

富国转型机遇混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告截止日期: 2019年6月30日

重要提示
富国基金管理有限公司的董事会及监事会未发现报告期内存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金管理人中国建设银行股份有限公司出具的审计报告表示认可...

基金投资组合
基金代码: 0579
基金名称: 富国转型机遇混合型证券投资基金

投资目标
本基金采用主动投资管理策略,紧密跟踪中证转型机遇指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证转型机遇指数...

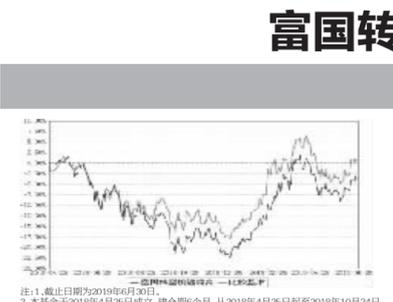
基金经理
姓名: 曹晖
职务: 基金经理
任职日期: 2018-04-25

主要财务指标
报告期: 2019年04月01日至2019年06月30日
1.本期已实现收益: 85,472,616.78

业绩比较基准
业绩比较基准: 中证转型机遇指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%

阶段 净值增长 净值增长率 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④
阶段 ① ② ③ ④

注: 1. 本基金采用量化投资策略,紧密跟踪中证转型机遇指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证转型机遇指数...



注: 1. 截止日期为2019年6月30日。
2. 本基金于2018年4月25日成立,建仓期为一个月,从2018年4月25日起至2018年10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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
曹晖,男,1980年7月20日出生,毕业于上海交通大学,2004年4月至2007年4月任富国基金管理有限公司研究员,2007年4月至2010年4月任富国基金管理有限公司基金经理,2010年4月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理,2012年4月至2015年4月任富国基金管理有限公司基金经理,2015年4月至2018年4月任富国基金管理有限公司基金经理,2018年4月至今任富国基金管理有限公司基金经理,具有基金从业资格。

4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析
二季度,市场呈现先抑后扬的走势,全季度沪深两市大幅下跌,市场情绪明显转弱,出现较大波动,总体表现为风险偏好下降,二季度本基金在把握市场结构性机会及降低仓位方面,较好地控制了回撤,但在交易中冲偏激,基金重仓配置了医药、地产、通信等行业。

4.3 其他报告
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,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、业绩评估及基金公允价值估值等环节,严格执行统一的授权审批制度和投资管理,在制度、操作层面确保所有投资组合享有公平的交易机会,并严格执行公平交易制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金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期间不存在同日反向交易的情况,报告期内各组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易且同日反向交易成交金额未达到成交金额5%的情况。

投资组合报告
基金资产净值: 113,072,841.27
权益投资: 113,072,841.27

报告期末基金资产组合情况
1. 权益投资: 113,072,841.27
2. 固定收益投资: 17,885,427.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
1. 医药生物: 11,005.4
2. 信息技术: 37,490

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
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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债券投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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权证投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告截止日期: 2019年6月30日

重要提示
富国基金管理有限公司的董事会及监事会未发现报告期内存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金管理人中国建设银行股份有限公司出具的审计报告表示认可...

基金投资组合
基金代码: 160427
基金名称: 富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金

投资目标
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证全指证券公司指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证全指证券公司指数...

基金经理
姓名: 曹晖
职务: 基金经理
任职日期: 2018-04-25

主要财务指标
报告期: 2019年04月01日至2019年06月30日
1.本期已实现收益: -6,555,476.18

业绩比较基准
业绩比较基准: 95%\*中证全指证券公司指数收益率+5%\*银行人民币活期存款利率

阶段 净值增长 净值增长率 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④
阶段 ① ② ③ ④

注: 1. 本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证全指证券公司指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证全指证券公司指数...

