

富国新动力灵活配置混合型证券投资基金

二〇一八年年度报告

(摘要)

2018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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019年03月29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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国新动力灵活配置混合		
基金主代码	001508		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年08月04日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	217,678,445.93份		
基金合同存续期	不定期		
下属两级基金的基金简称	新动力灵活配置 A	新动力灵活配置 C	
下属两级基金的交易代码	前端	后端	001510
	001508	001509	
报告期末下属两级基金的份额总额	167,945,040.20份	49,733,405.73份	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	采取自上而下主动性管理策略，资产配置突出两个层面的平衡，一、资产配置的平衡，通过主动调整基金资产中股票和债券的投资比例，以求基金资产在股票市场和债券市场的投资中达到风险和收益的最佳平衡；二、持股结构的平衡，即通过调整股票资产中成长型股票和价值型股票的投资比例实现持股结构的平衡。在投资于良好成长性上市公司的同时，兼顾收益稳定的价值型上市公司。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款基准利率（税后）+3.00%
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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	田青
	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-66275853

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

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 8 号 上海国金中心二期 16-17 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

注：信息披露报纸为截止至本报告期末信息。

## § 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) 新动力灵活配置 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-14,417,764.40	43,792,090.42	-1,239,576.05
本期利润	-22,555,757.40	46,960,576.80	-11,200,282.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1936	0.1031	-0.1597
本期基金份额净值增长率	6.89%	8.73%	-17.92%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.3039	0.2196	0.0215
期末基金资产净值	218,983,466.45	21,205,512.22	529,190,996.15
期末基金份额净值	1.304	1.220	1.122

#### (2) 新动力灵活配置 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-5,211,203.46	2,732,696.37	-6,025,449.24
本期利润	-7,235,700.96	625,822.52	-11,326,195.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1736	0.0969	-0.4081
本期基金份额净值增长率	6.53%	8.33%	-18.41%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.2891	0.2098	0.0171
期末基金资产净值	64,109,999.24	5,862,253.90	11,534,774.53
期末基金份额净值	1.289	1.210	1.117

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 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) 新动力灵活配置 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	-9.13%	0.92%	1.13%	0.01%	-10.26%	0.91%
过去六个月	-13.70%	1.17%	2.27%	0.01%	-15.97%	1.16%
过去一年	6.89%	1.23%	4.50%	0.01%	2.39%	1.22%
过去三年	-4.61%	1.34%	13.51%	0.01%	-18.12%	1.33%
自基金合同生效日起至今	30.40%	1.37%	15.43%	0.01%	14.97%	1.36%

#### (2) 新动力灵活配置 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	-9.23%	0.91%	1.13%	0.01%	-10.36%	0.90%
过去六个月	-13.89%	1.16%	2.27%	0.01%	-16.16%	1.15%
过去一年	6.53%	1.23%	4.50%	0.01%	2.03%	1.22%
过去三年	-5.84%	1.34%	13.51%	0.01%	-19.35%	1.33%
自基金合同生效日起至今	28.90%	1.37%	15.43%	0.01%	13.47%	1.36%

注：本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的一年期人民币定期存款基准利率（税后）+3%。

本基金的投资目标旨在为持有人提供高于定期存款的稳定增值回报，从过往历史数据看，“一年期人民币定期存款基准利率（税后）+3.00%”绝大部分时间都能战胜通货膨胀，市场上同类基金也多采用类似的业绩比较基准。综合本基金的投资目标和市场情况，本基金的业绩比较基准定为“一年期人民币定期存款基准利率（税后）+3.00%”。

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：

$$\text{benchmarkt} = \text{同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）} / 360 + 3\% / 360;$$

其中，t=1, 2, 3, …, T, T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）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新动力灵活配置 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 2018 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 8 月 4 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 8 月 4 日起至 2016 年 2 月 3 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新动力灵活配置 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

