

富国天合稳健优选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: 招商银行股份有限公司

1.1 重要提示
富国基金管理有限公司的董事会、监事会对本年度报告内容存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对报告期内发生的重大事件、重大事项的真实性、准确性、完整性及信息披露的真实性、准确性、完整性、及时性、公平性承担个别及连带法律责任。

2.1 基金基本情况
基金名称: 富国天合稳健优选混合型证券投资基金
基金代码: 000308
基金管理人: 富国基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
本基金主要采用“核心+卫星”投资策略,以追求长期稳健增值为目标,在严格控制风险的前提下,通过精选个股,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。

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
姓名: 郭建忠
姓名: 张明

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文的网址: www.fund008.com.cn
基金年度报告备置地点: 深圳市福田区富国大厦

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要指标
3.1.2 本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比较

3.1.1 本期主要指标
项目 2018年度 2017年度 2016年度
基金份额净值增长率 104.26% 104.21% 104.21%

3.1.2 本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比较
本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,1日收益率(benchmark)按下列公式计算:

benchmark = 80% * [沪深300指数 * (沪深300指数 - 1) * 1.15 + 15% * (中债综合全价指数 / (中债综合全价指数 - 1) - 1) * 5% + 同期存款利率 / 360]

3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数 * (沪深300指数 - 1) * 1.15 + 15% * (中债综合全价指数 / (中债综合全价指数 - 1) - 1) * 5% + 同期存款利率 / 360

3.3 过去三年基金的投资组合报告
3.3.1 资产配置情况
3.3.2 行业配置情况

3.3.3 重仓股票
3.3.4 基金管理人投资理念

3.3.5 基金管理人投资策略
3.3.6 基金管理人风险控制

3.3.7 基金管理人未来展望

3.3.8 基金管理人其他事项

3.3.9 基金管理人其他事项

3.3.10 基金管理人其他事项

3.3.11 基金管理人其他事项

3.3.12 基金管理人其他事项

3.3.13 基金管理人其他事项

3.3.14 基金管理人其他事项

3.3.15 基金管理人其他事项

3.3.16 基金管理人其他事项

3.3.17 基金管理人其他事项

3.3.18 基金管理人其他事项

3.3.19 基金管理人其他事项

事中监控主要包括合同相对交易标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。

事后评估及反馈主要包括合同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)的季度公允价值分析评估。

4.2 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.3 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.4 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.5 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.6 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.7 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.8 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.9 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.10 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.11 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.12 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.13 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.14 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.15 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.16 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.17 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.18 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.19 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.20 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.21 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.22 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.23 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.24 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.25 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.26 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.27 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.28 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.29 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

4.30 关联交易行为的说明
本报告期未发现关联交易行为。

报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告7至74财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 主管会计工作负责人: 会计机构负责人:
74 报表附注

74.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一会计年度报告保持一致。
74.2 会计差错更正的说明

74.3 关联方关系
74.3.1 关联方关系
74.3.2 关联交易

8.1 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

8.2 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

8.3 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.7 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

8.8 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

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

8.12 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明细

8.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细

8.14 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明细

8.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.16 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明细

8.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.18 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明细

8.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.20 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明细

8.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.22 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明细

8.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.24 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明细

8.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.26 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明细

8.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.28 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明细

8.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

8.30 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明细

8.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.2 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.3 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.4 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.5 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.6 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.7 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.8 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.9 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.10 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.11 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.12 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.13 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.14 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.15 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.16 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.17 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.18 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.19 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.20 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.21 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.22 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.23 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.24 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.25 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.26 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.27 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.28 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.29 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.30 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况

9.31 期末基金份额持有人的从业人数持有本基金的情况