
4.期末基金份额净值	1.07

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据。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。

## §2 基金净值表现

3.1 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对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	0.07%	0.03%	0.07%	0.03%	0.00%	0.00%

注:过去三个月指2018年7月1日至2018年9月30日。  
3.2 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



注:1.截止日期为2018年9月30日。  
2.本基金于2016年12月16日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年,本基金建仓六个月,从2016年3月29日起至2018年9月28日,建仓期间各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 富国军工主题混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

姓名	职务	任本基金基金经理的任期	证券从业年限	说明
王昭昊	本基金基金经理	2018-03-29	8	硕士,毕业于南开大学,2010年7月加入富国基金管理有限公司,2010年12月加入富国军工主题混合基金基金经理助理,2014年12月正式担任富国军工主题混合基金基金经理。2015年12月加入富国军工主题混合基金基金经理助理,2017年12月正式担任富国军工主题混合基金基金经理。2018年12月加入富国军工主题混合基金基金经理助理,2019年12月正式担任富国军工主题混合基金基金经理。具有基金从业资格,具有多年证券从业经历。

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决定的解聘日期,前任基金经理任期以基金合同生效日。  
2.证券从业年限以行业协会《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军工主题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》、《富国军工主题混合型证券投资基金基金合同》及其他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、确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,基金投资组合符合有关法律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律法规要求,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、事后评估及反馈的闭环化管理。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。

事前控制主要包括:1.一级市场,通过标准化的办公流程,对相关方审核、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,对投资的标的、交易对手和操作权限进行自动控制。  
事中监控主要包括:合理设置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.将主动投资组合的日内反向交易列为限制行为,未经特别授权程序不得进行,不得进行与同日反向交易;通过交易系统对反向交易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:组合间一投资标的的临近交易日的反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)的季节性交易分析评估等;1.通过公平性交易的专项分析评估系统,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按规范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且超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析  
报告期内,中美贸易局有进一步升级的迹象,同时部分经济数据开始显露走弱,对中国经济的悲观预期有所上升。政策对冲经济下行的措施有所加码,增加地方债供给,个税减免式落地等等,但总体来看,对冲经济下行压力仍低于市场预期,政策整体偏向进一步宽松。应注意到,中美经济周期处于不同的阶段,美国处于加息周期并收紧逐步QE,经济基本面仍在继续走好,而我国当前情况则较为不同,在存量背景下国内政策在平衡汇率与利率之间陷入两难的境地。从历史来看,中美利差一直存在隐形的锚,这也是不可能三角中国内货币政策独立于正常被干扰的原因,但我们认为随着中美贸易战的升级,以美元为核心的经济体系在不断下降的环境下,中美利差可能出现的收敛,国内货币政策的独立空间有所提升。从这一层面来看,未来政策对于经济的底线会更加加码,力度也会更大。从投资层面来看,本组合一直秉持基本面选券的原则,致力于寻找经营持续稳定,政策关注度不断提升,行业集中度逐渐提升的龙头企业,同时结合转债板块对于投资者博弈的良好预期,寻找高性价比的标的。

4.5 报告期内基金的投资表现  
本报告期,本基金份额净值增长率为0.37%,同期业绩比较基准收益率为-1.53%。本报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情况的说明  
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 报告期末按资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	169,581,074.62	93.12
2	其中:股票	169,581,074.62	93.12
3	固定收益投资	-	-
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	10,493,010.00	5.98
7	其他资产	1,166,160.25	0.60
8	合计	180,238,244.87	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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	3,203,262.00	1.80
C	采矿业	146,971,464.42	81.36
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	18,315,487.20	10.17
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	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
P	教育	-	-
Q	其他	-	-
合计		169,581,074.62	93.00

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	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600188	东方集团	1,225,000	4,237,010.00	1.48
2	300269	顺邦股份	130,240	4,237,010.00	1.50
3	002271	东方网络	252,504	3,044,986.72	1.09
4	600039	四川路桥	400,000	3,340,000.00	1.31
6	600031	三一重工	138,943	1,840,063.84	0.66
6	601263	耀客股份	99,970	1,840,063.84	0.67

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十名债券投资明细

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	122006	东财转债	327,723	37,794,227.67	10.37
2	120014	神州转债	216,230	32,087,647.88	8.97
3	110002	招商转债	319,380	32,060,198.00	8.79
4	110042	华电转债	271,200	30,191,000.00	8.39
5	120006	恒顺转债	246,420	29,388,565.80	8.12

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	122006	东财转债	327,723	37,794,227.67	10.37
2	120014	神州转债	216,230	32,087,647.88	8.97
3	110002	招商转债	319,380	32,060,198.00	8.79
4	110042	华电转债	271,200	30,191,000.00	8.39
5	120006	恒顺转债	246,420	29,388,565.80	8.12

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资情况  
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
5.9.2.1 本基金股指期货投资的投资策略  
5.9.2.2 本基金股指期货投资的投资范围  
5.9.2.3 本基金股指期货投资的投资比例  
5.9.2.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.3 股指期货投资的投资政策  
5.9.3.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.3.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.3.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.3.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.4 股指期货投资的投资政策  
5.9.4.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.4.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.4.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.4.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.5 股指期货投资的投资政策  
5.9.5.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.5.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.5.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.5.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.6 股指期货投资的投资政策  
5.9.6.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.6.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.6.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.6.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.7 股指期货投资的投资政策  
5.9.7.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.7.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.7.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.7.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.8 股指期货投资的投资政策  
5.9.8.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.8.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.8.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.8.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.9 股指期货投资的投资政策  
5.9.9.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.9.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.9.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.9.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.10 股指期货投资的投资政策  
5.9.10.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.10.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.10.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.10.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.11 股指期货投资的投资政策  
5.9.11.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.11.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.11.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.11.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.12 股指期货投资的投资政策  
5.9.12.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.12.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.12.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.12.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.13 股指期货投资的投资政策  
5.9.13.1 股指期货投资的投资策略  
5.9.13.2 股指期货投资的投资范围  
5.9.13.3 股指期货投资的投资比例  
5.9.13.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

## 富国可转债债券

## 2018年第三季度报告

富国基金管理有限公司董事会及监事会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。自2018年10月25日披露之日起,本报告由本司网站(www.fund001.com.cn)及中国证监会指定信息披露网站(www.cninfo.com.cn)予以公告,投资者可通过上述渠道查阅本报告全文。基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在阅读本报告时应仔细阅读基金合同、基金招募说明书及基金产品资料概要等文件。本报告所载数据截止日为2018年9月30日。

4.1 基金管理人(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的任期	证券从业年限	说明
王昭昊	本基金基金经理	2018-03-29	8	硕士,毕业于南开大学,2010年7月加入富国基金管理有限公司,2010年12月加入富国可转债债券基金基金经理助理,2014年12月正式担任富国可转债债券基金基金经理。2015年12月加入富国可转债债券基金基金经理助理,2017年12月正式担任富国可转债债券基金基金经理。2018年12月加入富国可转债债券基金基金经理助理,2019年12月正式担任富国可转债债券基金基金经理。具有基金从业资格,具有多年证券从业经历。</