

# 富国优质发展混合型证券投资基金

二〇一九年年度报告

2019年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2020年03月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4	管理人报告.....	12
4.1	基金管理人及基金经理.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9	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.....	16
§5	托管人报告.....	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6	审计报告.....	17
6.1	审计报告基本信息.....	17
6.2	审计报告的基本内容.....	17
§7	年度财务报表.....	19
7.1	资产负债表.....	19
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	22
§8	投资组合报告.....	46
8.1	期末基金资产组合情况.....	47
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54

8.6	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 .....	55
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	55
8.8	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 .....	55
8.9	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 .....	55
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12	投资组合报告附注 .....	56
§9	基金份额持有人信息 .....	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	57
§10	开放式基金份额变动 .....	58
§11	重大事件揭示 .....	58
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	58
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4	基金投资策略的改变 .....	58
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8	其他重大事件 .....	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
12.1	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 .....	61
§13	备查文件目录 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国优质发展混合型证券投资基金	
基金简称	富国优质发展混合	
基金主代码	006527	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月25日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,313,743.97份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国优质发展混合A	富国优质发展混合C
下分级基金的交易代码	006527	006528
报告期末下属分级基金的份额总额	17,398,249.42份	3,915,494.55份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严控风险的基础上，通过积极、主动的管理，挖掘中国经济发展目标从追求GDP增速等定量目标转向追求经济增长内在质量等定性目标过程中的各类投资机遇，力争为基金份额持有人获得超越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	<p>沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%</p> <p>沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两市指数，该指数编制合理、透明，有一定的市场覆盖、抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。本基金的业绩比较基准能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者相关数据编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。</p>

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低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--------	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	罗菲菲
	联系电话	021-20361818	010-58560666
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95568
传真		021-20361616	010-58560798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	洪崎

注：公司已于2019年03月28日发布《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，裴长江先生自2019年03月27日起担任公司董事长。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国民生银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街2号

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### (1) 富国优质发展混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月25日 (基金合同生效日) 至2019年12月31日
本期已实现收益	4,528,629.85
本期利润	7,635,614.01
加权平均基金份额本期利润	0.1212
本期加权平均净值利润率	11.84%
本期基金份额净值增长率	27.83%
3.1.2 期末数据和指标	2019年12月31日
期末可供分配利润	2,687,422.74
期末可供分配基金份额利润	0.1545
期末基金资产净值	22,241,010.83
期末基金份额净值	1.2783
3.1.3 累计期末指标	2019年12月31日
基金份额累计净值增长率	27.83%

#### (2) 富国优质发展混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月25日 (基金合同生效日) 至2019年12月31日
本期已实现收益	741,902.74
本期利润	1,425,287.31
加权平均基金份额本期利润	0.1463
本期加权平均净值利润率	14.21%
本期基金份额净值增长率	26.94%
3.1.2 期末数据和指标	2019年12月31日
期末可供分配利润	572,748.30
期末可供分配基金份额利润	0.1463
期末基金资产净值	4,970,228.67
期末基金份额净值	1.2694
3.1.3 累计期末指标	2019年12月31日

基金份额累计净值增长率	26.94%
-------------	--------

注：本基金于2019年1月25日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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) 富国优质发展混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	17.09%	0.89%	4.67%	0.44%	12.42%	0.45%
过去六个月	24.77%	0.87%	4.75%	0.51%	20.02%	0.36%
自基金合同生效日起至今	27.83%	0.85%	17.77%	0.75%	10.06%	0.10%

##### (2) 富国优质发展混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	16.93%	0.89%	4.67%	0.44%	12.26%	0.45%
过去六个月	24.39%	0.87%	4.75%	0.51%	19.64%	0.36%
自基金合同生效日起至今	26.94%	0.85%	17.77%	0.75%	9.17%	0.10%

注：过去三个月指2019年4月1日—2019年6月30日。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%

沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两市指数，该指数编制合理、透明，有一定的市场覆盖、抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。本基金的业绩比较基准能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 60\% * [\text{沪深300指数收益率 t} / (\text{沪深300指数收益率 t-1} - 1)] + 40\%$$

\*  $[(1 + \text{中债综合全价指数收益率}_t) / (1 + \text{中债综合全价指数收益率}_{t-1}) - 1]$ ;  
 其中,  $t=1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  表示时间截至日;  
 期间  $T$  日收益率 (benchmark $T$ ) 按下列公式计算:  
 $\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$   
 其中,  $T=2, 3, 4, \dots$ ;  $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

(1) 自基金合同生效以来富国优质发展混合 A 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：1、截止日期为 2019 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2019 年 1 月 25 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2019 年 1 月 25 日起至 2019 年 7 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。

