富国美丽中国混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国银行股份有限公司
报告送出日期：	2019年07月18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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16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，保证复核内容不在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国美丽中国混合
基金主代码	002593
交易代码	002593
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年05月19日
报告期末基金份额总额（单位：份）	387,710,787.68
投资目标	本基金主要投资于美丽中国主题相关股票，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×60%+中债综合全价指数收益率×40%。
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	中国银行股份有限公司

§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（2019年04月01日－2019年06月30日）
1.本期已实现收益	22,794,635.96
2.本期利润	10,259,592.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0255
4.期末基金资产净值	524,995,920.69
5.期末基金份额净值	1.354

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。

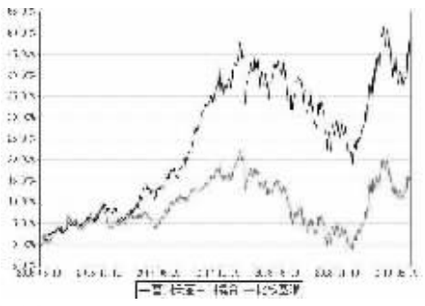
3.2基金净值表现

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	1.96%	1.38%	−0.65%	0.91%	2.61%	0.44%

注：过去三个月指2019年4月1日－2019年6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：1、截止日期为2019年6月30日。
2、本基金于2016年5月19日成立，建仓期6个月，从2016年5月19日起至2016年11月18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		
张晓伟	本基金基金经理	2016-05-19	—	10	硕士，自2009年7月至2010年4月在湘财证券任基础化工研究员；自2010年4月至2011年6月在招商证券任化工研究员；自2011年6月至2015年8月在富国基金管理有限公司任行业研究员；自2015年8月至2016年4月任富国改革动力混合型证券投资基金基金经理；自2015年11月起兼任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理。自2016年5月兼起任富国美丽中国混合型证券投资基金基金经理。自2019年6月起任富国睿祥回报混合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确定的解聘日期；自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美丽中国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》、《富国美丽中国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，以为投资者减少和分散风险、为保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，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、交易对手库及投权管理，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同时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均为限制行为，非经特别控制流程审核不得进行；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，在发现异常交易行为，风险管理部根据需要相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报银江监管机构。2.季度公平性交易分析报告按规定结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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1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5%的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年2季度，市场在完成了经济活过度悲观、信用收缩以及中美贸易争端的预期修正后，贸易摩擦的反复性和经济基本面的下行预期再次成为股票定价的核心矛盾，二季度主要市场指数录得不等的下跌幅度。在内外部仍存诸多风险因素的大环境下，二季度食品饮料板块一枝独秀，大幅跑赢其他行业。本基金2季度仓位变化不大，风格适度均衡，行业大趋势向好，估值相对合理且成长能力持久的个股是本基金选择投资的主要标准，同时根据把握阶段性投资机会。

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1.96%，同期业绩比较基准收益率为−0.65%

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	427,023,520.22	80.66
	其中：股票	427,023,520.22	80.66
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	101,788,983.63	19.23
7	其他资产	569,821.59	0.11
8	合计	529,382,325.44	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）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	321,498.65	0.06
C	制造业	331,919,144.83	63.22
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	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,298,507.66	3.48
J	金融业	67,431,381.48	12.84
K	房地产业	3,701,483.00	0.71
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	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	5,361,504.60	1.02
S	综合	—	—
	合计	427,023,520.22	81.34

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	300285	国瓷材料	2,241,732	38,131,861.32	7.26
2	600887	伊利股份	820,130	27,400,543.30	5.22
3	600309	万华化学	638,620	27,326,549.80	5.21
4	300760	迈瑞医疗	164,700	26,879,040.00	5.12
5	002643	万润股份	2,579,371	26,051,647.10	4.96
6	000651	格力电器	469,000	25,795,000.00	4.91
7	601318	中国平安	253,334	22,463,647.74	4.28
8	603833	欧派家居	196,625	21,160,782.50	4.03
9	300014	亿纬锂能	583,486	17,772,983.56	3.39
10	000858	五粮液	141,919	16,739,346.05	3.19

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报告期末基金投资的股指期货持仓和揽品明细

公允价值变动总额合计（元）	—
股指期货投资本期收益（元）	—
股指期货投资本期公允价值变动（元）	—

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揽品明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

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。

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	270,822.53
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	22,185.50
5	应收申购款	276,813.56
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	569,821.59

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	433,369,141.14
报告期期间基金总申购份额	35,953,903.25
减：报告期期间基金总赎回份额	101,612,256.71
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期末基金份额总额	387,710,787.68

§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	9,318,732.53
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,318,732.53
报告期期末持有的本基金份额占基金份额比例（%）	2.40

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

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-05-15至2019-06-30	81,336,141.30	—	—	81,336,141.30	20.98%
产品持有人明细							
—							

