

富国价值优势混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

1.1 重要提示
富国基金管理有限公司董事会、董事及高级管理人员不存在违法违规、损害投资者合法权益的行为。报告期内基金管理人不存在违法违规、损害投资者合法权益的行为。

1.2 基金简介
1.2.1 基金基本情况
基金名称:富国价值优势混合型证券投资基金
基金代码:005360

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金采用自上而下的方式,通过精选个股和权益资产,力争获取中长期、稳定的超额收益。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

注:公司已于2019年03月28日发布《富国基金管理有限公司关于升级管理人变更的公告》,自2019年03月27日起担任公司董事长。

2.4 信息披露方式
基金管理人网站:www.fund008.com.cn

注:信息披露截止为截止至本报告期末止。

3.1 主要财务数据和财务指标
金额单位:人民币元

Table with 2 columns: 2018年, 2017年. Rows include 3.1.1 本期主要财务指标, 3.1.2 本期基金份额净值, 3.1.3 本期基金份额持有人数量.

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用(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如表下列所示。

3.2 基金净值增长表现及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.1 基金净值增长表现及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金业绩比较基准:中证800指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准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。
2.本基金于2016年4月8日成立,建仓期6个月,从2016年4月8日起至2016年10月7日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:2016年按实际存续期间计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
注:本基金2016年4月8日(基金合同生效日)至2018年12月31日未进行利润分配。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月,加拿大蒙特利尔银行(BMO)参股富国基金管理有限公司,工商变更登记手续完毕,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中,第一家中外合资的基金管理公司。

目前,公司注册资本金2亿元人民币,股东为:海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司,并全资设有两家子公司——富国资产管理(上海)有限公司和富国资产管理(香港)有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、ODI、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金全部业务牌照。

截至2018年12月31日,本基金管理人管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指分级开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、富国中证10年期国债投资型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金(ODI)、富国鑫颐稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金(FOF)、富国富钱货货币市场基金。

4.1.2 基金基金经理(或基金经理小组)简介

注:1.上述任职日期为根据公司公告确定的聘任日期,离任日期为根据公司公告确定的解聘日期;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 管理人报告期内本基金运作遵守信守情况的说明
本报告期,富国基金管理有限公司作为富国价值优势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投资基金法》、《富国价值优势混合型证券投资基金合同》以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,为投资者谋求减少和分散风险、力求基金资产的本金并谋求基金资产长期稳定增值为目标,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和内部控制
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数据分析、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交易知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策机制。

事前控制主要包括:1.一级市场,通过标准作业的办流,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,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化控制。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(同一日、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资产行为进行分析评估,分析对基金资产、年、全、不同产品及不同一基金经理管理不同组合的交易行为,若

事中监控主要包括合同相同投资标的的交易方向、市场价格的同向控制,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同向交易为限制行为,非经特别控制流程审核确认,不得进行;对于不同同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化控制。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(同一日、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资产行为进行分析评估,分析对基金资产、年、全、不同产品及不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、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况
本报告期,在交易执行分析方面,公司采集连续四个季度,不同时间窗口(同一日、3日内、5日内)的同向交易样本,在假设同向交易价差为2%及0.6%的置信水平下,对同向交易价差进行分布检验并对检验结果进行跟踪分析,分析结果证明本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现异常交易行为。

4.3.4 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
2018年度,国内宏观经济处于稳增长阶段,货币政策维持稳健的态势,国内外经济贸易环境存在不确定性,都对国内经济和资本市场造成一定的影响。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截至2018年12月31日,本基金份额净值为1.031元;份额累计净值为1.031元;本报告期,本基金份额净值增长率为-2.73%,同期业绩比较基准收益率为-21.57%。

4.4.3 对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2019年,国内经济面临着机会和挑战,经济将出现结构性变化,有望继续朝着高质量发展方向前行。

4.4.4 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.5 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.6 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.7 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.8 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.9 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.10 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.11 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.12 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.13 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.14 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.15 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.16 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.17 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.18 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.19 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.20 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.21 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.22 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.23 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.24 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.25 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.26 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.27 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.28 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.29 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.30 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.31 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.32 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.33 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.34 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.35 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.36 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.37 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.38 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.39 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.40 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.41 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.42 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.43 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.44 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.45 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.46 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.47 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.48 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.49 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.50 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.51 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.52 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

4.4.53 报告期内基金投资组合配置情况
本基金通过自上而下对行业和具体投资标的进行定量和定性筛选,继续持有成长性价值优势的公司进行跟踪配置,尽量避免不确定性估值造成对基金收益的拖累,同时积极寻找具有长期增长潜力的标的。

陈戈 林志松 徐慧

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4.1 报表附注
7.4.1.1 会计政策
7.4.1.2 会计估计

7.4.2 会计差错更正的说明
7.4.3 关联方关系

7.4.4 关联方交易
7.4.4.1 股票交易

7.4.4.2 权证交易
7.4.4.3 债券交易

7.4.4.4 回购交易

7.4.4.5 支付关联方的佣金

7.4.4.6 关联方往来余额

7.4.4.7 关联方往来余额

7.4.4.8 关联方往来余额

7.4.4.9 关联方往来余额

7.4.4.10 关联方往来余额

7.4.4.11 关联方往来余额

7.4.4.12 关联方往来余额

7.4.4.13 关联方往来余额

7.4.4.14 关联方往来余额

7.4.4.15 关联方往来余额

7.4.4.16 关联方往来余额

7.4.4.17 关联方往来余额

7.4.4.18 关联方往来余额

7.4.4.19 关联方往来余额

7.4.4.20 关联方往来余额

7.4.4.21 关联方往来余额

7.4.4.22 关联方往来余额

7.4.4.23 关联方往来余额

7.4.4.24 关联方往来余额

7.4.4.25 关联方往来余额

7.4.4.26 关联方往来余额

7.4.4.27 关联方往来余额

7.4.4.28 关联方往来余额

7.4.4.29 关联方往来余额

7.4.4.30 关联方往来余额

7.4.4.31 关联方往来余额

7.4.4.32 关联方往来余额

7.4.4.33 关联方往来余额

7.4.4.34 关联方往来余额

7.4.4.35 关联方往来余额

7.4.4.36 关联方往来余额

7.4.4.37 关联方往来余额

7.4.4.38 关联方往来余额

7.4.4.39 关联方往来余额

7.4.4.40 关联方往来余额

7.4.4.41 关联方往来余额

7.4.4.42 关联方往来余额

7.4.4.43 关联方往来余额

7.4.4.44 关联方往来余额

7.4.4.45 关联方往来余额

7.4.4.46 关联方往来余额

7.4.4.47 关联方往来余额

7.4.4.48 关联方往来余额

7.4.4.49 关联方往来余额

7.4.4.50 关联方往来余额

7.4.4.51 关联方往来余额

7.4.4.52 关联方往来余额

7.4.4.53 关联方往来余额

7.4.4.54 关联方往来余额

7.4.4.55 关联方往来余额

Table with 5 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:“买入股票成本(成交)总额”和“卖出股票收入(成交)总额”按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.4 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

8.4.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

8.4.6 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

8.4.7 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

8.4.8 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

8.4.9 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

8.4.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.22 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.24 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.28 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资情况

8.4.30 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况

8.4.