# 富国兴利增强债券型发起式证券投资基金

## 2019年第二季度报告

| | |
|---|---|
| 基金管理人： | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人： | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告送出日期： | 2019年07月18日 |

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国兴利增强债券 |
| 基金主代码 | 005121 |
| 交易代码 | 005121 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年09月20日 |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 40,671,914.19 |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2019年04月01日-2019年06月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 347,782.32 |
| 2.本期利润 | -216,430.28 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0053 |
| 4.期末基金资产净值 | 42,813,239.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0526 |

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。

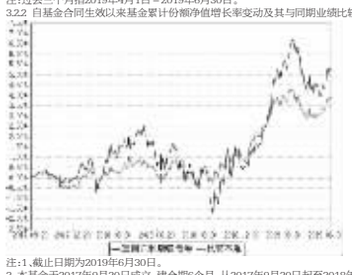
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | -0.51% | 0.26% | -0.27% | 0.14% | -0.24% | 0.12% |

注：过去三个月指2019年4月1日－2019年6月30日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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6月30日。

2、本基金于2017年9月20日成立，建仓期6个月，从2017年9月20日起至2018年3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。

§4 管理人报告

4.1 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 | | |
| 黄纪亮 | 本基金基金经理 | 2017-09-20 | - | 11 | 硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员；2012年11月至2013年2月任富国基金管理有限公司债券研究员；2013年2月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理，2014年3月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金，富国天利增长债券投资基金基金经理，2014年6月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理，2016年8月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2016年9月起任富国产业债债券型证券投资基金，富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，2017年8月起任富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年9月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国睿利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国稳利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国丰盛纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年7月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金，富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金，富国稳利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年9月起任富国鑫利纯债债券型证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；兼任固定收益策略研究部总经理、固定收益投资部总经理。具有基金从业资格。 |
| 王乐乐 | 本基金基金经理 | 2017-10-09 | - | 9 | 博士，自2010年6月至2011年11月在上海证券有限责任公司任研究员；自2011年11月至2012年6月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自2012年7月至2015年5月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划部队负责人；自2015年5月加入富国基金管理有限公司，2015年8月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016年10月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年6月起任富国中证工业40指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年11月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |
| 陈斯扬 | 本基金基金经理 | 2018-04-02 | - | 6 | 硕士，自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员，投资经理；2016年10月加入富国基金管理有限公司，自2016年10月至2018年3月任投资经理，2018年3月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国睿利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国丰利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年6月起任富国稳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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国兴利增强债券型发起式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》、《富国兴利增强债券型发起式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，以期为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为-0.51%，同期业绩比较基准收益率为-0.27%

4.6 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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 8,518,766.76 | 16.94 |
| | 其中：股票 | 8,518,766.76 | 16.94 |
| 2 | 固定收益投资 | 40,797,278.70 | 81.14 |
| | 其中：债券 | 40,797,278.70 | 81.14 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 188,553.24 | 0.38 |
| 7 | 其他资产 | 776,206.51 | 1.54 |
| 8 | 合计 | 50,280,805.21 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 81,990.00 | 0.19 |
| B | 采矿业 | 313,965.20 | 0.73 |
| C | 制造业 | 4,474,363.70 | 10.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 475,598.80 | 1.11 |
| E | 建筑业 | 28,211.00 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | 301,361.34 | 0.70 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 441,657.00 | 1.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 588,711.92 | 1.38 |
| J | 金融业 | 662,688.80 | 1.55 |
| K | 房地产业 | 808,432.40 | 1.89 |
| L | 租赁和商务服务业 | 83,685.40 | 0.20 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 34,088.00 | 0.08 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 48,501.40 | 0.11 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 85,325.80 | 0.20 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 85,476.00 | 0.20 |
| S | 综合 | 4,710.00 | 0.01 |
| | 合计 | 8,518,766.76 | 19.90 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601288 | 农业银行 | 38,500 | 138,600.00 | 0.32 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 16,900 | 125,736.00 | 0.29 |
| 3 | 000876 | 新希望 | 7,100 | 123,327.00 | 0.29 |
| 4 | 002146 | 荣盛发展 | 13,000 | 122,070.00 | 0.29 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 5,600 | 114,128.00 | 0.27 |
| 6 | 000550 | 江铃汽车 | 5,700 | 110,523.00 | 0.26 |
| 7 | 600585 | 海螺水泥 | 2,500 | 103,750.00 | 0.24 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 5,700 | 102,030.00 | 0.24 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 7,280 | 98,644.00 | 0.23 |
| 10 | 000338 | 潍柴动力 | 7,500 | 92,175.00 | 0.22 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 34,794,333.50 | 81.27 |
| | 其中：政策性金融债 | 32,759,333.50 | 76.52 |
| 4 | 企业债券 | 5,983,100.00 | 13.97 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 19,845.20 | 0.05 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 40,797,278.70 | 95.29 |

5.5 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债券投资明细

| 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 | 108901 | 农发1801 | 129,000 | 12,912,900.00 | 30.16 |
| 2 | 018007 | 国开1801 | 82,050 | 8,276,383.50 | 19.33 |
| 3 | 108603 | 国开1804 | 60,000 | 6,003,600.00 | 14.02 |
| 4 | 108602 | 国开1704 | 45,000 | 4,545,450.00 | 10.62 |
| 5 | 136253 | 16中油03 | 30,000 | 2,988,300.00 | 6.98 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以降低债券仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 4,783.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 771,423.23 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 776,206.51 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 41,118,638.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 166,021.62 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 612,746.42 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 40,671,914.19 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,002,250.23 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,002,250.23 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 24.59 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数（份） | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,002,250.23 | 24.59 | 10,002,250.23 | 24.59 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,002,250.23 | 24.59 | 10,002,250.23 | 24.59 | 3年 |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019-04-01至2019-06-30 | 20,001,250.23 | - | - | | 20,001,250.23 | 49.18% |
| | 2 | 2019-04-01至2019-06-30 | 19,999,000.00 | - | - | | 19,999,000.00 | 49.17% |
| 产品特有风险 | | | | | | | | |
| 本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。 | | | | | | | | |