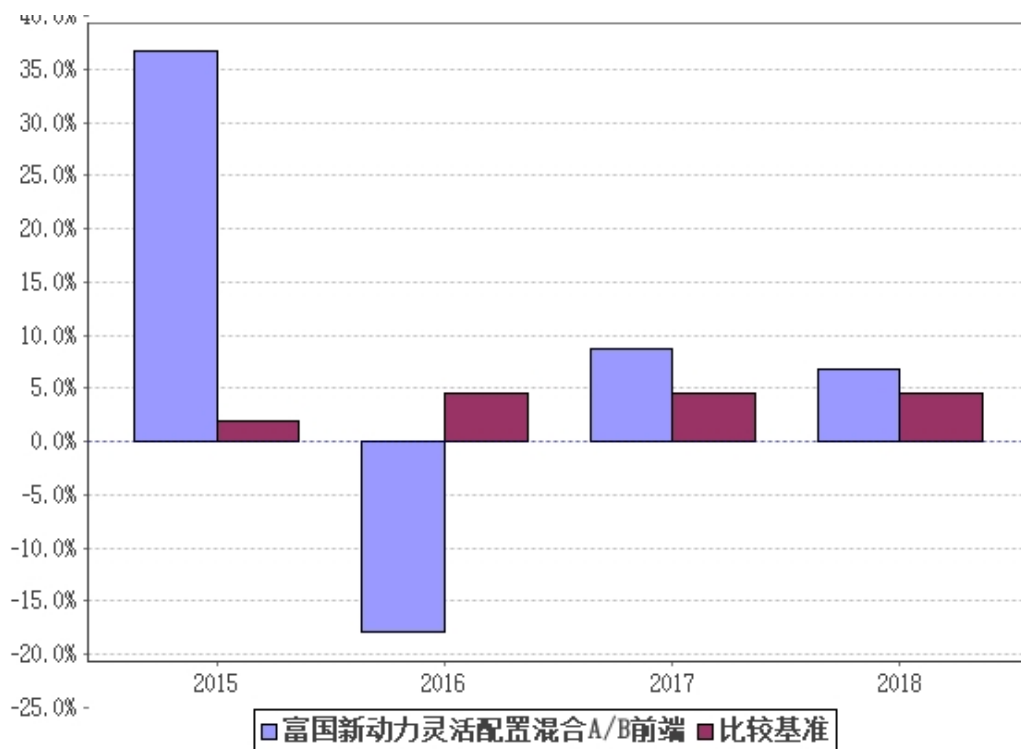


注：1、截止日期为2018年12月31日。

2、本基金于2015年8月4日成立，建仓期6个月，从2015年8月4日起至2016年2月3日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

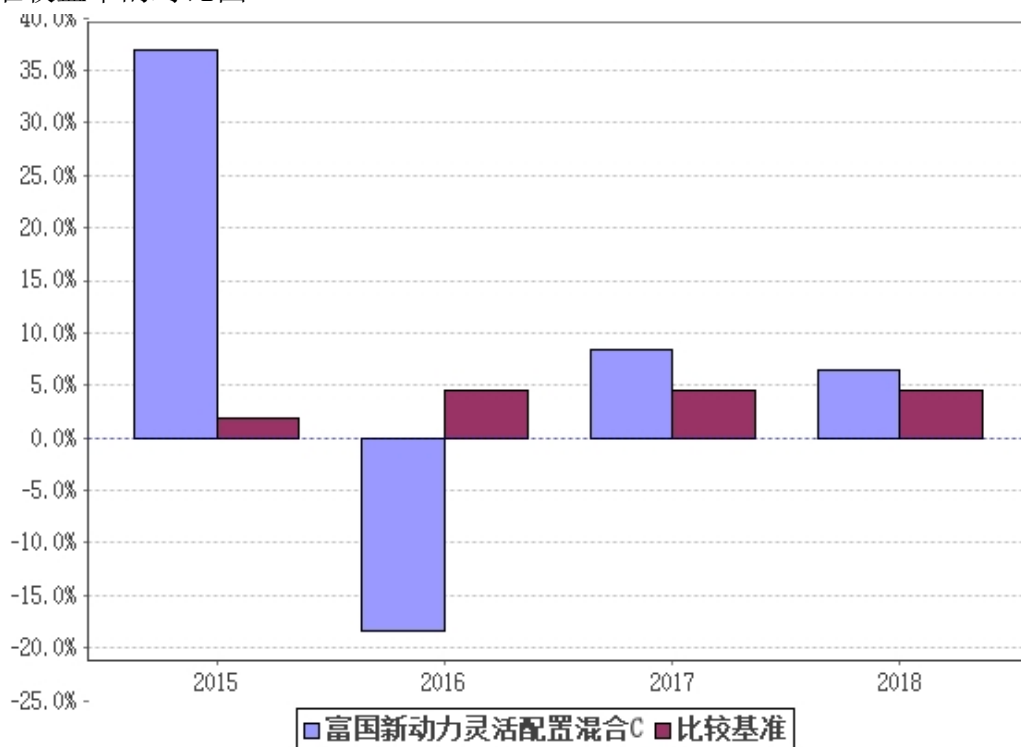
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来新动力灵活配置 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：2015 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来新动力灵活配置 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：2015 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) 新动力灵活配置 A

