

信息披露

富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

平交制度的情况。

4.32 异常交易行为的专项说明
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间日反向交易的控制方面,报告期内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,出现次日内反向交易或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
2017年第四季度,党的十九大大胜利召开,提振市场信心。宏观经济稳中趋平,上游资源品和中游钢铁等板块盈利持续改善,大消费、清洁能源等板块的业绩快速增长;金融去杠杆等在第四季度继续推动利率继续上行,美联储也在四季度未继续加息,市场流动性仍较宽松。A股市场在四季度继续维持白马、大消费、保险、医药等业绩增长板块表现优异,本季度在第四季度继续聚焦业绩增长、估值相对合理的公司,收益比较尚可。

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4.39%,同期业绩比较基准收益率为-0.81%。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人或基金资产净值预警情形的说明
本基金本报告期无需要说明的相关情形。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,589,214,900.26	88.73
2	其中:股票	2,589,214,900.26	88.73
3	固定收益投资	9,222,133.20	0.31
4	其中:债券	9,222,133.20	0.31
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和到期兑付资产合计	371,268,229.24	12.44
11	其他资产	15,546,660.09	0.52
12	合计	2,989,251,063.59	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	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	医药、生物业	1,513,401,546.46	51.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.30
E	建筑业	87,184,103.23	2.97
F	批发和零售业	89,297,026.50	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	121,323,026.50	4.13
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	460,265,222.66	15.32
K	房地产业	39,202,054.23	1.33
L	租赁和商务服务业	285,029,765.88	9.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	3,508,246.04	0.12
合计		2,589,214,900.26	88.09

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	医药、生物业	-	-
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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、环境和公共设施服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		2,589,214,900.26	88.09

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

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

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	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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

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

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

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

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货持仓政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 申明基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外。报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.12 申明基金投资的前十名债券是否超出基金合同规定的备选债券库之外。报告期内本基金投资的前十名债券中没有在基金合同规定备选债券库之外的债券。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	111,589.08
2	应收证券清算款	26,372,700.12
3	应收股利	-
4	应收利息	690,493.97
5	应收申购款	1,628,670.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,701,443.20

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.15 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明

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	000027	分众传媒	20,438,911	285,029,765.88	9.70
2	000887	伊泰煤炭	8,545,729	276,730,816.51	9.38
3	000697	晋源开泰	6,435,743	260,011,472.88	8.89
4	300374	利和兴	10,482,410	196,754,638.31	6.89
5	002202	金钢科技	7,549,004	142,298,428.40	4.94
6	001233	顺妃股份	6,291,433	137,354,737.47	4.67
7	001039	建设银行	17,629,664	136,356,819.52	4.61
8	601336	新华保险	1,744,464	122,460,670.82	4.17
9	600029	南方航空	10,173,261	121,272,303.32	4.13
10	001988	中国银行	27,718,000	110,048,400.00	3.74

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债券投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

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贵金属投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

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

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.19.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.20 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.20.1 本期国债期货持仓政策

5.20.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21 投资组合报告附注
5.21.1 申明基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.21.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外。报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.21.3 申明基金投资的前十名债券是否超出基金合同规定的备选债券库之外。报告期内本基金投资的前十名债券中没有在基金合同规定备选债券库之外的债券。

5.21.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	111,589.08
2	应收证券清算款	26,372,700.12
3	应收股利	-
4	应收利息	690,493.97
5	应收申购款	1,628,670.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,701,443.20

5.21.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.21.6 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明

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	000027	分众传媒	20,438,911	285,029,765.88	9.70
2	000887	伊泰煤炭	8,545,729	276,730,816.51	9.38
3	000697	晋源开泰	6,435,743	260,011,472.88	8.89
4	300374	利和兴	10,482,410	196,754,638.31	6.89
5	002202	金钢科技	7,549,004	142,298,428.40	4.94
6	001233	顺妃股份	6,291,433	137,354,737.47	4.67
7	001039	建设银行	17,629,664	136,356,819.52	4.61
8	601336	新华保险	1,744,464	122,460,670.82	4.17
9	600029	南方航空	10,173,261	121,272,303.32	4.13
10	001988	中国银行	27,718,000	110,048,400.00	3.74

5.21.7 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债券投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.8 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贵金属投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.9 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权证投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.21.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.21.11.1 本期国债期货持仓政策

5.21.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.12 投资组合报告附注
5.21.12.1 申明基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.21.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库之外。报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.21.12.3 申明基金投资的前十名债券是否超出基金合同规定的备选债券库之外。报告期内本基金投资的前十名债券中没有在基金合同规定备选债券库之外的债券。

5.21.12.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	111,589.08
2	应收证券清算款	26,372,700.12
3	应收股利	-
4	应收利息	690,493.97
5	应收申购款	1,628,670.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,701,443.20

5.21.12.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.21.12.6 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明

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	000027	分众传媒	20,438,911	285,029,765.88	9.70
2	000887	伊泰煤炭	8,545,729	276,730,816.51	9.38
3	000697	晋源开泰	6,435,743	260,011,472.88	8.89
4	300374	利和兴	10,482,410	196,754,638.31	6.89
5	002202	金钢科技	7,549,004	142,298,428.40	4.94
6	001233	顺妃股份	6,291,433	137,354,737.47	4.67
7	001039	建设银行	17,629,664	136,356,819.52	4.61
8	601336	新华保险	1,744,464	122,460,670.82	4.17
9	600029	南方航空	10,173,261	121,272,303.32	4.13
10	001988	中国银行	27,718,000	110,048,400.00	3.74

5.21.12.7 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债券投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.12.8 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贵金属投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.12.9 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权证投资

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.12.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.21.12.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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	170401	17国债01	200,000	19,996,000.00	0.68

5.21.12.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.21.12.11.1 本期国债期货持仓政策

5.21.12.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细