

富国两年期理财债券型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年03月29日

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责任。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月27日复核了本报告内容,保证基金资产净值、份额计算、净值核算、基金费用计提、基金申购赎回等符合基金合同约定,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

1.2 基金简介

基金名称:富国两年期理财债券
基金代码:002898

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
基金合同生效日期:2016年12月10日

2.3 基金管理人相关信息

名称:富国基金管理有限公司
法定代表人:陈鹏

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号202室

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号202室

客服电话:4008880888

网址:www.fund100.com

基金年度报告备置地点:上海市浦东新区富国路99号富国银行大厦

注:信息披露网址为以上至本报告期末信息

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标
2018年
2017年
2016年12月31日/2016年12月31日

本期利润总额 350,556,639.86
本期净利润 350,556,639.86

本期基金份额净值增长率 3.07%
期末基金份额净值 1.003

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

期末基金份额净值 1.003
期末基金份额净值增长率 3.07%

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

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) 富国两年期理财债券A级
前段 份额净值增长率 业绩比较基准收益率

过去三个月 0.08% 0.04% 0.79% 0.01% 0.13% 0.02%

过去六个月 15.7% 0.02% 1.56% 0.01% 0.01% 0.02%

过去一年 3.17% 0.02% 3.10% 0.01% 0.07% 0.02%

自基金合同生效以来至今 7.41% 0.04% 6.40% 0.01% 0.58% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来富国两年期理财债券A级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的比较



注:2016年按实际存续期间计算

3.3 过去三年基金的利润分配情况

3.3.1 富国两年期理财债券A级
2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.2 富国两年期理财债券C级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.3 富国两年期理财债券B级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.4 富国两年期理财债券E级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.5 富国两年期理财债券D级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.6 富国两年期理财债券F级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.7 富国两年期理财债券G级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.8 富国两年期理财债券H级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.9 富国两年期理财债券I级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.10 富国两年期理财债券J级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.11 富国两年期理财债券K级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.12 富国两年期理财债券L级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.13 富国两年期理财债券M级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

3.3.14 富国两年期理财债券N级

2016年
2017年
2018年

2016年 0.0000
2017年 0.0000
2018年 0.0000

注:2016年按实际存续期间计算

富国两年期理财债券型证券投资基金

单位:人民币元

2018年 0.430 430,120,029.17
2017年 0.270 270,081,563.61

2016年 - -
2015年 0.700 700,211,512.28

注:本基金合同生效日为2016年12月10日

(2)富国两年期理财债券C级

单位:人民币元

2018年 0.400 18,460.81
2017年 0.200 9,226.00

2016年 - -
2015年 0.600 27,676.41

注:本基金合同生效日为2014年12月1日

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1998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第一家基金管理公司之一。公司于2001年9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手续,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的中外合资基金公司,第一家中外合资的基金管理公司。

目前,公司注册资本25.2亿元人民币,股东为:海通证券股份有限公司、上海农商银行有限公司、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、广州设有分公司,并全资拥有两家子公司: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、ODI、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金业务。

截至2018年12月31日,本基金管理人共管理富国天惠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、富国中证智能产业指数证券投资基金(LOP)、富国中证红利增强型证券投资基金、富国中证环保行业指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券型证券投资基金、富国目标收益一年期债券型证券投资基金、富国中债1-3年国开行债券型证券投资基金、富国中证10年期国债指数型开放式证券投资基金、富国全球科技互联互联网股票型证券投资基金(ODI)、富国鑫森稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金(FOF)、富国富源稳健市值基金等一百二十四只公募基金投资理财业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

王琛 曾任上海证券有限责任公司资产管理部副经理,2010年12月加入富国基金管理有限公司,2011年12月起担任富国天利增长债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起担任富国天惠精选成长混合型证券投资基金基金经理,2013年12月起担任富国天惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2014年12月起担任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2015年12月起担任富国中证红利增强型证券投资基金基金经理,2016年12月起担任富国中证智能产业指数证券投资基金基金经理,2017年12月起担任富国中证环保行业指数证券投资基金基金经理,2018年12月起担任富国鑫森稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金基金经理,2019年12月起担任富国富源稳健市值基金基金经理,具有基金从业资格。

智翰松 曾任平安证券有限责任公司资产管理部副经理,2010年12月加入富国基金管理有限公司,2011年12月起担任富国天利增长债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起担任富国天惠精选成长混合型证券投资基金基金经理,2013年12月起担任富国天惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2014年12月起担任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2015年12月起担任富国中证红利增强型证券投资基金基金经理,2016年12月起担任富国中证智能产业指数证券投资基金基金经理,2017年12月起担任富国中证环保行业指数证券投资基金基金经理,2018年12月起担任富国鑫森稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金基金经理,2019年12月起担任富国富源稳健市值基金基金经理,具有基金从业资格。

陈晓斌 曾任上海证券有限责任公司资产管理部副经理,2010年12月加入富国基金管理有限公司,2011年12月起担任富国天利增长债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起担任富国天惠精选成长混合型证券投资基金基金经理,2013年12月起担任富国天惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2014年12月起担任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2015年12月起担任富国中证红利增强型证券投资基金基金经理,2016年12月起担任富国中证智能产业指数证券投资基金基金经理,2017年12月起担任富国中证环保行业指数证券投资基金基金经理,2018年12月起担任富国鑫森稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金基金经理,2019年12月起担任富国富源稳健市值基金基金经理,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,离任日期为公司确定的解聘日期,所有基金任职日期均以基金公告为准

