富国低碳环保混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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
报告送出日期：	2015年10月26日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国低碳环保混合
基金主代码	100056
交易代码	前端交易代码:100056 后端交易代码:000158
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年08月10日
报告期末基金份额总额（单位：份）	2.944.542.546.42
投资目标	本基金主要投资于从事或受益于低碳环保主题的上市公司，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年07月01日-2015年09月30日）
1.本期已实现收益	-356.581.872.73
2.本期利润	-1.126.170.831.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3964
4.期末基金资产净值	7.508.439.716.36
5.期末基金份额净值	2.550

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(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要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

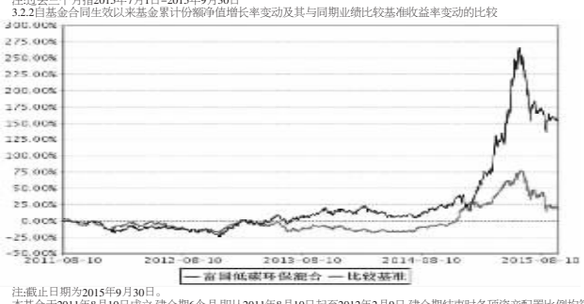
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.84%	1.93%	-22.67%	2.67%	6.83%	-0.74%

注:过去三个月指2015年7月1日-2015年9月30日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值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:截止日期为2015年9月30日。

本基金于2011年8月10日成立,建仓期6个月,即从2011年8月10日起至2012年2月9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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏伟	本基金基金经理兼任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理	2014-07-29	-	9年	硕士,曾任华富基金管理有限公司行业研究员;农银汇理基金管理有限公司研究员、高级研究员,基金经理助理。基金经理:2014年3月加入富国基金管理有限公司,2014年7月起任富国低碳环保混合型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司决定确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国低碳环保混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国低碳环保混合型证券投资基金基金合同》以及其它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,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

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研究分析、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信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括:1、一级市场,通过标准化的办公流程,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,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制,银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。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,以及不同时间窗口下(1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投资行为进行分析评估,分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同类组合(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释,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。

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未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析

2015年3季度以来,股票市场连续遭遇重挫,如期引发了一轮资产再配置行情。在经济基本面持续低迷、社会融资筑底的背景下,大量从打新基金退出的资金涌入债券市场先将中短端利率和信用利差打至年内新低,随后将利率品长端的收益率“买下来”近20-30bp,机构普遍采用加杠杆和短久期的组合操作,流动性推动下的牛市可见一斑。本基金在7月下旬遭遇打新回流资金大额申购,摊薄至3倍左右。考虑到机构客户占比极高,基金的负债端极其不稳定,一旦资金面收紧,流动性行情逆转,组合将面临巨大流动性压力,本基金始终保持谨慎,总体上采取短久期,低杠杆的策略进行运作;一方面,新增资金在以配置短融为主的基础上适当参与地产债一二级市场套利;另一方面,适度参与利率债波段交易。三季度单位净值保持了持续稳步上行的态势。组合总体攻守平衡,收益和风险匹配度较高。

展望四季度,当前仍然看不到对债券市场造成挤出的因素,预计至少在四季度前期,债券市场利率仍然平稳向下。但在基本面难以进一步大幅恶化本特别是通胀难以向下的情况下,利率期理下行空间亦有限,反而是一旦股票市场企稳,放开IPO将对本基金的资金面造成严重冲击,因此四季度期间,我们仍将继续维持谨慎及时调整仓位久期,随时应对债券资产可能遭受的冲击。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金A/B级份额净值增长率为1.45%,C级份额净值增长率为1.35%;A/B级同期业绩比较基准收益率为2.10%,C级同期业绩比较基准收益率为2.10%。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	4.518.258.137.94	59.70
	其中:股票	4.518.258.137.94	59.70
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3.028.874.287.78	40.02
7	其他资产	21.286.773.29	0.28
8	合计	7.568.419.199.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	19.400.00	0.00
B	采矿业	1.630.00	0.00
C	制造业	389.548.599.21	5.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2.221.00	0.00
E	建筑业	9.715.25	0.00
F	批发和零售业	8.228.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13.464.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	212.257.68	0.00
J	金融业	3.574.818.623.91	47.61
K	房地产业	553.572.216.49	7.37
L	租赁和商务服务业	17.271.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	10.662.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	4.369.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2.762.00	0.00
Q	卫生和社会工作	10.164.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	6.554.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	4.518.258.137.94	60.18