注：过往三年本基金未进行利润分配。



## (2) 新动力灵活配置 C

注：过往三年本基金未进行利润分配。

## § 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 2018 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一百二十四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		
李晓铭	本基金基金经理	2016-04-15	—	14	硕士，曾任华富基金管理有限公司行业研究员，2006 年 4 月至 2009 年 10 月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，富国天博创新主题混合型证券投资基金基金经理助理，2009 年 10 月至 2014 年 10 月任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理，2011 年 8 月至 2014 年 7 月任富国

					低碳环保混合型证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国天益价值混合型证券投资基金基金经理，2015年2月起任富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年2月起任富国改革动力混合型证券投资基金基金经理，2016年3月起任富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年4月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年3月起任富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，兼任权益研究部总经理。具有基金从业资格。
于洋	本基金基金经理	2017-10-25	—	7	硕士，自2011年8月至2013年2月任第一创业证券股份有限公司医药行业分析师、自2013年3月至2015年2月任华创证券有限责任公司医药研究员、自2015年4月至2015年10月任安信证券股份有限公司医药行业首席分析师；2015年11月起加入富国基金管理有限公司，历任高级行业研究员；2017年10月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年11月起任富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年2月起任富国医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
蔡耀华	本基金前任基金经理	2016-12-16	2018-01-30	8	学士，自2011年7月加入富国基金管理有限公司，历任基金会计助理、基金会计、风控员、基金经理助理，2016年12月至2018年1月任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年1月起任富国新机遇灵活配置混合型发起式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。
- 3、公司已于 2019 年 2 月 2 日发布公告，李晓铭自 2019 年 2 月 1 日起不再担任本基金基金经理。

## **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国新动力灵活配置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》、《富国新动力灵活配置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 2 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**

2018 年宏观经济增速稳定，在金融去杠杆和国际政治经济复杂多变的背景下，市场估值中枢下移，A 股市场受宏观环境和流动性双重冲击，下跌幅度较大，市场集中交易在稳定消费类公司，资产负债良好，现金流量充沛，抗风险能力强的公司获得了相对集中的追捧。另一方面，市场对风险的过度反应导致了大量公司跌入了相对合理的价值区域，给未来的投资带来大量新标的。本基金坚持自下而上的选股策略争取获得更多超额收益。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值 A/B 级为 1.304 元，C 级为 1.289 元；份额累计净值 A/B 级为 1.304 元，C 级为 1.289 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A/B 级为 6.89%，C 级为 6.53%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 4.50%，C 级为 4.50%

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

18 年 A 股的单边下跌的是对经济悲观及流动性趋紧的反应，而 19 年我们看到了诸多有利的政策，有利于估值的修复。虽然在盈利端，出现超预期盈利下滑的概率仍然存在，但是基于当前 A 股的估值水平，我们认为可以更加积极乐观的配置优质资产。

#### **4.6 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。

#### **4.7 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。

#### 4.8 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 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 3 月 15 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

### § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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。

### § 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。  
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

### § 7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：富国新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
资产：		

银行存款	51,139,628.28	501,958.73
结算备付金	1,914,008.43	4,315,804.20
存出保证金	359,209.66	7,981.02
交易性金融资产	161,341,959.87	12,677,940.86
其中：股票投资	161,321,338.71	9,226,098.36
基金投资	—	—
债券投资	20,621.16	3,451,842.50
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	—	10,000,125.00
应收证券清算款	82,910,869.21	266,625.40
应收利息	2,764.73	63,170.68
应收股利	—	—
应收申购款	313,495.98	3,858.14
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	297,981,936.16	27,837,464.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2018年12月31日)</b>	<b>(2017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	12,140,118.87	—
应付赎回款	1,630,983.32	158,228.19
应付管理人报酬	146,893.30	216,610.38
应付托管费	61,205.54	90,254.32
应付销售服务费	28,022.26	2,497.11
应付交易费用	700,573.08	122,103.27
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	180,674.10	180,004.64
负债合计	14,888,470.47	769,697.91
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	217,678,445.93	22,232,483.76
未分配利润	65,415,019.76	4,835,282.36
所有者权益合计	283,093,465.69	27,067,766.12
负债和所有者权益总计	297,981,936.16	27,837,464.03

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.301 元，基金份额总额

217,678,445.93 份。其中：新动力灵活配置 A 份额净值 1.304 元，份额总额 167,945,040.20 份；新动力灵活配置 C 份额净值 1.289 元，份额总额 49,733,405.73 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	-23,813,281.51	54,466,275.64
1. 利息收入	890,934.54	17,765,415.92
其中：存款利息收入	640,713.55	6,150,469.92
债券利息收入	18,255.68	8,329,013.65
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	231,965.31	3,285,932.35
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-16,703,139.35	35,623,688.42
其中：股票投资收益	-18,563,474.18	33,800,268.62
基金投资收益	—	—
债券投资收益	148,598.35	171,135.36
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	1,711,736.48	1,652,284.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,162,490.50	1,061,612.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,161,413.80	15,558.77
<b>减：二、费用</b>	5,978,176.85	6,879,876.32
1. 管理人报酬	1,340,220.76	4,906,757.71
2. 托管费	558,425.27	1,359,722.98
3. 销售服务费	293,063.12	37,922.73
4. 交易费用	3,659,776.09	402,582.36
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	4.92	—
7. 其他费用	126,686.69	172,890.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-29,791,458.36	47,586,399.32
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-29,791,458.36	47,586,399.32