(2) 自基金合同生效以来富国优质发展混合 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

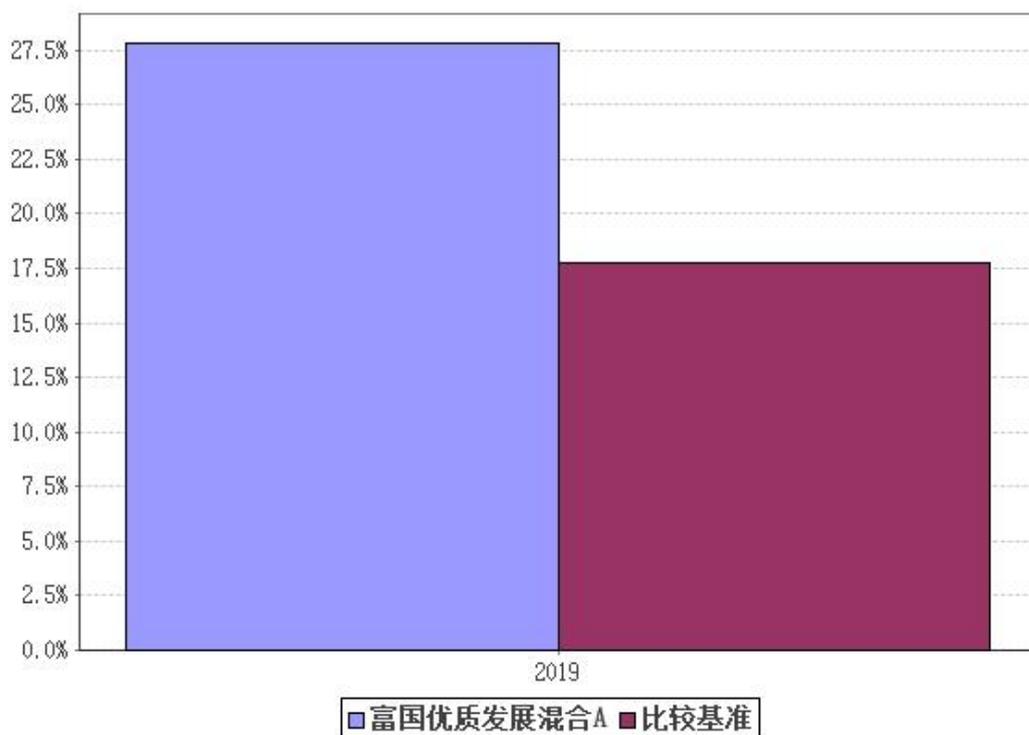


注：1、截止日期为2019年12月31日。

2、本基金于2019年1月25日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2019年1月25日起至2019年7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。

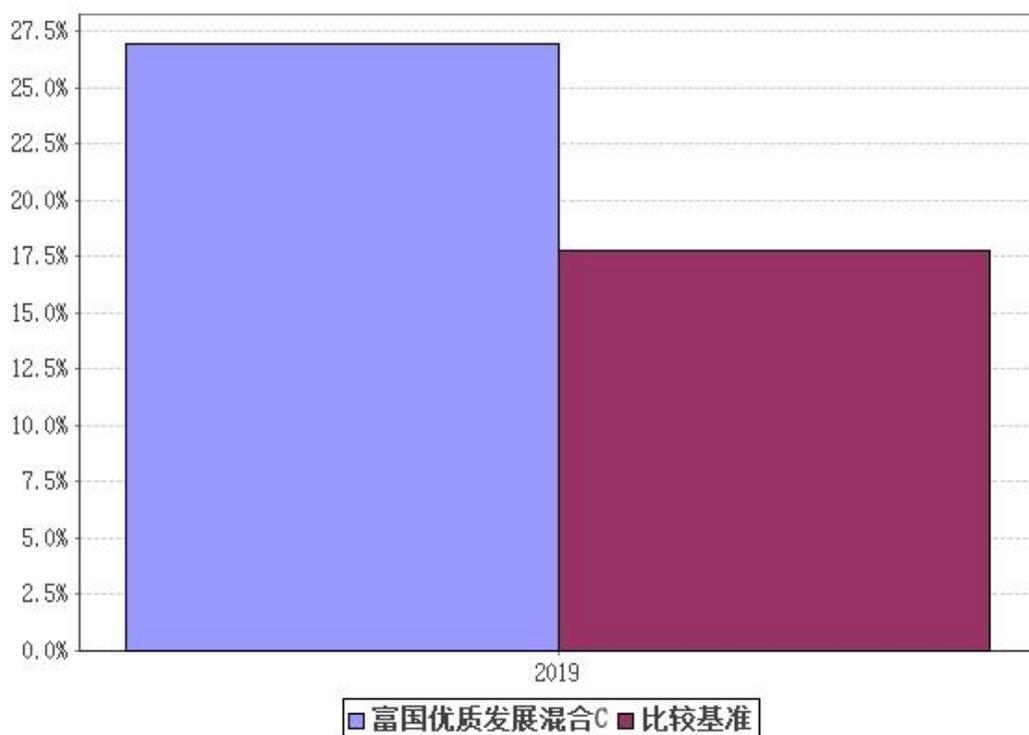
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国优质发展混合 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2019 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国优质发展混合 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2019 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国优质发展混合 A

注：本基金 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日未进行

利润分配

(2) 富国优质发展混合 C

注：本基金 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等一百四十七只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 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		
曹文俊	本基金基金经理	2019-01-25	—	14	硕士，2005 年 6 月至 2007 年 8 月任申银万国证券研究所助理分析师，2007 年 9 月至 2010 年 6 月任原申万巴黎基金管理有限公司研究员，2010 年 6 月至 2017 年 6 月任交银施罗德基金管理有限公司行业分析师、基金经理助理、基

					金经理；2017年6月加入富国基金管理有限公司，2018年4月起任富国转型机遇混合型证券投资基金基金经理，2019年1月起任富国优质发展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；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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国优质发展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》、《富国优质发展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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，风险管理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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。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。