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	600000	浦发银行	34.371.451	571.597.230.13	7.61
2	601166	兴业银行	32.840.448	478.156.922.88	6.37
3	000002	万科A	35.901.713	457.028.806.49	6.09
4	601288	农业银行	146.239.925	443.106.972.75	5.90
5	601398	工商银行	101.271.818	437.494.253.76	5.83
6	601939	建设银行	82.681.982	428.292.666.76	5.70
7	601169	北京银行	46.325.992	398.866.791.12	5.31
8	600016	民生银行	31.392.283	265.264.791.35	3.53
9	600519	贵州茅台	1.300.040	247.410.612.40	3.30
10	601988	中国银行	65.180.970	242.473.208.40	3.23

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

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

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

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本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1申明本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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6.131.420.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	610.231.70
5	应收申购款	14.545.121.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21.286.773.29

5.11.4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处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1.473.624.696.07
报告期期间基金总申购份额	4.041.012.499.56
减:报告期期间基金总赎回份额	2.570.094.649.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2.944.542.546.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据自2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,基金管理人决定自2015年7月30日起将本基金更名为富国低碳环保混合型证券投资基金(简称变更为富国低碳环保混合),基金类别变更为混合型基金,并相应修改本基金的风险收益特征及部分基金合同部分条款。本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形,无需召开基金份额持有人大会。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国低碳环保混合型证券投资基金的文件

2、富国低碳环保混合型证券投资基金基金合同

3、富国低碳环保混合型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国低碳环保混合型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2015年10月26日

富国纯债债券型发起式证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：	2015年10月26日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国纯债债券发起		
基金主代码	100066		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年11月22日		
报告期末基金份额总额	463.991.477.38		
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。		
投资策略	基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。		
业绩比较基准	中债综合指数		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国纯债债券发起A/B		富国纯债债券发起C
下属分级基金的交易代码	前端	后端	100068
	100066	100067	
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	138.923.116.27		325.068.361.11

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	A/B级 报告期（2015年07月01日-2015年09月30日）	C级 报告期（2015年07月01日-2015年09月30日）
1.本期已实现收益	1.556.291.67	2.831.591.50
2.本期利润	1.934.837.56	3.506.530.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0150	0.0100
4.期末基金资产净值	145.771.777.95	339.823.123.89
5.期末基金份额净值	1.049	1.045

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(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要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告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

(1)A/B级

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.45%	0.07%	2.10%	0.06%	-0.65%	0.01%

(2)C级

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.35%	0.08%	2.10%	0.06%	-0.75%	0.02%

注:过去三个月指2015年7月1日-2015年9月30日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1)自基金合同生效以来富国纯债债券发起A/B基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2)自基金合同生效以来富国纯债债券发起C基金累计净值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:截止日期为2015年9月30日,本基金于2012年11月22日成立。本基金建仓期6个月,即从2012年11月22日至2013年5月21日止,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱锐	本基金基金经理兼任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益四年期纯债债券型证券投资基金基金经理	2014-11-17	-	4年	硕士,曾就职于中国农业银行总行资产管理部;2014年9月加入富国基金管理有限公司,2014年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,2014年12月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格
钟智伦	本基金基金经理兼固定收益投资部总经理,富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-03-13	-	21年	硕士,自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司证量研究员;2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金《QF基金经理助理,2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金《QF》基金经理,2015年5月起任富国固定收益投资部总经理;兼任量化投资监监理。具有基金从业资格。
方昊	本基金基金经理兼任量化投资监监助理、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金《QF》基金经理助理、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金基金经理	2015-05-13	-	6年	硕士,自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司证量研究员;2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金《QF基金经理助理,2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金《QF》基金经理,2015年5月起任富国固定收益投资部分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金的基金经理;兼任量化投资监助理。具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司决定确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国纯债债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它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,以尽可能减少和分散投资风险、确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

