富国金利定期开放混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
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	富国金利定期开放混合	
基金主代码	005129	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2017年12月20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	
报告期末基金份额总额	13,440,870.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国金利定期开放混合A	富国金利定期开放混合C
下分级基金的交易代码	005129	005130
报告期末下属分级基金的份额总额	11,129,687.26份	2,311,183.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理运用投资组合优化策略，在严格控制风险的基础上，力争实现基金收益的稳步提升。
投资策略	本基金在资产配置中通过控制权益资产的上限并对其进行动态止盈，从而实现控制风险资产波动性的目的。一方面，通过固定收益资产提供稳健收益，并以其作为权益资产的安全垫；另一方面，通过严格控制风险资产的投资额度，并动态调整组合，以此控制组合的回撤。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%＋沪深300指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王永民
	联系电话	021-20361818	010-66594896
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105686,4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942

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楼 托管人住所

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）富国金利定期开放混合A

3.1.1期间数据和指标	2018年	2017年12月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
本期已实现收益	6,085,294.72	258,266.37
本期利润	6,191,723.41	141,860.26
加权平均基金份额本期利润	0.0315	0.0007
本期基金份额净值增长率	3.00%	0.07%
3.1.2期末数据和指标	2018年12月31日	2017年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0267	0.0007
期末基金资产净值	11,471,824.65	201,108,398.40
期末基金份额净值	1.0307	1.0007

（2）富国金利定期开放混合C

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年	2017年12月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
本期已实现收益	322,073.37	14,849.83
本期利润	338,637.03	7,463.59
加权平均基金份额本期利润	0.0270	0.0006
本期基金份额净值增长率	2.55%	0.06%
3.1.2期末数据和指标	2018年12月31日	2017年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0221	0.0006
期末基金资产净值	2,371,528.09	12,759,841.09
期末基金份额净值	1.0261	1.0006

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）富国金利定期开放混合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	0.80%	0.06%	-0.94%	0.32%	1.74%	-0.26%
过去六个月	2.18%	0.06%	-0.81%	0.29%	2.99%	-0.23%
过去一年	3.00%	0.06%	-1.72%	0.26%	4.72%	-0.20%
自基金合同生效日起至今	3.07%	0.06%	-1.74%	0.26%	4.81%	-0.20%

（2）富国金利定期开放混合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	0.66%	0.06%	-0.94%	0.32%	1.60%	-0.26%
过去六个月	1.94%	0.06%	-0.81%	0.29%	2.75%	-0.23%
过去一年	2.55%	0.06%	-1.72%	0.26%	4.27%	-0.20%
自基金合同生效日起至今	2.61%	0.06%	-1.74%	0.26%	4.35%	-0.20%

注：中债综合全价指数收益率*80%＋沪深300指数收益率*20%

本基金选择中债综合全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债综合全价指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，应用也最广的指数。中债综合全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深300指数样本覆盖了沪深市场60%左右的市值，具有良好的市场代表性和可投资性。

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（benchmark）按下列公式计算：

benchmark t =80% *[中债综合全价指数收益率t/(中债综合全价指数收益率t-1)-1] +20% * [沪深300指数收益率t/(沪深300指数收益率t-1)-1] ；

其中，t=1,2,3,…,T，T表示时间截至日；

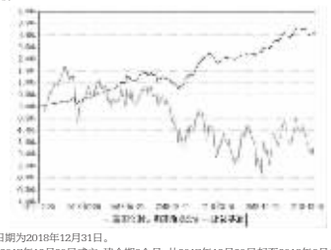
期间T1日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark t)-1

其中，T=2,3,4,…；∏Tt=1(1+benchmark t)表示t日至T日的(1+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金利定期开放混合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2018年12月31日。

2、本基金于2017年12月20日成立，建仓期6个月，从2017年12月20日起至2018年6月19日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

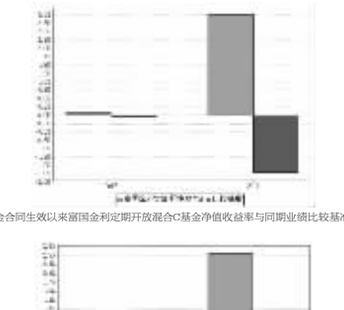
（2）自基金合同生效以来富国金利定期开放混合C基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1、截止日期为2018年12月31日。