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

§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美丽中国混合型证券投资基金的文件

2、富国美丽中国混合型证券投资基金基金合同

3、富国美丽中国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、富国美丽中国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
2019年07月18日

富国收益宝交易型货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国银行股份有限公司
报告送出日期：	2019年07月18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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16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，保证复核内容不在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国收益宝交易型货币
场内简称	富国货币
基金主代码	511900
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月24日
报告期末基金份额总额	24,261,456,604.61
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合平均剩余期限控制在120天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 在投资管理过程中，基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币H
下属分级基金场内简称	富国货币	富国货币	富国货币
下属分级基金的交易代码	001981	001982	511900
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	42,602,898.18	23,180,056,470.35	1,038,797,236.08

注：本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为“富国货币”，基金份额净值为100.00元。本表所列场内份额数据截止折算为1.00元；场外基金份额（A类基金份额）简称为“富国收益宝交易型货币A级”，基金份额净值为1.00元；场外基金份额（B类基金份额）简称为“富国收益宝交易型货币B级”，基金份额净值为1.00元。

§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级（2019年04月01日－2019年06月30日）	B级（2019年04月01日－2019年06月30日）	H级（2019年04月01日－2019年06月30日）
1.本期已实现收益	305,064.10	178,603,224.13	5,680,930.76
2.本期利润	305,064.10	178,603,224.13	5,680,930.76
3.期末基金资产净值	42,602,898.18	23,180,056,470.35	1,038,797,236.08

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1）A级

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5916%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	0.5025%	0.0007%

注：过去三个月指2019年4月1日－2019年6月30日。

（2）B级

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6516%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	0.5631%	0.0007%

注：过去三个月指2019年4月1日－2019年6月30日。

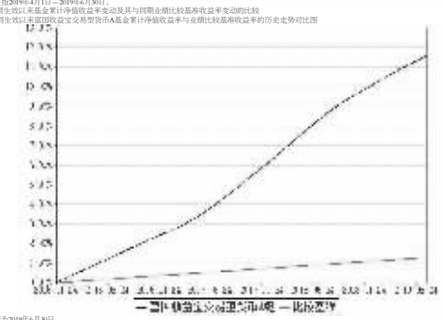
（3）H级

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5898%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	0.5013%	0.0007%

注：过去三个月指2019年4月1日－2019年6月30日。

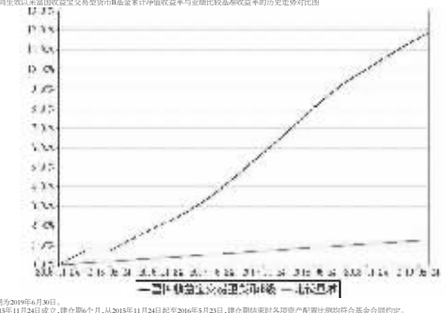
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（1）自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币A基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



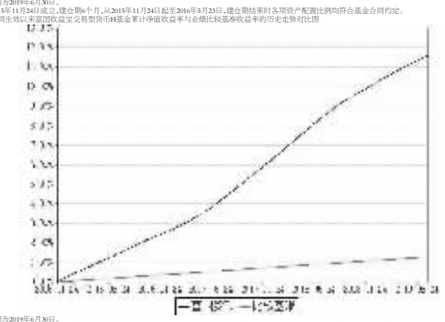
注：1、截止日期为2019年6月30日。
2、本基金于2015年11月24日成立，建仓期6个月，从2015年11月24日起至2016年5月23日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币B基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2019年6月30日。
2、本基金于2015年11月24日成立，建仓期6个月，从2015年11月24日起至2016年5月23日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（3）自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币H基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2019年6月30日。
2、本基金于2015年11月24日成立，建仓期6个月，从2015年11月24日起至2016年5月23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		
张波	本基金基金经理	2018-01-29	—	7	硕士，2012年7月至2013年9月任上海耀文资产管理中心（有限合伙）交易员；2013年9月至2017年10月任鑫元基金管理有限公司交易员，交易副总监（主持工作）；2017年10月加入富国基金管理有限公司，2018年1月起任富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理，2018年6月起任富国安益货币市场基金基金经理，2018年8月起任富国安益债券市场基金基金经理，2019年1月起任富国短债债券型证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
吴旅忠	本基金基金经理	2019-02-20	—	11	硕士，曾任国泰君安证券固定收益证券投资部投资经理；2018年03月至2018年10月任中国基金管理有限公司固定收益证券投资部基金经理；2018年10月加入富国基金管理有限公司，自2019年2月起任富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国安益货币市场基金基金经理，自2019年4月起任富国短债债券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

