富国可转换债券证券投资基金 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：	中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	富国可转换债券
基金主代码	100051
交易代码	前端交易代码：100051 后端交易代码：100052
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月08日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	267,569,451.22份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过将“自上而下”宏观分析与“自下而上”个券选配有效结合，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面通过利用可转债的债券特性，强调收益的安全性与稳定性，另一方面利用可转债的股票特性（内含股票期权），分享股市上涨所产生的较高收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准＝天相转债指数收益率×60%＋沪深300指数收益率×20%＋中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中风险较低的品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	贺倩
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

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

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	-51,678,271.78	10,277,339.49	-39,550,358.26
本期利润	-78,008,903.64	33,805,992.79	-47,468,364.49
加权平均基金份额本期利润	-0.2785	0.1437	-0.2041
本期基金份额净值增长率	-16.01%	10.22%	-12.12%
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	0.3215	0.5735	0.4276
期末基金资产净值	353,599,047.26	396,055,653.18	320,929,083.28
期末基金份额净值	1.322	1.574	1.428

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

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	-3.57%	0.58%	-2.92%	0.53%	-0.65%	0.05%
过去六个月	-3.22%	0.62%	-1.25%	0.51%	-1.97%	0.11%
过去一年	-16.01%	0.76%	-3.77%	0.55%	-12.24%	0.21%
过去三年	-18.65%	0.71%	-8.01%	0.53%	-10.64%	0.18%
过去五年	64.22%	1.22%	17.42%	1.15%	46.80%	0.07%
自基金合同生效日起至今	32.20%	1.02%	4.55%	0.96%	27.65%	0.06%

注：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＝天相转债指数收益率×60%＋中债综合指数收益率×20%＋沪深300指数收益率×20%。

本基金可转债投资部分、其它固定收益类证券投资部分、股票投资部分的业绩比较基准分别采用具有代表性的天相转债指数、中债综合指数和沪深300指数。

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 = 60% *[天相转债指数t/(天相转债指数t-1)-1] +20%* [中债综合指数t/(中债综合指数t-1)-1]+20%* [沪深300指数t/(沪深300指数t-1)-1]；

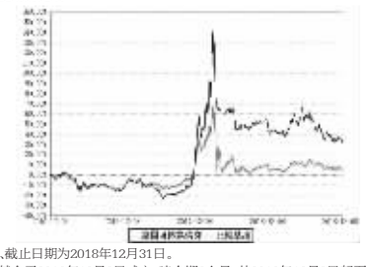
其中，t=1，2，3，…，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmark T）按下列公式计算：

benchmark T =[∏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。

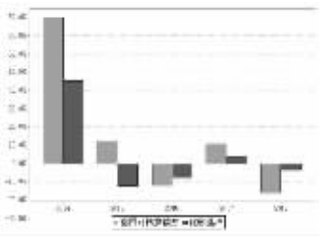
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2018年12月31日。

2、本基金于2010年12月8日成立，建仓期6个月，从2010年12月8日起至2011年6月7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 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
俞晓斌	本基金基金经理	2018-08-31	-	6	硕士，自2007年7月至2012年10月任上海国际货币经纪有限公司经纪人；2012年10月加入富国基金管理有限公司，历任高级交易员、资深交易员兼研究助理，2016年12月起任富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月起任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年8月起任富国优化增强债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金、富国顺利纯债债券型证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国两年期理财债券型证券投资基金、富国金融债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
范磊	本基金前任基金经理	2016-08-19	2018-10-17	8	硕士，曾任深圳发展银行资金高级专员、安信证券交易员；2012年6月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、投资经理，2016年8月至2018年10月任富国优化增强债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金基金经理，2016年11月至2018年7月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年3月至2018年10月任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年8月至2018年10月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。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可转换债券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》、《富国可转换债券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年国内外经济环境发生较大变化。在“去杠杆”政策指引下，前期负债率过高且经营效率不佳的部分实体部门面临较大压力。同时，对地方政府隐性债务的有效控制也使得基建增速较往年出现较为明显的下滑。地产投资增速在低库存、高周转支撑下表现较好，但销售数据显露出疲态。居民消费方面，部分耐用品及可选消费增速趋弱。二季度之后，中美贸易摩擦不断升温，其他发达国家的增长势头也有所减缓，使得进出口前景面临较大不确定性。具体经济数据方面，全年GDP增速6.60%，较17年回落，且同比增速呈现逐季递减的趋势。固定资产投资和社会消费品零售增速分别为5.9%和9.0%，较上年均明显下行。按美元计，外贸进出口增速为12.6%，贸易摩擦压力在4季度有所显现。居民消费价格（CPI）全年有所波动，总体温和上涨，最终比上年增长2.1%。工业生产者价格指数（PPI）呈前高后低走势，比上年上涨3.5%。相较去年，CPI涨幅扩大0.5%，PPI缩窄2.8%，价格“剪刀差”有所收窄。