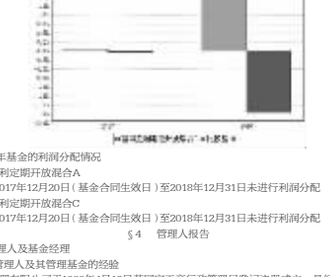
2、本基金于2017年12月20日成立，建仓期6个月，从2017年12月20日起至2018年6月19日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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金利定期开放混合A基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



（2）自基金合同生效以来富国金利定期开放混合C基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

（1）富国金利定期开放混合A

注：本基金2017年12月20日（基金合同生效日）至2018年12月31日未进行利润分配

（2）富国金利定期开放混合C

注：本基金2017年12月20日（基金合同生效日）至2018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、ODII、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		
李羿	本基金基金经理	2017-12-20	-	5	硕士，2009年4月至2010年6月任上海浦东发展银行交易员；2010年6月至2013年7月任交银康联人寿保险有限公司高级投资经理；2013年7月至2016年6月任汇丰晋信基金管理有限公司投资经理、基金经理；2016年6月起加入富国基金管理有限公司，自2016年11月起任富国天盈债券型证券投资基金（LOF）基金经理，自2017年3月起任富国稳健增强债券型证券投资基金基金经理，自2017年8月起任富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自2017年9月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年11月起任富国景利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，自2017年12月起任富国金利定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2018年1月起任富国绿色纯债一年定期开放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 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金利定期开放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》、《富国金利定期开放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、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 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，债券市场经历了牛市行情，从10年国债收益率来看，下行近70BP；分阶段看，一季度央行虽然跟随美联储加息步伐上调MLF利率，但幅度已经有所缩小，流动性开始逐步宽裕；二季度开始，去杠杆严监管的环境逐步向稳杠杆转变，尤其是中美贸易纠纷后，对经济预期略有降低，权益市场开始调整，市场风险偏好下降。三季度开始，中央开始加大逆周期调节，货币政策继续边际宽松。在货币政策方面，在通胀保持稳定的基础上，央行通过降准、逆回购和MLF等方式向市场投放流动性。四季度中央经济工作会议确立了“稳健”的货币政策以代替之前“稳健中性”的货币政策。全年短端利率逐步下行，带动中长端下行。信用方面，上半年呈现“宽货币、紧信用”特征。下半年开始逐步向“宽货币、宽信用”转变。然而，全年局部信用风险继续暴露，部分低等级信用利差持续扩大，信用违约持续发生。中债全价指数全年上涨，一扫2017年下跌3.38%的阴霾。股票市场则呈现了熊市行情，估值和业绩增速均有所下行。沪深300全年下跌25.31%。本基金在力控风险前提下，审慎操作，总体控制了权益波动风险，全年为投资者获取了一定的超额回报。

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级为1.0307元，C级为1.0261元；份额累计净值A级为1.0307元，C级为1.0261元；本报告期，本基金份额净值增长率A级为3.00%，C级为2.55%，同期业绩比较基准收益率A级为-1.72%，C级为-1.72%

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2019年，“三大攻坚战”初战告捷，未来防范化解重大风险攻坚战依然是主要任务之一。在经济下行周期中，防范风险多是以稳为主，监管政策更会体现刚柔并济。货币政策的表述去掉了“中性”和“总闸门”，表明全年流动性仍将维持合理充裕。美联储加息步伐逐步趋缓，全球货币政策紧缩周期可能进入尾声，人民币汇率大概率将总体稳定。经历了2018年的牛市，虽然债券收益率继续下行空间变小，但2019年总体宏观环境仍将有利于债券行情。股票方面，虽然整体宏观下行背景下，年初来看整体业绩增速依然难以乐观，但因为无风险利率下行，部分估值调整到相对合适的价值区间，在政策大力推动下风险偏好也将提升。相信2019年权益市场会有较好的表现。本基金力争在控制风险的前提下，争取为基金持有人带来可持续的投资回报。