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018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）	22,232,483.76	4,835,282.36	27,067,766.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-29,791,458.36	-29,791,458.36
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）	195,445,962.17	90,371,195.76	285,817,157.93
其中：1. 基金申购款	524,144,275.76	246,134,561.59	770,278,837.35
2. 基金赎回款	-328,698,313.59	-155,763,365.83	-484,461,679.42
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）	217,678,445.93	65,415,019.76	283,093,465.69
项目	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017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）	482,036,481.32	58,689,289.36	540,725,770.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	47,586,399.32	47,586,399.32
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）	-459,803,997.56	-101,440,406.32	-561,244,403.88
其中：1. 基金申购款	3,337,643.52	552,416.09	3,890,059.61
2. 基金赎回款	-463,141,641.08	-101,992,822.41	-565,134,463.49
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）	22,232,483.76	4,835,282.36	27,067,766.12

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



基金管理公司负责人

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

### 7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.3 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年12月31日)		上年度可比期间(2017年01月01日至2017年12月31日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	194,672,663.94	7.79	6,545,539.49	2.80
申万宏源	172,391,493.75	6.90	1,576,749.26	0.67

##### 7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2018年01月01日至2018年12月31日）		上年度可比期间（2017年01月01日至2017年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	47,791,738.63	40.56

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2018年01月01日至2018年12月31日）		上年度可比期间（2017年01月01日至2017年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	214,000,000.00	2.32
申万宏源	—	—	211,000,000.00	2.29

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2018年01月01日至2018年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	157,796.45	6.93	46,449.73	6.63
海通证券	177,520.33	7.79	48,271.72	6.89
关联方名称	上年度可比期间（2017年01月01日至2017年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	5,964.91	2.80	0.00	0.00
申万宏源	1,468.39	0.69	0.00	0.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至	上年度可比期间（2017年01月
----	-----------------	------------------

	2018年12月31日)	01日至2017年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	1,340,220.76	4,906,757.71
其中：支付销售机构的客户维护费	619,883.65	150,512.42

注：2015年08月04日至2017年05月02日，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

2017年5月3日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年12月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	558,425.27	1,359,722.98

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.2.3 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(2018年01月01日至2018年12月31日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	37,328.55	37,328.55
申万宏源	—	942.52	942.52
合计	—	38,271.07	38,271.07

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年12月31日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	22,928.83	22,928.83
申万宏源	—	584.18	584.18

合计	—	23,513.01	23,513.01
----	---	-----------	-----------

注：本基金 A 类和 B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.5%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.4.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.4.5 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（2018年01月01日至2018年12月31日）		上年度可比期间（2017年01月01日至2017年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	51,139,628.28	606,390.46	501,958.73	320,579.30

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.4.7其他关联交易事项的说明

##### 7.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1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。

##### 7.4.5.2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
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-01-10	17.15	254,200	4,397,660.00	4,069,742.00	—

##### 7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2018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。

###### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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。

#### 7.4.6 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2018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157,272,217.87元，属于第二层次的

余额为人民币 4,069,742.00 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2017 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 4,234,486.61 元，属于第二层次的余额为人民币 8,443,454.25 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	161,321,338.71	54.14
	其中：股票	161,321,338.71	54.14
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	20,621.16	0.01
	其中：债券	20,621.16	0.01
	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	53,053,636.71	17.80
8	其他各项资产	83,586,339.58	28.05
9	合计	297,981,936.16	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	4,745,000.00	1.68
C	制造业	127,683,683.71	45.10
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	—	—
J	金融业	12,033,662.00	4.25
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	16,858,993.00	5.96
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	161,321,338.71	56.99

## 8.3 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

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	600085	同仁堂	433,601	11,924,027.50	4.21
2	300760	迈瑞医疗	94,300	10,299,446.00	3.64
3	300015	爱尔眼科	385,950	10,150,485.00	3.59
4	600760	中航沈飞	354,280	9,817,098.80	3.47
5	002007	华兰生物	285,100	9,351,280.00	3.30
6	300601	康泰生物	248,500	8,891,330.00	3.14
7	000661	长春高新	49,035	8,581,125.00	3.03
8	600887	伊利股份	372,100	8,513,648.00	3.01
9	601288	农业银行	2,212,200	7,963,920.00	2.81
10	300595	欧普康视	203,580	7,886,689.20	2.79

