

信息披露

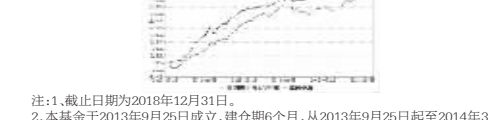
富国国有企业债债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

注:过去三个月指2018年12月27日-2018年12月31日。

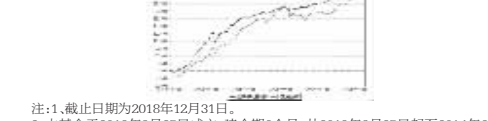
3.22 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1)自基金合同生效以来富国国有企业债债券A基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



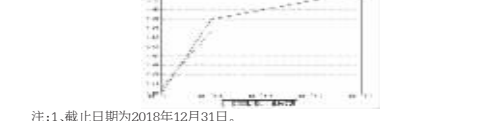
注:1.截止日期为2018年12月31日。
2.本基金于2013年9月26日成立,建仓期6个月,从2013年9月26日起至2014年3月24日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2)自基金合同生效以来富国国有企业债债券C基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.截止日期为2018年12月31日。
2.本基金于2013年9月26日成立,建仓期6个月,从2013年9月26日起至2014年3月24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)自基金合同生效以来富国国有企业债债券D基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.截止日期为2018年12月31日。
2.本基金于2013年9月26日成立,建仓期6个月,从2013年9月26日起至2014年3月24日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.23 本基金2018年12月26日起增加收取销售服务费的场所——D份额。

4.1 基金经理(或基金经小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理日期	证券从业年限	说明
王亚彬	本基金基金经理	2016-08-22	-	8

注:1.截止日期为2018年12月31日。
2.本基金于2016年8月22日成立,建仓期6个月,从2016年8月22日起至2017年1月13日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.2 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国家安全主题混合型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投资基金法》、《富国国家安全主题混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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1次同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交总量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年四季度,国内经济或将继续保持稳健的态势,国内经济进入稳增长阶段。国外政治经济环境的变化将继续给我国更加强调技术创新、自主可控的重要性。

通过目前日下的策略按照本基金的国家安全主题投资策略,继续维持对质地比较优、竞争壁垒较高、管理层支持力度较强、或属国家安全主题的行业和公司进行配置,主要考虑的是产能配置方向向高端制造及军工及信息化、网络安全等,工业互联网安全控制,医疗健康信息化,化合物半导体、激光半导体、通信5G安全等。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

本报告期内,本基金份额净值增长率为-16.42%,同期业绩比较基准收益率为-9.63%。

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况的说明

本本基金本报告期无需说明相关情况。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,226,220,836.73	93.07
1.1	其中:股票	1,226,220,836.73	93.07
2	固定收益投资	-	-
2.1	其中:债券	-	-
3	货币资金	-	-
3.1	其中:银行存款	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
4.1	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	银行存款和备付金合计	89,458,723.65	6.72
7	其他资产	2,765,314.26	0.21
8	合计	1,318,444,874.63	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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	616,312,062.97	46.99
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
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	60,146,000	0.00
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	5,179,850.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计		133,997,361.20	9.98

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

行业名称	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
材料	7,309,000.00	0.54%
合计	7,309,000.00	0.54%

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国家安全主题混合型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投资基金法》、《富国国家安全主题混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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总量5%的情况。

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国企改革灵活配置混合型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投资基金法》、《富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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总量5%的情况。

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国企改革灵活配置混合型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投资基金法》、《富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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总量5%的情况。

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国企改革灵活配置混合型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投资基金法》、《富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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总量5%的情况。

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国企改革灵活配置混合型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投资基金法》、《富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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总量5%的情况。

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国企改革灵活配置混合型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投资基金法》、《富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。

通过公平性交易的交易所事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投行进行进一步分析评估,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、总经理审核签字后,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,报告期内各投资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总量5%的情况。

注:1.上述任职日期为根据公司章程确定的聘任日期,离任日期为根据公司章程确定的解聘日期;前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,富国基金管理有限公司作为富国国企改革灵活配置混合型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投资基金法》、《富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金合同》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律法规及基金合同约定的。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金经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,并持续各组合的独立投资风格。

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同投资标的的交易所方向、市场询价的反馈、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,为非特制控制流程审核同意,不得进行;2.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,必须通过交易系统来统一控制,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)的季节公平交易分析评估等。