

富国高端制造行业股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

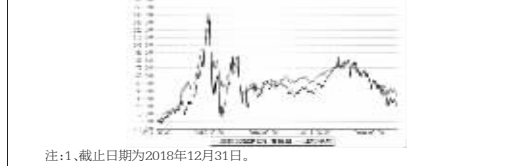
2018年12月31日	
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期	2019年01月19日
§1 重要提示	
富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金管理人中国建设银行股份有限公司富国基金托管人承诺,为2018年1月17日起截止本报告期内所涉资产、净值和基金份额净值等信息,保证报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。 富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应自行判断本基金的投资风险。 本报告材料未经审计。 本报告书2018年10月1日起至2018年12月31日止。	

§2 基金产品概况	
基金名称	富国高端制造行业股票型证券投资基金
基金代码	000513
交易代码	前端交易代码:000513 后端交易代码:000514
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年06月20日
报告期末基金份额总额(单位:份)	415,814,201.12
投资目标	本基金主要投资于高端制造行业相关股票,通过个股和个股组合,力求为基金份额持有人获取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、中观、微观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	中证800指数收益率×80%+中国国债收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币型基金。
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10月1日至2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-31,227,934.92
2.本期利润	-88,460,274.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2134
4.期末基金资产净值	408,007,000.00

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率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对比	

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	-15.10%	1.80%	-0.63%	1.32%	-14.47%	0.48%
注:过去三个月指2018年10月1日至2018年12月31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12月31日。

2018年12月31日	
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	2019年01月19日
§1 重要提示	
富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺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。 基金管理人中国建设银行股份有限公司富国基金托管人承诺,为2018年1月17日起截止本报告期内所涉资产、净值和基金份额净值等信息,保证报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。 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,投资者在作出投资决策前应自行判断本基金的投资风险。 本报告材料未经审计。 本报告书2018年10月1日起至2018年12月31日止。	

§2 基金产品概况	
基金名称	富国低碳新经济混合型证券投资基金
基金代码	001085
交易代码	001085
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月18日
报告期末基金份额总额(单位:份)	162,576,176.24
投资目标	本基金主要投资于低碳新经济主题相关股票,通过精选个股和个股组合,力求为基金份额持有人获取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、中观、微观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	本基金业绩比较基准为:中证800指数收益率×60%+中国国债收益率×40%。
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高于债券型基金与货币型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益和预期风险水平的基金品种。
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10月1日至2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-20,215,475.40
2.本期利润	-76,783,656.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1305
4.期末基金资产净值	582,497,568.91
5.期末基金份额净值	1.064

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率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对比	

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.65%	1.71%	-6.81%	0.93%	-4.84%	0.72%
注:过去三个月指2018年10月1日至2018年12月31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						



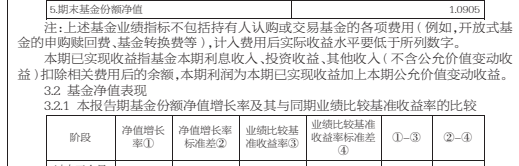
2018年12月31日	
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期	2019年01月19日
§1 重要提示	
富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金管理人中国建设银行股份有限公司富国基金托管人承诺,为2018年1月17日起截止本报告期内所涉资产、净值和基金份额净值等信息,保证报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。 富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应自行判断本基金的投资风险。 本报告材料未经审计。 本报告书2018年10月1日起至2018年12月31日止。	

§2 基金产品概况	
基金名称	富国纯债债券型证券投资基金
基金代码	004726
交易代码	004726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月28日
报告期末基金份额总额(单位:份)	201,513,932.78
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供稳定的长期收益及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行主动投资管理,采取价值分析方法,分析并判断宏观经济、货币、利率、通货膨胀等宏观指标对债券市场的影响,自上而下确定资产配置及大类资产配置,同时“自下而上”的精选个股,在控制信用风险、流动性风险、供求关系、利率风险、税收水平等因素的基础上,自下而上精选个股,把握固定收益类资产的投资机会。
业绩比较基准	中证综合债指数(简称)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,在通常情况下预期风险和预期收益低于股票型基金和货币型基金,属于较低预期风险和预期收益的基金品种。
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10月1日至2018年12月31日)
1.本期已实现收益	2,828,648.68
2.本期利润	4,467,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0221
4.期末基金资产净值	219,750,039.19
5.期末基金份额净值	1.0906

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率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对比	

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.07%	0.04%	2.43%	0.04%	-0.36%	0.00%
注:过去三个月指2018年10月1日至2018年12月31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						



2018年12月31日	
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	2019年01月19日
§1 重要提示	
富国基金管理有限公司的董事会及董事承诺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。 基金管理人中国建设银行股份有限公司富国基金托管人承诺,为2018年1月17日起截止本报告期内所涉资产、净值和基金份额净值等信息,保证报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。 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,投资者在作出投资决策前应自行判断本基金的投资风险。 本报告材料未经审计。 本报告书2018年10月1日起至2018年12月31日止。	