#### 4.3.3 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3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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年，市场呈现单边上涨格局，全年沪深300指数上涨36.07%。2019年经济增速仍处于逐步探底过程中，尽管有增值税降税的对冲，企业盈利增长依然处于下行趋势；然而，市场流动性较之2018年有显著好转，M2和社融增速均呈现企稳回升。由于该种宏观格局，为数不多的景气度高的细分行业受到市场青睐，估值水平提升明显，板块表现突出。本基金于2019年1月底成立，成立初期以绝对收益策略稳步建仓，错失了一季度市场快速上涨的机会，下半年通过医药行业的配置以及周期板块的切换获得较好超额收益，二季度之后跑赢了指数与同业中位数。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年12月31日，本基金份额净值A级为1.2783元，C级为1.2694元；份额累计净值A级为1.2783元，C级为1.2694元；本报告期，本基金份额净值增长率A级为27.83%，C级为26.94%，同期业绩比较基准收益率A级为17.77%，C级为17.77%

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2020年，我们依然对未来指数表现表示乐观，尤其2020年上半年的确定性较强，有望获得较好的投资回报。从宏观主要矛盾切换的线索来看，2020年上半年我们将迎来难得的“内外双松”的格局，将是权益投资最美好的时光。对内的放松，将从2018年的流动性环境缓解进一步演化为财政刺激总需求；而对外的放松，则主要以中美贸易谈判达成第一阶段协议为标志。考虑本轮库存周期中，大多数周期性行业资本扩张较少（主要受制于信贷政策和环保政策），尽管经历了两年去库存周期，实际产能利用率并不低。后续财政刺激政策和补库存需求，行业有望迎来景气上行拐点。从估值角度，多数行业PE、TTM和PB估值位于2010年以来的后1/3低位水平，估值保护充足，大多数周期性的估值水平在历史极值附近。一旦该些领域出现景气上行趋势，极有可能带来戴维斯双击的良好投资机会。行业配置上，我们倾向于配置行业景气底部拐点上行的领域，我们相对看好医药、地产、维生素、激光设备、面板、页岩气/油服、有色等行业，

主题领域我们重点关注信创领域。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终将加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2019 年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

（一）持续推动公司制度建设，优化内部控制体系

制度建设是内部控制的起点，2019 年公司在统筹兼顾监管法规重大调整、公司管理实际需要、公司业务创新发展的基础上，持续督导业务部门开展制度建设。

（二）夯实合规管理架构，强化合规管理职能

2019 年公司通过落实合规考核机制、专兼职人员会议机制、持续推进合规风控工作的系统化建设等，引导全员主动合规、立足本岗位持续夯实各业务、各环节的内部控制。

（三）深入解读新规，持续推进新规落地

2019 年度，公司从新规解读、制度建立、系统更新、流程改造等方面持续推进各项重要法规、通知的落地工作，公司将根据持续颁布的新法规不断强化学习与执行力度。

（四）加强合规培训，全面提升合规意识

2019 年公司持续开展全员轮训、新员工合规培训、资管新规及专户新规培训、内幕交易及利用未公开信息交易防控培训、销售业务合规培训、廉洁从业培训、债券交易业务合规培训、ETF 换购业务注意事项培训、组合起始运作前合规培训、九民纪要后的司法动态和销售合规启示培训、MOM 产品指引培训等多种类、多维度的合规培训，在整个公司营造合规文化氛围、提高员工合规意识。

（五）深入专项审计，抓紧第三道防线

2019 年公司在常规季度监察稽核工作外，有针对性地开展专项审计。审计范围覆盖投资研究、市场销售、运营 IT 等前、中、后台业务。在力争专项审计检查全覆盖基础上，将公司主业和监管关注作为专项审计重点。通过专项审计，有效发现现有业务流程中存在的问题缺陷；通过事后改进工作，查漏补缺，持续提高内部控制的有效性和内部风险防控能力。

（六）立足投资合规监督，系统化助力风控履职

监督投资组合的合规运作是公司风险管理的基础核心工作，2019 年公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，初步建立重点账户的多重监控工具互相校验、互为备份的机制，通过内部工作程序与分工优化提升基础投资监督工作的质量，主动发现问题，消除风险隐患。

（七）持续强化反洗钱工作理念，以绩效为抓手切实推动反洗钱工作

为切实推动反洗钱工作，公司对过往反洗钱工作开展过程中存在的痛点问题追本溯源、深入剖析，致力于从源头上改变反洗钱仅是合规部门的事情、制度流于形式的局面，改变反洗钱工作遇事一事一议的做法，制定和采取了一系列措施推动公司反洗钱工作全面铺开。

（八）全面加强员工行为管理

公司建立通信管理机制，为规范公司员工执业行为，防范利益冲突和道德风险，对员工日常行为开展合规监测。2019 年通过新进员工承诺函签署及一对一宣讲、员工基本信息维护完整性检查、投资申报持仓清仓情况跟进、员工上传附

件与申报维护情况比对等工作，将日常管理与季度监督相结合，使申报管理工作常态化。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### **4.9 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**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自2019年6月12日至本报告期末（2019年12月31日），本基金存在资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，基金管理人已向中国证监会报告此情形并将采取适当措施。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 60467606_B124 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国优质发展混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国优质发展混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国优质发展混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国优质发展混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国优质发展混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	富国优质发展混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度

	<p>报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国优质发展混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国优质发展混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的</p>