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研究分析、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信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括:1、一级市场,通过标准化的办公流程,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,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制,银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。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,以及不同时间窗口下(1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投资行为进行分析评估,分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同类组合(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释,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。

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同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未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

自6月中旬以来,随着市场资金去杠杆,同时伴随着人民币贬值等事件的出现,三季度A股出现一轮大幅调整行情。在此期间,以证金公司为代表的国家队积极救市,在一定程度上缓解了场外配资强平带来的流动性风险。从6月中旬的高点到8月下旬的低点,上证综指、创业板指数等代表性指数跌幅分别超过40%、50%。进入9月,随着两融余额的快速下降和场外配资的清理进入尾声,同时从央行近期动作看,人民币继续贬值的风险大幅下降,市场经过充分调整之后迎来一些积极变化。从估值看,部分价值股估值已进入合理区间,部分高股息资产和银行股有了估值吸引力。虽然当前位置并非绝对底部,但风险已基本可控,有可操作性。当然,市场也很难再次出现类似上半年的快速上涨,经过此轮调整后,市场的资金供需、市场信心、估值体系、结构主线都需要寻找新的平衡和方向。总体来看,创业板指数三季度下跌27.14%。

在投资管理上,本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略,采用量化和人工管理相结合的方法,处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。本基金在报告期内遇到多次大额申购赎回,同时受上市公司大面积停牌的影响,明显增加了本基金的交易成本。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-29.03%,同期业绩比较基准收益率为-25.78%。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	6.815.584.686.53	86.13
	其中:股票	6.815.584.686.53	86.13
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1.078.823.699.36	13.63
7	其他资产	18.527.970.38	0.23
8	合计	7.912.936.356.27	100.00

5.2 报告期末权益投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	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	191.406.939.76	2.54
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	16.323.352.50	0.22
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	95.792.004.39	1.27
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	27.30	-
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	303.522.323.95	4.03

5.3 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	48.123.409.14	0.64
C	制造业	2.722.980.296.44	36.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	109.100.844.84	1.45
F	批发和零售业	-	-
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	2.360.548.573.21	31.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	208.010.377.51	2.76
M	科学研究和技术服务业	79.117.245.10	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	182.574.174.95	2.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	224.711.983.28	2.98
R	文化、体育和娱乐业	576.895.458.11	7.66
S	综合	-	-
	合计	6.512.062.362.58	86.42

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股票投资明细

5.4.1报告期末指数投资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

代码	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	300059	东方财富	8.957.947	322.306.933.06	4.28
2	300104	乐视网	7.755.055	317.026.648.40	4.21
3	300027	华谊兄弟	7.718.586	244.216.061.04	3.24
4	300024	机器人	3.885.658	220.316.808.60	2.92
5	300017	网宿科技	3.694.370	194.730.242.70	2.58
6	300070	碧水源	4.178.855	182.574.174.95	2.42
7	300058	蓝色光标	11.416.763	163.259.710.90	2.17
8	300168	万达信息	5.326.803	162.201.151.35	2.15
9	300003	乐普医疗	3.596.063	115.038.055.37	1.53
10	300142	沃森生物	2.314.341	112.708.406.70	1.50

5.4.2报告期末积极投资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

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	300136	信维通信	2.812.325	78.098.265.25	1.04
2	300111	向日葵	7.850.651	41.215.917.75	0.55
3	300053	欧比特	1.316.300	39.225.740.00	0.52
4	300229	拓尔思	1.468.900	34.812.930.00	0.46
5	300152	科融环境	1.371.731	32.866.674.76	0.44

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注