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

## 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300122	智飞生物	66,423,577.79	245.40
2	600760	中航沈飞	60,137,948.24	222.18
3	600276	恒瑞医药	58,716,038.67	216.92
4	600436	片仔癀	51,891,467.64	191.71
5	600519	贵州茅台	50,030,370.30	184.83
6	300601	康泰生物	48,599,065.14	179.55
7	300015	爱尔眼科	43,818,568.59	161.88
8	600085	同仁堂	39,647,004.12	146.47
9	300009	安科生物	37,770,008.19	139.54
10	002007	华兰生物	37,555,815.40	138.75
11	002262	恩华药业	36,645,540.48	135.38
12	000661	长春高新	31,936,995.56	117.99
13	600048	保利地产	29,409,478.00	108.65
14	603127	昭衍新药	27,481,442.00	101.53
15	603259	药明康德	27,238,031.84	100.63
16	603986	兆易创新	25,190,385.36	93.06
17	000963	华东医药	24,701,374.66	91.26
18	300498	温氏股份	22,113,284.26	81.70
19	601607	上海医药	21,132,029.35	78.07
20	002044	美年健康	19,804,479.10	73.17
21	600887	伊利股份	17,955,276.90	66.33
22	600267	海正药业	16,771,513.89	61.96
23	002027	分众传媒	16,201,622.00	59.86
24	603882	金域医学	15,380,155.50	56.82
25	002153	石基信息	14,754,775.15	54.51
26	600380	健康元	13,902,254.95	51.36
27	300595	欧普康视	13,624,115.00	50.33
28	601857	中国石油	12,672,101.59	46.82
29	600879	航天电子	11,653,292.98	43.05
30	601766	中国中车	10,949,338.60	40.45
31	300760	迈瑞医疗	10,863,896.80	40.14
32	600487	亨通光电	10,750,836.18	39.72
33	300188	美亚柏科	10,721,989.76	39.61
34	300529	健帆生物	10,511,004.00	38.83
35	600030	中信证券	10,138,038.82	37.45
36	600372	中航电子	9,880,692.00	36.50



37	002013	中航机电	9,310,433.29	34.40
38	300347	泰格医药	9,264,243.00	34.23
39	000768	中航飞机	9,218,684.44	34.06
40	601288	农业银行	9,025,355.00	33.34
41	002773	康弘药业	8,972,600.84	33.15
42	300413	芒果超媒	8,623,976.00	31.86
43	000513	丽珠集团	8,611,692.40	31.82
44	603501	韦尔股份	8,539,385.24	31.55
45	601225	陕西煤业	8,423,050.00	31.12
46	600967	内蒙一机	7,716,587.64	28.51
47	600703	三安光电	7,409,262.00	27.37
48	603367	辰欣药业	7,315,211.00	27.03
49	000596	古井贡酒	7,287,209.36	26.92
50	300059	东方财富	7,212,032.81	26.64
51	600803	新奥股份	7,179,105.48	26.52
52	002912	中新赛克	7,153,127.60	26.43
53	600570	恒生电子	7,138,013.00	26.37
54	300253	卫宁健康	6,997,235.00	25.85
55	601888	中国国旅	6,956,091.00	25.70
56	601595	上海电影	6,770,265.29	25.01
57	601398	工商银行	6,737,642.00	24.89
58	000002	万科A	6,231,587.00	23.02
59	600196	复星医药	6,044,900.00	22.33
60	300016	北陆药业	5,811,644.50	21.47
61	600536	中国软件	5,742,539.00	21.22
62	002555	三七互娱	5,626,972.61	20.79
63	601336	新华保险	5,600,347.00	20.69
64	600549	厦门钨业	5,567,256.50	20.57
65	000858	五粮液	5,552,000.00	20.51
66	300078	思创医惠	5,545,226.00	20.49
67	001979	招商蛇口	5,442,051.00	20.11
68	601318	中国平安	5,360,416.10	19.80
69	300357	我武生物	5,342,425.00	19.74
70	002341	新纶科技	5,236,623.00	19.35
71	000550	江铃汽车	5,098,293.00	18.84
72	603517	绝味食品	4,949,813.00	18.29
73	600055	万东医疗	4,716,963.00	17.43
74	000063	中兴通讯	4,695,666.00	17.35
75	000603	盛达矿业	4,639,722.58	17.14
76	300463	迈克生物	4,400,846.00	16.26
77	002371	北方华创	4,379,413.00	16.18