	<p>基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国优质发展混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国优质发展混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	蒋燕华   费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2020 年 03 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国优质发展混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2019年12月31日)
<b>资 产:</b>	
银行存款	2,946,922.93
结算备付金	84,906.17
存出保证金	32,091.78
交易性金融资产	24,912,132.99
其中：股票投资	24,270,493.29
基金投资	—
债券投资	641,639.70
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	112,875.00
应收利息	1,078.21
应收股利	—
应收申购款	294,436.35
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	28,384,443.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2019年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	—
应付证券清算款	0.51
应付赎回款	986,929.84
应付管理人报酬	34,477.39
应付托管费	5,746.23
应付销售服务费	2,324.84
应付交易费用	48,446.52
应交税费	6.04
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	95,272.56
负债合计	1,173,203.93
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	21,313,743.97
未分配利润	5,897,495.53

所有者权益合计	27,211,239.50
负债和所有者权益总计	28,384,443.43

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2767 元，基金份额总额 21,313,743.97 份。其中：富国优质发展混合 A 份额净值 1.2783 元，份额总额 17,398,249.42 份；富国优质发展混合 C 份额净值 1.2694 元，份额总额 3,915,494.55 份。本基金合同生效日 2019 年 01 月 25 日。

## 7.2 利润表

会计主体：富国优质发展混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 25 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	11,061,646.13
1. 利息收入	1,263,739.94
其中：存款利息收入	151,517.12
债券利息收入	167,350.28
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	944,872.54
证券出借利息收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,732,056.62
其中：股票投资收益	4,351,162.60
基金投资收益	—
债券投资收益	-215,540.38
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具投资收益	—
股利收益	596,434.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,790,368.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,275,480.84
<b>减：二、费用</b>	2,000,744.81
1. 管理人报酬	1,091,240.05
2. 托管费	181,873.38
3. 销售服务费	56,980.10
4. 交易费用	572,869.73
5. 利息支出	—

其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 税金及附加	504.74
7. 其他费用	97,276.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>9,060,901.32</b>
减：所得税费用	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>9,060,901.32</b>

注：本基金合同生效日为2019年1月25日，无上年度同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国优质发展混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月25日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	351,455,627.02	—	351,455,627.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	9,060,901.32	9,060,901.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-330,141,883.05	-3,163,405.79	-333,305,288.84
其中：1. 基金申购款	7,466,897.14	611,370.89	8,078,268.03
2. 基金赎回款	-337,608,780.19	-3,774,776.68	-341,383,556.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	21,313,743.97	5,897,495.53	27,211,239.50

注：本基金合同生效日为2019年1月25日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

陈戈	林志松	徐慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

富国优质发展混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督

管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1484号《关于准予富国优质发展混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自2019年1月7日至2019年1月22日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60467606\_B02号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年1月25日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币351,389,445.17元，在募集期间产生的存款利息为人民币66,181.85元，以上实收基金（本息）合计为人民币351,455,627.02元，折合351,455,627.02份基金份额，其中A类基金份额325,191,680.59份，C类基金份额26,263,946.43份。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、权证等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例45%–90%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%–50%）；权证投资占基金资产净值的比例为0%–3%，每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2019年12

月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等。

(2) 金融负债分类本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取

定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### **7.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **7.4.4.13 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **7.4.6 税项**

#### **1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

## 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税

收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）
活期存款	2,946,922.93
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	2,946,922.93

注：本基金本报告期末未持有定期存款。本基金合同生效日为2019年01月25日。无上年度同期对比数据。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,579,809.85	24,270,493.29	3,690,683.44
贵金属投资-金交所	—	—	—

黄金合约				
债券	交易所市场	541,954.41	641,639.70	99,685.29
	银行间市场	—	—	—
	合计	541,954.41	641,639.70	99,685.29
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	21,121,764.26	24,912,132.99	3,790,368.73	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债，本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日。无上年度同期对比数据。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日。无上年度同期对比数据。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）
应收活期存款利息	627.90
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	42.02
应收债券利息	392.45
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	15.84
合计	1,078.21

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）
交易所市场应付交易费用	48,446.52
银行间市场应付交易费用	—
合计	48,446.52

#### 7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	2,772.56
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	62,500.00
预提审计费	30,000.00
合计	95,272.56

#### 7.4.7.9实收基金

富国优质发展混合 A:

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日	325,191,680.59	325,191,680.59
本期申购	5,347,072.59	5,347,072.59
本期赎回（以“-”号填列）	-313,140,503.76	-313,140,503.76
本期末	17,398,249.42	17,398,249.42

富国优质发展混合 C:

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日	26,263,946.43	26,263,946.43
本期申购	2,119,824.55	2,119,824.55
本期赎回（以“-”号填列）	-24,468,276.43	-24,468,276.43
本期末	3,915,494.55	3,915,494.55

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 351,389,445.17 元（其中 A 类 325,131,068.99 元，C 类 26,258,376.18 元），在募集期间产生的存款利息为人民币 66,181.85 元（其中 A 类 60,611.6 元，C 类 5,570.25 元），以上实收基金（本息）合计为人民币

351,455,627.02元,折合351,455,627.02份基金份额(其中A类325,191,680.59份基金份额,C类26,263,946.43份基金份额)。

#### 7.4.7.10 未分配利润

富国优质发展混合 A:

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日	—	—	—
本期利润	4,528,629.85	3,106,984.16	7,635,614.01
本期基金份额交易产生的变动数	-1,841,207.11	-951,645.49	-2,792,852.60
其中:基金申购款	263,049.50	171,126.99	434,176.49
基金赎回款	-2,104,256.61	-1,122,772.48	-3,227,029.09
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,687,422.74	2,155,338.67	4,842,761.41

富国优质发展混合 C:

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日	—	—	—
本期利润	741,902.74	683,384.57	1,425,287.31
本期基金份额交易产生的变动数	-169,154.44	-201,398.75	-370,553.19
其中:基金申购款	98,111.60	79,082.80	177,194.40
基金赎回款	-267,266.04	-280,481.55	-547,747.59
本期已分配利润	—	—	—
本期末	572,748.30	481,985.82	1,054,734.12

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	133,426.16
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	17,143.95
其他	947.01
合计	151,517.12

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	185,280,918.96
减：卖出股票成本总额	180,929,756.36
买卖股票差价收入	4,351,162.60

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	59,790,328.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	58,127,687.97
减：应收利息总额	1,878,180.48
买卖债券差价收入	-215,540.38

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	596,434.40
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	596,434.40

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 25 日(基 金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,790,368.73
股票投资	3,690,683.44
债券投资	99,685.29
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产 生的预估增值税	—
合计	3,790,368.73

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合 同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,268,812.97
转换费收入	6,667.87
合计	1,275,480.84

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基 金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	572,869.73

银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	572,869.73

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	62,500.00
证券出借违约金	—
银行费用	4,376.81
其他	400.00
合计	97,276.81

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2019年01月25日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为2019年01月25日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2019年01月25日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为2019年01月25日。无上年度同期对比数据。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,091,240.05
其中：支付销售机构的客户维护费	402,051.29

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为2019年01月25日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 25 日 (基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的 托管费	181,873.38

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 级	C 级	合计
富国基金管理有限公司	—	495.26	495.26
民生银行	—	5,248.87	5,248.87
申万宏源	—	13.32	13.32
合计	—	5,757.45	5,757.45

注：本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费。本基金 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注: 本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日, 无上年度末对比数据。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	2,946,922.93	133,426.16

注: 本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本报告期内本基金未在承销期内直接购入关联方承销证券。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联方交易事项。本基金合同生效日为 2019 年 01 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600966	博汇纸业	2019-12-30	重大事项停牌	5.31	2020-01-02	5.84	56,500	265,807.00	300,015.00	—

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。本基金合同生效日为2019年01月25日。无上年度同期对比数据。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2019年12月31日）
AAA	—
AAA 以下	641,639.70
未评级	—
合计	641,639.70

注：本基金合同生效日为2019年01月25日。无上年度同期对比数据。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

##### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同生效日为2019年01月25日。无上年度同期对比数据。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同生效日为2019年01月25日。无上年度同期对比数据。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2019年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,946,922.93	—	—	—	—	—	2,946,922.93
结算备付金	84,906.17	—	—	—	—	—	84,906.17
存出保证金	32,091.78	—	—	—	—	—	32,091.78
交易性金融资产	—	—	641,639.70	—	—	24,270,493.29	24,912,132.99
应收证券清算款	—	—	—	—	—	112,875.00	112,875.00
应收利息	—	—	—	—	—	1,078.21	1,078.21
应收申购款	—	—	—	—	—	294,436.35	294,436.35
资产总计	3,063,920.88	—	641,639.70	—	—	24,678,882.85	28,384,443.43
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	0.51	0.51
应付赎回款	—	—	—	—	—	986,929.84	986,929.84
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	34,477.39	34,477.39
应付托管费	—	—	—	—	—	5,746.23	5,746.23
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,324.84	2,324.84
应付交易费用	—	—	—	—	—	48,446.52	48,446.52
应付税费	—	—	—	—	—	6.04	6.04
其他负债	—	—	—	—	—	95,272.56	95,272.56
负债总计	—	—	—	—	—	1,173,203.93	1,173,203.93
利率敏感度缺口	3,063,920.88	—	641,639.70	—	—	23,505,678.92	27,211,239.50

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	542,100.00	—	—	542,100.00
资产合计	—	542,100.00	—	—	542,100.00
以外币计价的负债					
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	542,100.00	—	—	542,100.00

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2019年12月31日）
	港币相对人民币贬值 1%	-5,421.00
	港币相对人民币升值 1%	5,421.00

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、权证等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例 45%-90%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2019年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	24,270,493.29	89.19
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	641,639.70	2.36
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	24,912,132.99	91.55

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2019年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	226,348.87
	2. 业绩比较基准减少 1%	-226,348.87

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 24,612,117.99 元，属于第二层次的余额为人民币 300,015.00 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,270,493.29	85.51
	其中：股票	24,270,493.29	85.51
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	641,639.70	2.26
	其中：债券	641,639.70	2.26
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	3,031,829.10	10.68
8	其他各项资产	440,481.34	1.55
9	合计	28,384,443.43	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 542,100.00 元，占资产净值比例为 1.99%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,297,320.00	4.77
C	制造业	13,891,271.99	51.05
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	2,101,500.70	7.72
J	金融业	1,401,144.00	5.15
K	房地产业	3,182,306.00	11.69
L	租赁和商务服务业	572,220.00	2.10
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	260,575.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	1,022,055.60	3.76
S	综合	—	—
	合计	23,728,393.29	87.20

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	542,100.00	1.99
合计	542,100.00	1.99