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，截至2018年报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国金利定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：富国金利定期开放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	10,926,421.50	120,492,890.25
结算备付金	804,437.12	-
存出保证金	8,411.81	-
交易性金融资产	998,700.00	28,552,700.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	998,700.00	28,552,700.00
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	5,000,000.00	64,400,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	32,799.33	848,999.00
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	17,770,769.76	214,294,589.25
负债和所有者权益	本期末（2018年12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
负 债：		
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	3,009,753.61	347,506.85
应付赎回款	629,167.81	-
应付管理人报酬	134,179.71	64,421.19
应付托管费	26,835.94	12,884.23
应付销售服务费	3,393.92	1,537.49
应付交易费用	16,833.31	-
应交税费	7,252.72	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	100,000.00	-
负债合计	3,927,417.02	426,349.76
所有者权益：		
实收基金	13,440,870.57	213,718,915.64
未分配利润	402,482.17	149,323.85
所有者权益合计	13,843,352.74	213,868,239.49
负债和所有者权益总计	17,770,769.76	214,294,589.25

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.0290元，基金份额总额13,440,870.57份。其中：富国金利定期开放混合A份额净值1.0307元，份额总额11,129,687.26份；富国金利定期开放混合C份额净值1.0261元，份额总额2,311,183.31份。

7.2 利润表

会计主体：富国金利定期开放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12月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日)
一、收入	10,512,288.18	230,048.83
1.利息收入	10,559,454.09	353,841.18
其中：存款利息收入	1,392,678.45	213,234.73
债券利息收入	8,851,496.85	13,936.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	315,278.79	126,670.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-170,158.26	-
其中：股票投资收益	-2,479,863.61	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,145,800.01	-
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	163,905.34	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	122,992.35	-123,792.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	3,981,927.74	80,724.98
1. 管理人报酬	2,116,498.11	64,421.19
2. 托管费	423,299.56	12,884.23
3. 销售服务费	50,620.25	1,537.49
4. 交易费用	96,569.80	239.50
5. 利息支出	1,082,084.42	-
其中：卖出回购金融资产支出	1,082,084.42	-
6. 税金及附加	21,278.52	-
7. 其他费用	191,577.08	1,642.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,530,360.44	149,323.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,530,360.44	149,323.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国金利定期开放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）	213,718,915.64	149,323.85	213,868,239.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,530,360.44	6,530,360.44
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）	-200,278,045.07	-6,277,202.12	-206,555,247.19
其中：1.基金申购款	1,850.76	59.03	1,909.79
2.基金赎回款	-200,279,895.83	-6,277,261.15	-206,557,156.98
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）	13,440,870.57	402,482.17	13,843,352.74
项目	上年度可比期间(2017年12月20日(基金合同生效日)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）	213,718,915.64	-	213,718,915.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	149,323.85	149,323.85
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	213,718,915.64	149,323.85	213,868,239.49

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 基金基本情况

富国金利定期开放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[2017]827号《关于准予富国金利定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人自2017年11月13日到2017年12月13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（2017）验字第60467606_B23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2017年12月20日生效。本基金为契约型定期开放式，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213,703,487.95元，在募集期间产生的存款利息为人民币15,427.69元，以上实收基金（本息）合计为人民币213,718,915.64元，折合213,718,915.64份基金份额，其中A类基金份额200,966,538.14份，C类基金份额12,752,377.50份。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据销售费用收取方式的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券（含中小企业集合债）、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（权证、股指期货等）以及法律法规或中国证监会允许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：本基金投资于股票、权证等资产的比例不超过基金资产的30%。在开放期内，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；在封闭期内，本基金不受前述5%的限制。但如本基金参与股指期货投资的，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%＋沪深300指数收益率*20%。

于2018年12月31日，富国金利定期开放混合型证券投资基金净值加上当日申购申请金额扣除当日赎回金额后的余额低于人民币5000万元。截至本基金第一个开放期的最后一日（即2019年1月11日）日终，富国金利定期开放混合型证券投资基金净值加上当日申购申请金额扣除当日赎回金额后的余额低于人民币5000万元，已触发基金合同中约定的基金终止条款，为维护基金份额持有人利益，根据本基金基金合同的约定，富国基金管理有限公司应终止本基金开依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算，且无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人决定本基金最后运作日为2019年1月11日，自2019年1月12日起进入清算期。

7.4.2 会计政策的编制基础

本财务报表按照《富国金利定期开放混合型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表7.4.4所述的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照7.4.2所述的编制基础编制，真实、完整地反映了本基金于2018年12月31日的财务状况以及2018年度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《富国金利定期开放混合型证券投资基金基金合同》和其他相关规定所规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。

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，金融资产终终止确认；

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) 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；

(6) 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