78	601233	桐昆股份	4,374,455.00	16.16
79	600062	华润双鹤	4,361,142.20	16.11
80	300014	亿纬锂能	4,306,035.60	15.91
81	300373	扬杰科技	4,233,623.00	15.64
82	000998	隆平高科	4,231,768.50	15.63
83	002589	瑞康医药	4,218,543.00	15.59
84	002594	比亚迪	4,172,457.06	15.41
85	000423	东阿阿胶	3,880,915.15	14.34
86	002117	东港股份	3,471,471.00	12.83
87	002422	科伦药业	3,328,764.00	12.30
88	002390	信邦制药	3,286,444.00	12.14
89	601688	华泰证券	3,286,167.00	12.14
90	002821	凯莱英	3,178,286.09	11.74
91	300408	三环集团	2,935,643.00	10.85
92	002415	海康威视	2,921,188.00	10.79
93	601088	中国神华	2,806,946.00	10.37
94	000807	云铝股份	2,783,663.00	10.28
95	600729	重庆百货	2,700,670.00	9.98
96	300207	欣旺达	2,550,506.84	9.42
97	000710	贝瑞基因	2,229,081.00	8.24
98	002215	诺普信	2,176,053.00	8.04
99	600360	华微电子	2,122,795.00	7.84
100	300003	乐普医疗	1,963,401.00	7.25
101	600460	士兰微	1,929,387.00	7.13
102	600161	天坛生物	1,913,209.69	7.07
103	603738	泰晶科技	1,883,370.74	6.96
104	002655	共达电声	1,743,618.00	6.44
105	600028	中国石化	1,647,864.00	6.09
106	300294	博雅生物	1,134,851.00	4.19
107	603708	家家悦	979,539.00	3.62
108	600521	华海药业	977,760.00	3.61
109	002078	太阳纸业	965,460.00	3.57
110	002370	亚太药业	862,427.00	3.19
111	002466	天齐锂业	851,505.65	3.15
112	601601	中国太保	837,960.00	3.10
113	600547	山东黄金	812,379.00	3.00
114	002680	*ST 长生	740,213.00	2.73
115	600066	宇通客车	670,699.46	2.48
116	002292	奥飞娱乐	655,094.00	2.42
117	600486	扬农化工	651,845.00	2.41
118	600188	兖州煤业	637,099.00	2.35

119	002146	荣盛发展	616,932.00	2.28
120	600018	上港集团	559,200.00	2.07
121	601111	中国国航	554,738.00	2.05
122	600489	中金黄金	551,650.00	2.04

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300122	智飞生物	72,768,964.54	268.84
2	600276	恒瑞医药	59,090,324.18	218.31
3	600519	贵州茅台	50,991,882.58	188.39
4	600760	中航沈飞	44,920,567.50	165.96
5	600436	片仔癀	44,807,352.15	165.54
6	002262	恩华药业	40,079,638.96	148.07
7	300601	康泰生物	39,584,639.12	146.24
8	300015	爱尔眼科	34,355,142.36	126.92
9	300009	安科生物	29,354,104.51	108.45
10	002007	华兰生物	28,764,271.20	106.27
11	603259	药明康德	28,497,555.82	105.28
12	600048	保利地产	28,324,868.00	104.64
13	603986	兆易创新	26,523,617.49	97.99
14	000661	长春高新	25,508,758.12	94.24
15	603127	昭衍新药	23,502,567.97	86.83
16	000963	华东医药	22,757,007.79	84.07
17	600085	同仁堂	21,946,872.55	81.08
18	300498	温氏股份	20,380,567.33	75.29
19	601607	上海医药	18,815,083.68	69.51
20	002044	美年健康	16,589,687.30	61.29
21	600267	海正药业	16,311,005.84	60.26
22	002153	石基信息	16,240,217.85	60.00
23	600380	健康元	15,397,859.60	56.89
24	002027	分众传媒	14,584,548.04	53.88
25	600487	亨通光电	11,225,513.96	41.47
26	601857	中国石油	11,168,196.00	41.26
27	600879	航天电子	10,899,480.92	40.27
28	300529	健帆生物	9,992,096.00	36.92
29	300413	芒果超媒	9,244,879.00	34.15
30	600887	伊利股份	8,981,320.05	33.18
31	300188	美亚柏科	8,867,482.26	32.76
32	601225	陕西煤业	8,672,755.88	32.04
33	002013	中航机电	8,513,479.04	31.45
34	000768	中航飞机	8,123,815.00	30.01

