

富国国家安全主题混合型证券投资基金

2019年第三季度报告

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
本报告期内未发生异常交易行为。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，因组合流动性管理或投资策略调整等原因，出现2次同日反向交易成交较少的单边交易量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
2019年二季度市场出现一定回调，一方面，3月份宏观经济数据改善明显，四月下旬市场产生资产收缩的预期；另一方面，中美贸易谈判没有如期达成协议，市场对美国可能对中国科技进行封锁和制造业出口施加关税产生新的担心，整体来看，二季度市场震荡回调，内需相关的食品饮料、医药和保险等板块成为资金的避风港，表现较好，指数受贸易摩擦影响的电子元器件、信息技术和制造业板块回调则比较多。本基金由于契约限制，在涉及国家安全相关的科技板块中挑选优质个股，净值出现一定回调。

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-4.60%，同期业绩比较基准收益率为-2.64%。

4.6 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	1,000,769,240.54	84.26
2	固定收益投资	1,000,769,240.54	84.26
3	金融衍生品投资	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	162,509,080.27	13.69
7	其他资产	34,497,750.11	2.91
8	合计	1,197,827,070.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	610,262,405.14	51.69
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	40,402,102.00	3.42
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	350,038,622.89	29.66
J	金融业	23,369,004.00	1.95
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	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106,000.00	1.93
S	综合	-	-
合计		1,000,769,240.54	84.26

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20
6	000051	格力电器	1,035,546	56,965,625.00	4.82
7	000848	宝信软件	1,960,000	58,536,000.00	4.90
8	000034	ST农化	1,594,500	48,568,470.00	4.11
9	000001	平安银行	2,470,179	46,402,179.20	3.94
10	000001	平安银行	46,364,800	4,364,800.00	0.36

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	100002	10国债02	200,000	19,982,000.00	1.62
2	100003	10国债03	200,000	19,982,000.00	1.62
3	100004	10国债04	200,000	19,982,000.00	1.62
4	100005	10国债05	200,000	19,982,000.00	1.62
5	100006	10国债06	200,000	19,982,000.00	1.62

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	100002	10国债02	200,000	19,982,000.00	1.62
2	100003	10国债03	200,000	19,982,000.00	1.62
3	100004	10国债04	200,000	19,982,000.00	1.62
4	100005	10国债05	200,000	19,982,000.00	1.62
5	100006	10国债06	200,000	19,982,000.00	1.62

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100002	10国债02	200,000	19,982,000.00	1.62
2	100003	10国债03	200,000	19,982,000.00	1.62
3	100004	10国债04	200,000	19,982,000.00	1.62
4	100005	10国债05	200,000	19,982,000.00	1.62
5	100006	10国债06	200,000	19,982,000.00	1.62

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	黄金现货	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	白银现货	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	铂金现货	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	钯金现货	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	铑金现货	3,596,469	62,076,482.20	5.20

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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

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五名股指期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1907	沪深300股指期货	10,351,912	912,000.00	0.07
2	IF1908	沪深300股指期货	10,351,912	912,000.00	0.07
3	IF1909	沪深300股指期货	10,351,912	912,000.00	0.07
4	IF1910	沪深300股指期货	10,351,912	912,000.00	0.07
5	IF1911	沪深300股指期货	10,351,912	912,000.00	0.07

5.10 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1907	5年期国债期货	200,000	19,982,000.00	1.62
2	TF1908	5年期国债期货	200,000	19,982,000.00	1.62
3	TF1909	5年期国债期货	200,000	19,982,000.00	1.62
4	TF1910	5年期国债期货	200,000	19,982,000.00	1.62
5	TF1911	5年期国债期货	200,000	19,982,000.00	1.62

5.11 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商品期货投资明细

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	CU1907	铜期货	200,000	19,982,000.00	1.62
2	CU1908	铜期货	200,000	19,982,000.00	1.62
3	CU1909	铜期货	200,000	19,982,000.00	1.62
4	CU1910	铜期货	200,000	19,982,000.00	1.62
5	CU1911	铜期货	200,000	19,982,000.00	1.62

5.12 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期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.13 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.14 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.15 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.16 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.17 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.18 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.19 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.20 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.21 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072	深圳国际	1,641,489	76,104,161.65	6.40
4	000018	深发展A	2,471,199	74,360,729.88	6.24
5	000130	新奥股份	3,596,469	62,076,482.20	5.20

5.22 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,207,314	99,769,067.64	7.99
2	000023	广发证券	6,494,428	92,091,130.94	7.99
3	000072</				