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定

3、公司于2019年2月19日发布公告,智翰松自2019年2月18日起不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵信情况的说明

本基金管理人根据相关法律法规、中国证监会及基金合同的规定,恪守基金管理人职责和基金合同约定的投资范围,按照基金合同及招募说明书约定的投资范围、投资策略、投资限制,建立健全内部风险控制、监察稽核、信息披露等管理制度,严格遵守基金合同及招募说明书中的各项投资限制,确保基金资产的安全,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规,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、执行评估等投资管理环节,实行事前控制、事中监控、事后反馈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。

事前控制主要包括:1、一级市场,通过标准化的办公流程,对关联方申购、价格公允性判断及证券公平分配等关键环节进行控制;2、二级市场,通过交易系统的集中控制,交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作流程进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相似投资标的的交易方向、市场中的价格、银行间市场交易价格的公允性评估等,1、将主要投资标的的同一反向交易列明限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;2、对同一反向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理;3、同一基金系统管理的不同组合,对同一投资标的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,确保公平交易制度的执行。

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,以及不同时间段同一(1日、3日、5日)的同向交易和反向交易的合理性分析评估,1、通过公平交易的事后分析评估系统,对涉及公平交易的组合进行分析评估,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、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;2、若发现异常交易行为,风险管理部将要求相关当事人做出合理解释,并依据要求上报相关监管机构;3、季度公平交易专项分析报告按规定提交基金经理和投资部签字,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,在同向交易分析方面,公司采集连续四个季度,不同时间段同一(1日内、3日内、5日内)的同向交易分析,在假设同向交易价差为净零及96%的置信水平下,对同向交易价差进行分布图检验并对检验结果进行进一步分析。分析结果显示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

报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的投资组合在交易所公开竞价同向反向交易的控制方面,报告期内组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

2018年我国经济各个领域深刻演绎着以“去杠杆”为主的宏观政策效果,在1年多时间里各种极端现象不断上演,2018年银行表外融资遭受了断崖式的下降,非标融资供需双重受限,一方面银行受到监管部门的全力压盘,另一方面受到严格债务规模约束的约束。央行仅仅是在货币财政政策方面给予了一定程度的宽松;包括定向降准、MLF增量等,在外汇波动得到缓解,外汇占款有了进一步下降的情况下,使得债券资产有所提升。宽信政策不断调整之下,启动了债券资产的快速上行。进入1月,美联储加息的正式成型导致了我国一系列的贸易摩擦的升级;由此引发了市场预期的悲观和央行降准,进一步与美联储货币政策相背离,风险资产的环境下,再一次带动了债券和权益的进一步下行,此后,政府层面开始意识到了“内外风险叠加”的严重性,不但央行再一次降准,而且一系列带有转弱意味的“稳杠杆”的财政加杠杆、资管政策开始启动,并且结合各个政府部门,对于信贷投放、信贷派生,给予了全方位的制衡和扶持,意图打通信贷传导机制。

对于富国基金而言,在2018年,本基金管理人严格遵照《企业会计准则》、中国证监会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《中国证券投资基金估值业务指导意见》等法律法规,对基金持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人估值人员进行,基金托管人复核完成,并与基金托管人进行账务核对,基金管理人复核无误后,由基金管理人对外公布。

4.5 报告期内基金净值增长情况的说明

本基金报告期内净值共进行1次收益结转。于2018年11月27日公告每10份A级基金份额派发红利4.03元,每10份C级基金份额派发红利4.04元;A级基金份额累计派发红利43012992.17元,C级基金份额累计派发红利4845.81元。本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人符合基金法律法规及基金合同约定的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.9 报告期内基金管理人履行信息披露义务的说明

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行信息披露义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.10 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.11 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.12 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.13 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.14 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.15 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.16 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.17 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.18 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.19 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.20 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.21 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.22 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.23 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.24 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.25 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.26 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.27 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.28 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.29 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.30 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.31 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.32 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

4.33 报告期内基金管理人履行其他义务的说明

本基金管理人报告期内严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规,基金合同及基金托管协议,履行其他义务,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

富国两年期理财债券型证券投资基金

单位:人民币元

2018年 0.430 430,120,029.17
2017年 0.270 270,081,563.61

2016年 - -
2015年 0.700 700,211,512.28

注:本基金合同生效日为2016年12月10日

(2)富国两年期理财债券C级

单位:人民币元

2018年 0.400 18,460.81
2017年 0.200 9,226.00

2016年 - -
2015年 0.600 27,676.41

注:本基金合同生效日为2014年12月1日

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1998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第一家基金管理公司之一。公司于2001年9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手续,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的中外合资基金公司,第一家中外合资的基金管理公司。

目前,公司注册资本25.2亿元人民币,股东为:海通证券股份有限公司、上海农商银行有限公司、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、广州设有分公司,并全资拥有两家子公司: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