35	300347	泰格医药	7,657,126.00	28.29
36	601888	中国国旅	7,561,528.00	27.94
37	600803	新奥股份	7,233,248.75	26.72
38	600967	内蒙一机	6,740,286.70	24.90
39	600372	中航电子	6,647,859.56	24.56
40	300253	卫宁健康	6,608,762.44	24.42
41	300059	东方财富	6,586,922.68	24.33
42	600570	恒生电子	6,584,679.00	24.33
43	601398	工商银行	6,557,167.00	24.23
44	601766	中国中车	6,408,488.40	23.68
45	603367	辰欣药业	6,358,438.00	23.49
46	000002	万科 A	6,350,872.00	23.46
47	600536	中国软件	6,323,195.00	23.36
48	300595	欧普康视	5,992,316.00	22.14
49	002555	三七互娱	5,942,115.00	21.95
50	601595	上海电影	5,889,901.00	21.76
51	000513	丽珠集团	5,880,758.60	21.73
52	300016	北陆药业	5,851,610.00	21.62
53	000550	江铃汽车	5,816,061.00	21.49
54	300078	思创医惠	5,761,461.00	21.29
55	600703	三安光电	5,742,027.00	21.21
56	000615	京汉股份	5,701,713.00	21.06
57	002912	中新赛克	5,692,551.00	21.03
58	603882	金域医学	5,654,182.40	20.89
59	600030	中信证券	5,586,083.36	20.64
60	600196	复星医药	5,572,156.00	20.59
61	001979	招商蛇口	5,430,055.80	20.06
62	000858	五粮液	5,417,771.25	20.02
63	601336	新华保险	5,403,944.00	19.96
64	600549	厦门钨业	5,393,271.40	19.93
65	002341	新纶科技	5,352,299.00	19.77
66	000063	中兴通讯	5,086,357.19	18.79
67	601318	中国平安	4,949,330.00	18.28
68	603517	绝味食品	4,795,882.99	17.72
69	603501	韦尔股份	4,654,679.16	17.20
70	002371	北方华创	4,588,620.00	16.95
71	002594	比亚迪	4,581,565.00	16.93
72	300014	亿纬锂能	4,576,683.20	16.91
73	600062	华润双鹤	4,501,781.54	16.63
74	300463	迈克生物	4,461,583.00	16.48
75	000998	隆平高科	4,404,434.50	16.27

76	000423	东阿阿胶	4,382,292.66	16.19
77	002589	瑞康医药	3,923,090.00	14.49
78	002422	科伦药业	3,524,385.00	13.02
79	002773	康弘药业	3,365,167.00	12.43
80	002117	东港股份	3,328,752.00	12.30
81	002390	信邦制药	3,220,654.00	11.90
82	002415	海康威视	3,218,160.00	11.89
83	601688	华泰证券	3,207,609.54	11.85
84	002821	凯莱英	3,149,612.00	11.64
85	000651	格力电器	3,120,754.00	11.53
86	000807	云铝股份	2,859,241.00	10.56
87	601088	中国神华	2,711,100.94	10.02
88	300003	乐普医疗	2,678,503.00	9.90
89	600729	重庆百货	2,670,864.62	9.87
90	000710	贝瑞基因	2,416,540.00	8.93
91	300207	欣旺达	2,318,298.00	8.56
92	600055	万东医疗	2,194,831.00	8.11
93	002215	诺普信	2,050,526.00	7.58
94	600161	天坛生物	2,013,876.00	7.44
95	600360	华微电子	1,919,864.00	7.09
96	600460	士兰微	1,909,877.00	7.06
97	603738	泰晶科技	1,850,785.50	6.84
98	002655	共达电声	1,831,726.86	6.77
99	600028	中国石化	1,676,076.21	6.19
100	300294	博雅生物	1,205,606.00	4.45
101	600521	华海药业	1,147,707.00	4.24
102	002078	太阳纸业	1,033,476.72	3.82
103	002680	*ST 长生	990,240.00	3.66
104	002370	亚太药业	895,667.00	3.31
105	002466	天齐锂业	884,840.17	3.27
106	603708	家家悦	879,871.10	3.25
107	600547	山东黄金	805,473.00	2.98
108	600188	兖州煤业	732,080.00	2.70
109	601601	中国太保	721,034.00	2.66
110	601111	中国国航	674,828.12	2.49
111	600486	扬农化工	642,056.00	2.37
112	002146	荣盛发展	640,452.40	2.37
113	600066	宇通客车	637,532.00	2.36
114	002292	奥飞娱乐	632,987.00	2.34
115	601288	农业银行	615,097.40	2.27
116	300408	三环集团	601,905.00	2.22

117	600018	上港集团	571,200.00	2.11
118	300750	宁德时代	567,220.36	2.10
119	600489	中金黄金	545,050.00	2.01
120	600050	中国联通	544,800.00	2.01