在上述基本面环境下，国内一系列政策均适时进行微调。货币政策在稳健中性基调不变的情况下，更加突出流动性合理充裕，强调政策工具的逆周期调节作用。年内央行数次下调存款准备金率，并创设定向中期借贷便利（TMLF）对小微企业和民营企业贷款提供额外流动性支持。财政政策上，针对企业和居民的各项减税降费措施正在不断落地过程中。基础设施领域补短板力度逐步加强，以缓解和对冲非政府部门投资意愿不足的情况。对外贸易方面，坚持多边共赢，积极应对，以打促和。金融监管方面，政策指引由“降杠杆”逐步过渡到“稳杠杆”。在资管新规基本要求不变的前提下，给予了一定过渡期，遏制了信用收缩过快的风险。在此环境中，2018年债券市场波动中走强，上半年因基本面及政策的拐头，整体收益率水平从17年以来的高点回落，三季度经历了一段较长时间的盘整，四季度加速下行。全年10年期国债收益率下行幅度超60BP。信用债方面，基本面局部恶化，机构风险偏好降低叠加表外融资渠道受限，使得市场对于部分高杠杆主体的信用风险忧虑加深。全年信用利差走阔后高位震荡，后期随着宽信用政策不断出台，中等评级债利差稍有回落。转债品种，全年表现差强人意，年初冲高回落，后随权益资产下跌，在年中和四季度出现了几次明显的下杀，整体纯债溢价率进入较低区间。

本组合年初受到负债端波动影响，同时资产端流动性迅速丧失，在具体调配上出现一定困难。但进入到下半年以后，一方面负债端趋于稳定，另一方面转债价值逐渐提升，在充分考虑转债市场大扩容，市场需求提升的双驱动环境下，进行分散化配置。在具体选择上，首先考虑转债本身的风险收益比，包括绝对价格、到期收益率、转股溢价率等一系列指标，其次考虑转债正股标的资质，包括信用评级、正股弹性、业绩可持续性等，最后对于具有下修可能性的标的也逐一筛选，寻找可能存在的阶段性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，本基金份额净值为1.322元；份额累计净值为1.322元；本报告期，本基金份额净值增长率为-16.01%，同期业绩比较基准收益率为-3.77%

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2019年，经济面临的困境仍然较大，外部方面中美贸易战虽然短期达成阶段性协议的可能性较大，但是其制约与反制约的长期性会一直存在，内部方面国内投资与消费下滑预计会在上半年体现，而政策的托底效应发生效力需要时间。比较好的方面是，从2018年延续至今的较为宽松的货币政策预计会持续至经济企稳回升，资本市场面临的流动性环境比较友好。在对2017年开始的严监管环境有所调节之后，市场风险偏好有望提升。从品种方面，无风险利率虽然已经下行幅度较多，但期限利差仍处于较高水平，未来中长期限债券利率仍有下行空间。权益方面则更多需要等待政策落地后的效果，同时在上市公司业绩风险充分释放后，整体市盈率的安全度才能够被确认。相比较而言，转债的相对价值较为显著，一方面利率下行后持有转债的机会成本下降，另一方面其内含的股票看涨期权价值较好，为绝对回报投资人提供较好的投资选择。在具体板块方面，由于5G建设今年会进入到实质性阶段，随着整个产业链投入的加大，相关标的会获得更多的政策呵护和资金关注。此外在经历了土地要素、人口要素和资本要素推动后，国内经济不平衡性更加严重，需要大力提升科研水平在其中的作用，故研发水平高的，并能够持续转化为收入增长的公司应该提升关注力度，而对于过往依靠外延并购的公司则需要相对谨慎。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司2018年1月1日至2018年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、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问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：富国可转换债券证券投资基金