投资组合报告
基金资产净值: 1,818,002,456.69
权益投资: 1,818,002,456.69

报告期末基金资产组合情况
1. 权益投资: 1,818,002,456.69
2. 固定收益投资: 9,922,000.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
1. 医药生物: 363,431.25
2. 信息技术: 1,454,568.75

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
1. 600883 广药集团: 12,300,933
2. 600872 广生堂: 13,306,710

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债券投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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权证投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

富国中证体育产业指数分级证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告截止日期: 2019年6月30日

重要提示
富国基金管理有限公司的董事会及监事会未发现报告期内存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金管理人中国建设银行股份有限公司出具的审计报告表示认可...

基金投资组合
基金代码: 0579
基金名称: 富国中证体育产业指数分级证券投资基金

投资目标
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证体育产业指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证体育产业指数...

基金经理
姓名: 曹晖
职务: 基金经理
任职日期: 2018-04-25

主要财务指标
报告期: 2019年04月01日至2019年06月30日
1.本期已实现收益: -7,766,156.32

业绩比较基准
业绩比较基准: 95%\*中证体育产业指数收益率+5%\*银行人民币活期存款利率

阶段 净值增长 净值增长率 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④
阶段 ① ② ③ ④

注: 1. 本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证体育产业指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证体育产业指数...

投资组合报告
基金资产净值: 108,542,770.05
权益投资: 108,542,770.05

报告期末基金资产组合情况
1. 权益投资: 108,542,770.05
2. 固定收益投资: 1,210,000.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
1. 医药生物: 76,782.80
2. 信息技术: 31,757.25

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
1. 600883 广药集团: 12,300,933
2. 600872 广生堂: 13,306,710

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债券投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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权证投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

富国中证体育产业指数分级证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告截止日期: 2019年6月30日

重要提示
富国基金管理有限公司的董事会及监事会未发现报告期内存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金管理人中国建设银行股份有限公司出具的审计报告表示认可...

基金投资组合
基金代码: 0579
基金名称: 富国中证体育产业指数分级证券投资基金

投资目标
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证体育产业指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证体育产业指数...

基金经理
姓名: 曹晖
职务: 基金经理
任职日期: 2018-04-25

主要财务指标
报告期: 2019年04月01日至2019年06月30日
1.本期已实现收益: -7,766,156.32

业绩比较基准
业绩比较基准: 95%\*中证体育产业指数收益率+5%\*银行人民币活期存款利率

阶段 净值增长 净值增长率 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④
阶段 ① ② ③ ④

注: 1. 本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证体育产业指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证体育产业指数...

富国中证体育产业指数分级证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告截止日期: 2019年6月30日

重要提示
富国基金管理有限公司的董事会及监事会未发现报告期内存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金管理人中国建设银行股份有限公司出具的审计报告表示认可...

基金投资组合
基金代码: 0579
基金名称: 富国中证体育产业指数分级证券投资基金

投资目标
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证体育产业指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证体育产业指数...

基金经理
姓名: 曹晖
职务: 基金经理
任职日期: 2018-04-25

主要财务指标
报告期: 2019年04月01日至2019年06月30日
1.本期已实现收益: -7,766,156.32

业绩比较基准
业绩比较基准: 95%\*中证体育产业指数收益率+5%\*银行人民币活期存款利率

阶段 净值增长 净值增长率 业绩比较基准 收益差 ①-③ ②-④
阶段 ① ② ③ ④

注: 1. 本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证体育产业指数,在正常市场环境下,力争实现基金净值增长率超越中证体育产业指数...

投资组合报告
基金资产净值: 4,840,101.00
权益投资: 4,840,101.00

报告期末基金资产组合情况
1. 权益投资: 4,840,101.00
2. 固定收益投资: 1,210,000.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
1. 医药生物: 76,782.80
2. 信息技术: 31,757.25

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
1. 600883 广药集团: 12,300,933
2. 600872 广生堂: 13,306,710

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债券投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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权证投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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指期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490

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国债期货投资明细
1. 110054 通联软件: 115,000
2. 130117 19号矿机: 37,490