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含沪港通投资的股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000961	中南建设	120,000	1,266,000.00	4.65
2	002180	纳思达	36,300	1,194,996.00	4.39
3	600529	山东药玻	40,000	1,105,600.00	4.06
4	002001	新和成	44,526	1,035,674.76	3.81
5	300413	芒果超媒	29,235	1,022,055.60	3.76
6	000002	万科A	28,500	917,130.00	3.37
7	002311	海大集团	24,800	892,800.00	3.28
8	601688	华泰证券	41,600	844,896.00	3.10
9	300470	中密控股	29,900	807,898.00	2.97
10	002643	万润股份	52,600	798,994.00	2.94
11	688188	柏楚电子	4,750	746,795.00	2.74
12	600383	金地集团	50,000	725,000.00	2.66
13	300271	华宇软件	27,300	693,420.00	2.55
14	000100	TCL 集团	154,700	691,509.00	2.54
15	002353	杰瑞股份	18,600	687,456.00	2.53
16	601808	中海油服	34,100	654,720.00	2.41
17	600216	浙江医药	48,900	652,815.00	2.40
18	603612	索通发展	52,371	648,876.69	2.38
19	601899	紫金矿业	140,000	642,600.00	2.36
20	000725	京东方A	139,100	631,514.00	2.32
21	300747	锐科激光	5,200	612,560.00	2.25
22	300662	科锐国际	18,000	572,220.00	2.10
23	601601	中国太保	14,700	556,248.00	2.04
24	000860	顺鑫农业	10,300	542,604.00	1.99
25	01918	融创中国	13,000	542,100.00	1.99
26	600690	海尔智家	26,400	514,800.00	1.89

27	002876	三利谱	10,000	488,000.00	1.79
28	603899	晨光文具	9,200	448,408.00	1.65
29	601636	旗滨集团	67,400	370,026.00	1.36
30	000661	长春高新	800	357,600.00	1.31
31	688111	金山办公	2,063	338,125.70	1.24
32	002555	三七互娱	12,000	323,160.00	1.19
33	600966	博汇纸业	56,500	300,015.00	1.10
34	000333	美的集团	5,000	291,250.00	1.07
35	601966	玲珑轮胎	12,300	282,039.00	1.04
36	000656	金科股份	35,700	274,176.00	1.01
37	002859	洁美科技	7,800	269,958.00	0.99
38	002044	美年健康	17,500	260,575.00	0.96
39	601968	宝钢包装	50,000	253,500.00	0.93
40	002972	科安达	618	12,378.54	0.05

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	7,524,049.80	27.65
2	601318	中国平安	7,042,747.00	25.88
3	002001	新和成	5,579,250.44	20.50
4	600216	浙江医药	5,132,450.70	18.86
5	603885	吉祥航空	5,014,440.00	18.43
6	600029	南方航空	5,007,533.00	18.40
7	600048	保利地产	4,802,557.00	17.65
8	000961	中南建设	4,682,536.00	17.21
9	300450	先导智能	4,392,404.31	16.14
10	000661	长春高新	4,331,387.00	15.92
11	002013	中航机电	4,128,599.63	15.17
12	600036	招商银行	3,726,718.00	13.70
13	300413	芒果超媒	3,690,403.00	13.56
14	600383	金地集团	3,633,664.00	13.35
15	000977	浪潮信息	3,607,462.00	13.26
16	600176	中国巨石	3,243,423.00	11.92
17	002572	索菲亚	3,119,710.00	11.46
18	600115	东方航空	3,005,971.00	11.05
19	01918	融创中国	2,959,597.65	10.88
20	000063	中兴通讯	2,896,859.80	10.65
21	601186	中国铁建	2,882,400.00	10.59
22	000651	格力电器	2,812,978.00	10.34

23	000858	五粮液	2,359,076.00	8.67
24	002372	伟星新材	2,265,367.80	8.33
25	002142	宁波银行	2,262,276.00	8.31
26	603833	欧派家居	2,234,000.00	8.21
27	300481	濮阳惠成	2,209,429.00	8.12
28	300122	智飞生物	2,150,642.63	7.90
29	600803	新奥股份	2,048,026.00	7.53
30	600529	山东药玻	2,020,633.00	7.43
31	601021	春秋航空	2,019,535.00	7.42
32	601111	中国国航	2,003,040.00	7.36
33	601398	工商银行	1,973,869.00	7.25
34	601012	隆基股份	1,863,485.00	6.85
35	603186	华正新材	1,835,769.00	6.75
36	300604	长川科技	1,779,189.60	6.54
37	600690	海尔智家	1,690,955.40	6.21
38	603899	晨光文具	1,651,985.00	6.07
39	600562	国睿科技	1,590,937.50	5.85
40	603323	苏农银行	1,551,858.00	5.70
41	300327	中颖电子	1,529,752.00	5.62
42	601288	农业银行	1,482,535.00	5.45
43	603018	中设集团	1,460,968.60	5.37
44	002555	三七互娱	1,457,927.00	5.36
45	000568	泸州老窖	1,438,201.00	5.29
46	601128	常熟银行	1,390,940.39	5.11
47	002439	启明星辰	1,364,757.00	5.02
48	000983	西山煤电	1,355,063.00	4.98
49	300130	新国都	1,351,493.00	4.97
50	300470	中密控股	1,306,618.00	4.80
51	002368	太极股份	1,247,400.00	4.58
52	002271	东方雨虹	1,187,001.00	4.36
53	300662	科锐国际	1,173,638.00	4.31
54	601966	玲珑轮胎	1,136,614.00	4.18
55	603444	吉比特	1,124,836.00	4.13
56	002180	纳思达	1,121,800.06	4.12
57	600760	中航沈飞	1,111,140.00	4.08
58	002044	美年健康	1,092,298.48	4.01
59	600037	歌华有线	1,064,862.00	3.91
60	601336	新华保险	1,049,683.00	3.86
61	600507	方大特钢	1,035,883.00	3.81
62	601058	赛轮轮胎	1,034,713.00	3.80
63	000429	粤高速 A	999,515.00	3.67