§2 基金产品概况	
基金名称	富国纯债债券型证券投资基金
基金代码	004726
交易代码	004726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月28日
报告期末基金份额总额(单位:份)	201,513,932.78
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供稳定的长期收益及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行主动投资管理,采取价值分析方法,分析并判断宏观经济、货币、利率、通货膨胀等宏观指标对债券市场的影响,自上而下确定资产配置及大类资产配置,同时“自下而上”的精选个股,在控制信用风险、流动性风险、供求关系、利率风险、税收水平等因素的基础上,自下而上精选个股,把握固定收益类资产的投资机会。
业绩比较基准	中证综合债指数(简称)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,在通常情况下预期风险和预期收益低于股票型基金和货币型基金,属于较低预期风险和预期收益的基金品种。
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

注:1.截止日期为2018年12月31日。

§1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
任职日期	离任日期
姓名	说明
杨楠	本基金基金经理
2015-12-18	2018-10-2
8	

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	
本报告期内,富国基金管理有限公司作为富国高端制造行业股票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》、《富国高端制造行业股票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,以风险控制为优先,力求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约定。	
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,并持续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池、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作流程进行自动化控制。	
事中监控主要包括组合间相似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;3.主动主动投资组合的同日反向交易行为限制行为,为非特特别控制流程审核问题,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.同一基金管理人管理的不同组合,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交易行为进行分析评估,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管理人管理不同组合间的交易行为;若发现异常交易行为,风险管理部按照要求对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超过该证券当日成交量5%的情况。	
4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析	
15年三季度沪深两市连续两个季度下跌,这也是近10年以来未有出现过的情况,其中沪深800指数下跌12.6%,创业板下跌11.4%。	
本季度市场一路下跌,市场的悲观情绪和低迷程度远超我们预期,期间我们连续配置了地产、电力等行业,受限于基金整体仓位高,重仓个股表现不佳,期间净值表现较差。	
4.5 报告期内基金的投资业绩和净值增长率	
本报告期,本基金份额净值增长率为-15.10%,同期业绩比较基准收益率为-9.63%。本基金本报告期末对基金持有人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。	

				公司进行研究,2005年11月至2007年11月以博时优势证券投资基金为主,2007年4月至2008年6月启动主题轮动混合证券投资,2008年6月启动主题轮动混合证券投资,2014年6月起兼任富国高端制造行业股票型证券投资基金基金经理,2015年6月起兼任富国高端制造行业股票型证券投资基金基金经理,2015年6月至2017年10月兼任博时主题轮动混合证券投资基金经理,2016年2月起兼任富国创新驱动灵活配置股票型证券投资基金基金经理、兼任股权投资部总监,具有一级从业资格。		
田天宇	本基金基金经理	2014-06-02	0		18	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
代码	行业类别
A	农、林、牧、渔业
B	采矿业
C	制造业
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
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

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	
本报告期内,富国基金管理有限公司作为富国高端制造行业股票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》、《富国高端制造行业股票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,以风险控制为优先,力求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约定。	
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,并持续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池、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作流程进行自动化控制。	
事中监控主要包括组合间相似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;3.主动主动投资组合的同日反向交易行为限制行为,为非特特别控制流程审核问题,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.同一基金管理人管理的不同组合,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交易行为进行分析评估,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管理人管理不同组合间的交易行为;若发现异常交易行为,风险管理部按照要求对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超过该证券当日成交量5%的情况。	
4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析	
15年三季度沪深两市连续两个季度下跌,这也是近10年以来未有出现过的情况,其中沪深800指数下跌12.6%,创业板下跌11.4%。	
本季度市场一路下跌,市场的悲观情绪和低迷程度远超我们预期,期间我们连续配置了地产、电力等行业,受限于基金整体仓位高,重仓个股表现不佳,期间净值表现较差。	
4.5 报告期内基金的投资业绩和净值增长率	
本报告期,本基金份额净值增长率为-15.10%,同期业绩比较基准收益率为-9.63%。本基金本报告期末对基金持有人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。	

注:1.截止日期为2018年12月31日。

2.本基金于2015年12月18日成立,建仓期6个月,从2015年12月18日起至2016年6月17日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。	
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
任职日期	离任日期
姓名	说明
杨楠	本基金基金经理
2015-12-18	2018-10-2
8	

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。

§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		
杨栋	本基金基金经理	2015-12-18	-	8	硕士，自2011年5月至2015年8月在富国基金管理有限公司任助理行业研究员、行业研究员；自2015年8月起任富国天合稳健优选混合型证券投资

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
代码	行业类别
A	农、林、牧、渔业
B	采矿业
C	制造业
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
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

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。	</
--------------------------------------	----