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国收益宝交易型货币市场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》、《富国收益宝交易型货币市场基金基金合同》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收益为目标，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、交易对手库及投权管理，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同日反向交易的控制、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均为限制行为，非经特别控制流程审核不得进行；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，在发现异常交易行为，风险管理部根据需要相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报银江监管机构。2.季度公平性交易分析报告按规定结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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1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5%的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，国内各项经济数据较一季度有所回落，货币政策边际收紧，股票市场监管加强，贸易摩擦出现新的变化，上述诸多因素导致股票市场较一季度高点出现了较大幅度的回落，随着6月底贸易摩擦的阶段性缓和，股票市场出现了反弹，整个二季度股票市场小幅下跌。由于监管层严查场外配资和上市公司一季报业绩的分化，股票市场从二季度开始出现了明显的分化，以消费为代表的核心资产呈著超越市场，并创出新高；而一季度领涨的一些小市值股票和成长股则受到查场外配资和贸易摩擦升温的影响呈著回调。

在二季度初，本基金延续了一季度的仓位和持仓结构，4月份开始，逐渐降低了股票仓位，由于持仓中电子和计算机的配置较高，前期受贸易摩擦影响较大，出于控制风险的目标逐步降低了此类配置，转走到内资持仓消费较多、在贸易摩擦升温的情况下，没有大幅超配消费股，在贸易摩擦缓和前维持了较低的股票仓位。六月底，随着贸易摩擦的缓和，逐渐增配了消费和金融行业，股票总体仓位回到较高水平。

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−2.25%，同期业绩比较基准收益率为−0.59%

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）	占基金资产净值比例（%）
1	固定收益投资	14,149,297,018.69	50.15
	其中：债券	14,029,297,018.69	49.73
	资产支持证券	120,000,000.00	0.43
2	买入返售金融资产	4,776,711,007.66	16.93
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	8,779,898,703.94	31.12
4	其他资产	505,420,692.16	1.79
5	合计	28,211,237,422.45	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	11.25
	其中：买断式回购融资	—
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,940,376,109.80 / 16.24
	其中：买断式回购融资	— / —

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3逆向回购在分项剩余期限

5.3.1报告期末逆向回购剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末按剩余期限计算的最长期限	80
报告期内按剩余期限计算的最高期限	85
报告期内按剩余期限计算的最低期限	49

报告期内按剩余期限计算的超过120天逆向回购的情况说明

注：本报告期内本基金不存在按剩余期限计算的超过120天的逆向回购。

5.3.2报告期末按剩余期限分类的逆向回购情况

序号	剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	25.75	16.24
	其中：剩余存续期超过30天的浮动利率债	—	—
2	30天（含）—60天	8.83	—
	其中：剩余存续期超过30天的浮动利率债	—	—
3	60天（含）—90天	55.43	—
	其中：剩余存续期超过30天的浮动利率债	—	—
4	90天（含）—120天	1.43	—
	其中：剩余存续期超过30天的浮动利率债	—	—
5	120天（含）—397天（含）	24.41	—
	其中：剩余存续期超过30天的浮动利率债	—	—
合计		115.85	16.24

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	329,739,714.97	1.36
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,030,609,751.97	4.25
	其中：政策性金融债	1,030,609,751.97	4.25
4	企业债券	160,842,735.96	0.66
5	企业短期融资券	2,130,036,404.86	8.78
6	中期票据	40,415,434.83	0.17
7	同业存单	10,337,652,976.10	42.61
8	其他	—	—
9	合计	14,029,297,018.69	57.83
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

5.6报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111915243	19民生银行CD243	10,000,000.00	993,953,328.28	4.10
2	111918188	19平安银行CD188	8,000,000.00	795,246,086.68	3.28
3	111909175	19浦发银行CD175	6,000,000.00	596,434,795.99	2.46
4	111910253	19兴业银行CD253	5,500,000.00	546,675,946.99	2.25
5	111920073	19广发银行CD073	5,000,000.00	496,907,084.60	2.05
6	111918199	19平安银行CD199	5,000,000.00	496,907,084.60	2.05
7	111915235	19民生银行CD235	5,000,000.00	496,905,952.82	2.05
8	111909095	19招商银行CD095	5,000,000.00	493,330,834.59	2.03
9	111906169	19交通银行CD169	5,000,000.00	493,246,146.77	2.03
10	111912227	19北京银行CD227	5,000,000.00	493,222,214.59	2.03

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0667%
报告期内偏离度的最低值	0.0039%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0280%

注：以上数据按工作日统计
报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
注：本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
注：本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	156794	信托01A2	500,000	50,000,000.00	0.21
2	159180	信托03A1	400,000	40,000,000.00	0.16
3	159312	信托03A1	300,000	30,000,000.00	0.12

5.9投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元，本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

5.9.2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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“19交通银行CD169”的发行主体交通银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在不按照规定履行客户身份识别义务，未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户等违法违规事实，中国人民银行于2018年7月26日作出对公司合计处以130万元罚款，对相关责任人员处以8万元罚款的行政处罚（银反洗罚决字［2018］15号）；由于存在聚瀚投资人、向投资人隐瞒与合同有关的重要情况等违法违规事实，中国人民银行于2018年10月18日对公司作出责令改正，并处30万元罚款的行政处罚（沪保监罚［2018］46号）；由于存在持续违规开展同