64	600674	川投能源	997,497.00	3.67
65	000783	长江证券	962,781.00	3.54
66	300037	新宙邦	960,298.00	3.53
67	603986	兆易创新	952,998.00	3.50
68	601555	东吴证券	949,658.00	3.49
69	000538	云南白药	944,214.40	3.47
70	600845	宝信软件	895,653.20	3.29
71	300015	爱尔眼科	880,860.00	3.24
72	300326	凯利泰	859,208.00	3.16
73	300036	超图软件	852,189.00	3.13
74	600132	重庆啤酒	838,458.00	3.08
75	002110	三钢闽光	789,030.00	2.90
76	600309	万华化学	788,164.00	2.90
77	002311	海大集团	781,915.00	2.87
78	601688	华泰证券	742,407.00	2.73
79	01177	中国生物制药	726,816.44	2.67
80	300463	迈克生物	718,247.00	2.64
81	600297	广汇汽车	701,800.00	2.58
82	688188	柏楚电子	690,304.45	2.54
83	002216	三全食品	677,604.00	2.49
84	01787	山东黄金	663,686.92	2.44
85	002643	万润股份	663,306.00	2.44
86	603160	汇顶科技	659,701.00	2.42
87	300271	华宇软件	657,275.10	2.42
88	000860	顺鑫农业	630,230.00	2.32
89	01347	华虹半导体	615,946.85	2.26
90	002003	伟星股份	608,998.40	2.24
91	000513	丽珠集团	604,624.00	2.22
92	600380	健康元	598,085.00	2.20
93	300788	中信出版	594,010.00	2.18
94	300188	美亚柏科	592,626.00	2.18
95	601100	恒立液压	590,939.00	2.17
96	300496	中科创达	587,068.00	2.16
97	300759	康龙化成	582,660.00	2.14
98	300078	思创医惠	575,928.63	2.12
99	002850	科达利	567,073.00	2.08
100	601601	中国太保	559,735.00	2.06
101	000333	美的集团	556,800.00	2.05
102	00762	中国联通	555,928.56	2.04
103	300529	健帆生物	554,629.00	2.04
104	00939	建设银行	549,215.72	2.02

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	7,145,596.69	26.26
2	000002	万科 A	6,567,774.98	24.14
3	600029	南方航空	5,199,308.64	19.11
4	603885	吉祥航空	5,077,690.83	18.66
5	002001	新和成	5,067,352.43	18.62
6	000661	长春高新	4,968,767.00	18.26
7	600048	保利地产	4,924,211.50	18.10
8	600216	浙江医药	4,907,838.83	18.04
9	300450	先导智能	4,159,013.20	15.28
10	002013	中航机电	4,007,307.36	14.73
11	600036	招商银行	3,752,125.28	13.79
12	000977	浪潮信息	3,626,403.95	13.33
13	000651	格力电器	3,392,449.90	12.47
14	000961	中南建设	3,306,762.70	12.15
15	600115	东方航空	3,185,596.50	11.71
16	000063	中兴通讯	3,167,036.00	11.64
17	600383	金地集团	3,099,010.06	11.39
18	600176	中国巨石	3,067,586.00	11.27
19	300413	芒果超媒	3,061,969.00	11.25
20	002572	索菲亚	3,049,105.56	11.21
21	601186	中国铁建	2,674,369.61	9.83
22	01918	融创中国	2,660,208.57	9.78
23	300481	濮阳惠成	2,435,404.00	8.95
24	300122	智飞生物	2,353,091.58	8.65
25	000858	五粮液	2,306,904.10	8.48
26	002372	伟星新材	2,268,524.63	8.34
27	603833	欧派家居	2,221,327.74	8.16
28	002142	宁波银行	2,109,718.00	7.75
29	601111	中国国航	2,089,276.86	7.68
30	601021	春秋航空	2,083,556.15	7.66
31	601398	工商银行	2,008,555.00	7.38
32	601012	隆基股份	1,870,531.10	6.87
33	603018	中设集团	1,764,419.58	6.48
34	600562	国睿科技	1,719,737.21	6.32
35	600803	新奥股份	1,717,438.00	6.31
36	300604	长川科技	1,712,244.34	6.29

37	603899	晨光文具	1,658,336.00	6.09
38	603186	华正新材	1,645,171.83	6.05
39	300327	中颖电子	1,560,898.60	5.74
40	600529	山东药玻	1,493,834.00	5.49
41	603323	苏农银行	1,492,799.00	5.49
42	002555	三七互娱	1,491,477.50	5.48
43	601288	农业银行	1,434,094.00	5.27
44	000568	泸州老窖	1,417,520.00	5.21
45	601058	赛轮轮胎	1,311,910.00	4.82
46	603444	吉比特	1,287,598.00	4.73
47	002271	东方雨虹	1,269,281.00	4.66
48	601128	常熟银行	1,267,028.00	4.66
49	002368	太极股份	1,253,130.00	4.61
50	300130	新国都	1,225,508.00	4.50
51	000983	西山煤电	1,220,209.00	4.48
52	002439	启明星辰	1,160,971.00	4.27
53	300037	新宙邦	1,081,316.00	3.97
54	600760	中航沈飞	1,059,466.00	3.89
55	600690	海尔智家	1,039,561.72	3.82
56	600507	方大特钢	1,021,337.00	3.75
57	601966	玲珑轮胎	1,010,749.00	3.71
58	600674	川投能源	996,981.00	3.66
59	603986	兆易创新	990,007.00	3.64
60	000538	云南白药	987,771.00	3.63
61	600037	歌华有线	975,840.00	3.59
62	601555	东吴证券	969,488.00	3.56
63	000783	长江证券	950,760.00	3.49
64	002044	美年健康	941,690.00	3.46
65	600845	宝信软件	930,114.00	3.42
66	000429	粤高速 A	923,358.00	3.39
67	300015	爱尔眼科	911,676.00	3.35
68	300036	超图软件	877,826.00	3.23
69	601336	新华保险	867,085.00	3.19
70	002110	三钢闽光	859,258.25	3.16
71	01787	山东黄金	842,294.75	3.10
72	603160	汇顶科技	822,478.00	3.02
73	600309	万华化学	815,051.00	3.00
74	300326	凯利泰	811,270.00	2.98
75	600132	重庆啤酒	748,072.00	2.75
76	300463	迈克生物	746,183.00	2.74
77	01177	中国生物制	737,463.96	2.71