#### 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	1,340,495,223.73
卖出股票收入（成交）总额	1,159,732,452.90

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）	20,621.16	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	20,621.16	0.01

#### 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	123008	康泰转债	167	20,621.16	0.01

#### 8.7 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。

#### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 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。

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。

### 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。

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。

### 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	359,209.66
2	应收证券清算款	82,910,869.21

3	应收股利	—
4	应收利息	2,764.73
5	应收申购款	313,495.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	83,586,339.58

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123008	康泰转债	20,621.16	0.01

#### 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 (%)
新动力灵活配置 A	22,486	7,468.87	14,720,699.85	8.77	153,224,340.35	91.23
新动力灵活配置 C	9,050	5,495.40	—	—	49,733,405.73	100.00
合计	31,536	6,902.54	14,720,699.85	6.76	202,957,746.08	93.24

### 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	新动力灵活配	410,712.75	0.2446



有从业人员持有 本基金	置 A		
	新动力灵活配 置 C	339,326.66	0.6823
	合计	750,039.41	0.3446

### 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	新动力灵活配置 A	0~10
	新动力灵活配置 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	新动力灵活配置 A	0
	新动力灵活配置 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	新动力灵活配置 A	新动力灵活配置 C
基金合同生效日(2015年08月04日)基金 份额总额	97,359,303.60	176,770,162.89
报告期期初基金份额总额	17,386,844.23	4,845,639.53
本报告期基金总申购份额	349,932,180.90	174,212,094.86
减：本报告期基金总赎回份额	199,373,984.93	129,324,328.66
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	167,945,040.20	49,733,405.73

## § 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。  
本报告期本基金管理人无重大人事变动。

### 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 8 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 16 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**

2018 年 10 月，公司收到上海证监局向公司出具的《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》以及对相关负责人的警示。公司对此高度重视，成立专项整改小组逐条落实整改要求，强化公司内控制度建设和合规管理措施，进一步提升全员合规意识。报告期内公司已通过上海证监局的整改验收。

除上述情况外，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	106,723,570.13	4.27	1,360,674.62	19.08	—	—	—	—	97,883.35	4.30	—
渤海证券	2	4,954,647.00	0.20	1,171,335.00	16.43	—	—	—	—	4,515.41	0.20	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	2	499,232,369.07	19.98	—	—	15,100,000.00	5.40	—	—	454,952.85	19.97	—
东北证券	2	111,905,918.68	4.48	—	—	—	—	—	—	101,978.95	4.48	—
东财证券	2	166,402,259.94	6.66	—	—	—	—	—	—	151,641.80	6.66	—
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
光大证券	2	137,480,963.31	5.50	—	—	97,700,000.00	34.94	—	—	125,285.37	5.50	—
广发证券	2	195,390,492.96	7.82	—	—	—	—	—	—	178,060.77	7.82	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	67,938,727.27	2.72	—	—	—	—	—	—	61,950.76	2.72	—
国信证券	2	221,134,279.69	8.85	—	—	84,100,000.00	30.08	—	—	199,144.85	8.74	—
海通证券	2	194,672,663.94	7.79	—	—	—	—	—	—	177,520.33	7.79	—
华泰证券	1	21,745,646.36	0.87	—	—	—	—	—	—	19,816.91	0.87	—
华信证券	2	100,847,880.91	4.04	712,891.40	10.00	—	—	—	—	91,902.80	4.03	—

平安证券	2	34,715,448.15	1.39	1,130,880.00	15.86	—	—	—	—	31,635.82	1.39	—
瑞银证券	2	4,654,679.16	0.19	—	—	—	—	—	—	4,241.61	0.19	—
上海证券	1	92,911,625.85	3.72	—	—	—	—	—	—	86,528.68	3.80	—
申万宏源	1	172,391,493.75	6.90	—	—	—	—	—	—	157,796.45	6.93	—
太平洋证券	2	73,004,772.71	2.92	2,753,984.64	38.63	—	—	—	—	66,532.70	2.92	—
天风证券	2	88,328,222.05	3.54	—	—	—	—	—	—	80,492.85	3.53	—
西南证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	37,394,710.71	1.50	—	—	82,700,000.00	29.58	—	—	34,111.08	1.50	—
招商证券	1	35,709,617.02	1.43	—	—	—	—	—	—	32,542.04	1.43	—
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	47,515,123.19	1.90	—	—	—	—	—	—	43,301.02	1.90	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	83,589,501.72	3.35	—	—	—	—	—	—	76,550.68	3.36	—
中银国际	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我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。本报告期本基金退租券商交易单元：中信山东（37831、002919）。本报告期本基金新增券商交易单元：中信证券（005899），国信证券（42678）。

## § 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。