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	189,034.04	570,479.29
结算备付金	2,078,751.69	2,902,935.41
存出保证金	92,813.43	290,579.72
交易性金融资产	342,683,649.68	489,877,281.21
其中：股票投资	12,172,870.42	79,043,637.22
基金投资	-	-
债券投资	330,510,779.26	410,833,643.99
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	6,000,000.00	-
应收证券清算款	14,755,066.11	195,884.01
应收利息	1,009,274.50	1,087,480.56
应收股利	-	-
应收申购款	16,257.65	197,600.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	366,824,847.10	495,122,240.34
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	-	98,000,000.00
应付证券清算款	12,566,772.42	-
应付赎回款	169,798.48	530,000.40
应付管理人报酬	207,879.57	230,741.86
应付托管费	59,394.15	65,926.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	23,961.91	74,166.63
应交税费	31,353.33	26,275.96
应付利息	-3,398.70	-30,885.71
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	170,038.68	170,361.78
负债合计	13,225,799.84	99,066,587.16
所有者权益：		
实收基金	267,569,451.22	251,697,909.72
未分配利润	86,029,596.04	144,357,743.46
所有者权益合计	353,599,047.26	396,055,653.18
负债和所有者权益总计	366,824,847.10	495,122,240.34

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.322元，基金份额总额267,569,451.22份。

7.2 利润表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

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）
一、收入	-71,480,875.68	41,053,663.38
1.利息收入	3,700,207.35	3,964,651.97
其中：存款利息收入	222,260.29	230,701.67
债券利息收入	3,394,985.00	3,644,475.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	82,962.06	89,474.40
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-48,986,773.36	13,465,535.82
其中：股票投资收益	-16,592,241.01	-1,072,434.04
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-33,520,518.10	13,581,502.29
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	1,125,985.75	956,467.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-26,330,631.86	23,528,653.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	136,322.19	94,822.29
减：二、费用	6,528,027.96	7,247,670.59
1. 管理人报酬	2,831,784.52	2,447,241.77
2. 托管费	809,081.26	699,211.92
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	742,913.05	1,099,640.17
5. 利息支出	1,861,048.67	2,726,959.49
其中：卖出回购金融资产支出	1,861,048.67	2,726,959.49
6. 税金及附加	7,701.63	-
7. 其他费用	275,498.83	274,617.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-78,008,903.64	33,805,992.79
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-78,008,903.64	33,805,992.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

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）	251,697,909.72	144,357,743.46	396,055,653.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-78,008,903.64	-78,008,903.64
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）	15,871,541.50	19,680,756.22	35,552,297.72
其中：1.基金申购款	384,092,997.02	192,099,516.68	576,192,513.70
2.基金赎回款	-368,221,455.52	-172,418,760.46	-540,640,215.98
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）	267,569,451.22	86,029,596.04	353,599,047.26
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）	224,806,239.25	96,122,844.03	320,929,083.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,805,992.79	33,805,992.79
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）	26,891,670.47	14,428,906.64	41,320,577.11
其中：1.基金申购款	309,649,923.26	165,471,133.63	475,121,056.89
2.基金赎回款	-282,758,252.79	-151,042,226.99	-433,800,479.78
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）	251,697,909.72	144,357,743.46	396,055,653.18

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
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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
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	15,888,099.65	3.48	3,305,088.00	0.47
申万宏源	91,506,327.04	20.02	104,502,358.92	14.96

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	107,320,697.76	4.30	119,492,517.72	3.11
申万宏源	266,153,782.77	10.66	800,617,726.91	20.83

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	32,060,000.00	0.36	87,000,000.00	0.71
申万宏源	1,352,300,000.00	15.36	3,016,200,000.00	24.53

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	84,914.14	20.13	-	-
海通证券	14,479.06	3.43	3,509.47	14.86
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	3,011.93	0.47	1,065.48	1.44
申万宏源	95,961.33	14.86	6,400.10	8.63

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管理费	2,831,784.52	2,447,241.77
其中：支付销售机构的客户维护费	700,435.10	842,413.96

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×0.70%/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	809,081.26	699,211.92

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提，计算方法如下：

H＝E×0.20%/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。

7.4.4.3 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
中国农业银行股份有限公司	189,034.04	90,532.06	570,479.29	95,542.54

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

7.4.5.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018-12-20	2019-01-18	认购新发证券	100.00	100.00	1,260	126,000.00	126,000.00	
113525	台华转债	2018-12-19	2019-01-11	认购新发证券	100.00	100.00	13,490	1,349,000.00	1,349,000.00	

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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293,039,163.88元，属于第二层次的余额为人民币49,644,485.80元，属于第三层次余额为人民币0.00元（于