		药		
78	600297	广汇汽车	708,180.00	2.60
79	601100	恒立液压	691,876.00	2.54
80	002216	三全食品	670,720.00	2.46
81	300014	亿纬锂能	648,810.00	2.38
82	300788	中信出版	640,107.52	2.35
83	300496	中科创达	639,215.00	2.35
84	300759	康龙化成	614,410.00	2.26
85	600380	健康元	608,337.00	2.24
86	01347	华虹半导体	601,435.83	2.21
87	002035	华帝股份	597,332.00	2.20
88	000513	丽珠集团	596,385.54	2.19
89	002003	伟星股份	591,227.00	2.17
90	300470	中密控股	558,050.00	2.05
91	300188	美亚柏科	552,241.71	2.03
92	00939	建设银行	549,169.42	2.02

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	201,509,566.21
卖出股票收入（成交）总额	185,280,918.96

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	641,639.70	2.36
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	641,639.70	2.36

## 8.6 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

金额单位：人民币元

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	113547	索发转债	5,190	641,639.70	2.36

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 8.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“万科A”的发行主体万科企业股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在违反外汇登记管理规定的违法事实，国家外汇管理局深圳市分局于2019年6月26日对公司作出罚款5万元的行政处罚（深外管检[2019]27号）。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

### 8.12.2 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。

本报告期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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,091.78
2	应收证券清算款	112,875.00
3	应收股利	—
4	应收利息	1,078.21
5	应收申购款	294,436.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	440,481.34

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国优质发展混合 A	1,960	8,876.66	—	—	17,398,249.42	100.00
富国优质发展混合 C	583	6,716.11	—	—	3,915,494.55	100.00
合计	2,543	8,381.34	—	—	21,313,743.97	100.00

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国优质发展混合 A	1,011,440.73	5.8135
	富国优质发展混合 C	10.00	0.0003
	合计	1,011,450.73	4.7455

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基 金	富国优质发展混合 A	0
	富国优质发展混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国优质发展混合 A	>100
	富国优质发展混合 C	0

	合计	>100
--	----	------

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国优质发展混合 A	富国优质发展混合 C
基金合同生效日(2019 年 01 月 25 日)基金份额总额	325, 191, 680. 59	26, 263, 946. 43
基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日起至报告期期末基金总申购份额	5, 347, 072. 59	2, 119, 824. 55
减：基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日起至报告期期末基金总赎回份额	313, 140, 503. 76	24, 468, 276. 43
基金合同生效日 2019 年 1 月 25 日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	17, 398, 249. 42	3, 915, 494. 55

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 2 月 23 日发布公告, 薛爱东先生自 2019 年 2 月 22 日起不再担任公司董事长, 由陈戈先生代行公司董事长职责。本基金管理人于 2019 年 3 月 28 日发布公告, 裴长江先生自 2019 年 3 月 27 日起担任公司董事长。本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 3 万元人民币, 其已提供审计服务的连续年限为 17 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	27,160,397.69	7.04	717,420.45	0.64	—	—	—	—	19,851.30	5.72	—
国泰君安	2	357,820,921.65	92.70	7,777,066.20	6.98	110,400,000.00	6.48	—	—	326,081.94	94.01	—
天风证券	2	—	—	102,979,378.09	92.38	1,383,000,000.00	81.23	—	—	—	—	—
兴业证券	2	1,011,204.00	0.26	—	—	209,100,000.00	12.28	—	—	921.53	0.27	—
招商证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本基金合同生效日为2019年1月25日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国优质发展混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报	2019年01月26日
2	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报	2019年02月23日
3	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报	2019年03月28日
4	富国优质发展混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上海证券报	2019年02月26日
5	富国优质发展混合型证券投资基金关于2019年非港股通交易日暂停申购、赎回和转换等业务的公告	上海证券报	2019年03月30日
6	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金2019年劳动节期间暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年04月24日
7	富国基金管理有限公司关于不法分子冒用我司名义的澄清公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年06月19日
8	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年06月21日
9	富国基金管理有限公司旗下基金2019年6月30日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年07月01日
10	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年08月01日

11	关于防范不法分子冒用富国基金名义进行非法活动的重要提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年12月13日
12	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金2019年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年12月24日
13	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金2020年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年12月24日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

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。

## § 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国优质发展混合型证券投资基金的文件 2、富国优质发展混合型证券投资基金基金合同 3、富国优质发展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、富国优质发展混合财务报表及报表附注 6、报告期内在公司网站上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。