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国兴利增强债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国兴利增强债券型发起式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、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

10.3 查阅方式

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：http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司

2019年07月18日

# 富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金

## 2019年第二季度报告

| | |
|---|---|
| 基金管理人： | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人： | 中国光大银行股份有限公司 |
| 报告送出日期： | 2019年07月18日 |

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国中债-1-3年国开行债券指数 |
| 基金主代码 | 006409 |
| 基金运作方式 | 契约型，开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年09月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,757,782,107.26 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。<br>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 中债-1-3年国开行债券指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相近的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国中债-1-3年国开行债券指数A | 富国中债-1-3年国开行债券指数C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006409 | 006410 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份） | 3,757,753,508.74 | 28,598.52 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | A级 报告期（2019年04月01日-2019年06月30日） | C级 报告期（2019年04月01日-2019年06月30日） |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 28,889,733.29 | 237.91 |
| 2.本期利润 | 19,091,356.20 | 166.01 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0063 | 0.0058 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,808,913,066.52 | 28,958.58 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0136 | 1.0126 |

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 本报告期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）A级

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 0.59% | 0.03% | 0.62% | 0.03% | -0.03% | 0.00% |

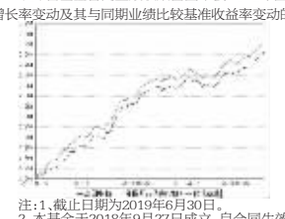
（2）C级

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 0.50% | 0.04% | 0.62% | 0.03% | -0.12% | 0.01% |

注：过去三个月指2019年4月1日－2019年6月30日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

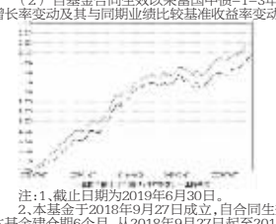
（1）自基金合同生效以来富国中债-1-3年国开行债券指数A基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2019年6月30日。

2、本基金于2018年9月27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2018年9月27日起至2019年3月26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中债-1-3年国开行债券指数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6月30日。

2、本基金于2018年9月27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2018年9月27日起至2019年3月26日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 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 | | |
| 武磊 | 本基金基金经理 | 2018-09-27 | - | 8 | 博士，2011年7月至2012年3月任华泰联合证券有限责任公司研究员；2012年4月至2013年7月任华泰证券股份有限公司投资经理；2013年8月至2014年10月任国泰君安证券股份有限公司资本市场部董事；2014年11月至2016年12月任上海国泰君安证券资产管理有限公司投资经理；2016年12月加入富国基金管理有限公司，2017年3月起任富国产业债债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起任富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国隆利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年7月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金（LOF）（原：富国新天锋定期开放债券型证券投资基金）基金经理；2018年9月起任富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年3月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理，2019年4月起任富国中债-5年农发行债券指数证券投资基金基金经理，兼任固定收益投资部副定收益投资助理。具有基金从业资格。 |
| 吴旅忠 | 本基金基金经理 | 2019-04-30 | - | 11 | 硕士，曾任国泰君安证券固定收益证券投资部投资经理；2015年03月至2018年10月任中银基金管理有限公司固定收益证券投资部基金经理；2018年10月加入富国基金管理有限公司，自2019年2月起任富国天时货币市场基金、富国欣宝交易型货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金基金经理，自2019年4月起任富国中债-1-3年国开行债券指数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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中债-1-3年国开行债券指数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》、《富国中债-1-3年国开行债券指数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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、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。

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。

4.3.2 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未出现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 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为-2.87%，同期业绩比较基准收益率为-3.79%

4.7 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,752,400,740.18 | 81.31 |
| | 其中：普通股 | 1,752,400,740.18 | 81.31 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 345,947,611.33 | 16.05 |
| 8 | 其他资产 | 56,798,073.81 | 2.64 |
| 9 | 合计 | 2,155,146,425.32 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

金额单位：元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 中国香港 | 1,650,790,833.00 | 79.65 |
| 美国 | 101,609,907.18 | 4.90 |
| 合计 | 1,752,400,740.18 | 84.55 |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 非日常生活消费品 | 416,873,619.96 | 20.11 |
| 房地产 | 374,633,528.49 | 18.08 |
| 医疗保健 | 271,914,112.87 | 13.12 |
| 金融 | 168,998,994.05 | 8.15 |
| 通信服务 | 133,665,894.00 | 6.45 |
| 日常消费品 | 107,362,291.88 | 5.18 |
| 工业 | 97,388,179.01 | 4.70 |
| 公用事业 | 69,793,658.25 | 3.37 |
| 原材料 | 64,832,103.16 | 3.13 |
| 信息技术 | 44,304,867.59 | 2.14 |
| 能源 | 2,633,490.92 | 0.13 |
| 合计 | 1,752,400,740.18 | 84.55 |

5.4 报告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及存托凭证投资明细

金额单位：元

| 序号 | 公司名称（英文） | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 融创中国控股 | 1918 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2754000 | 93,027,211.78 | 4.49 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 260400 | 80,767,777.41 | 3.90 |
| 3 | CHINA MERCHANTS BANK-H | 招商银行 | 3968 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2021000 | 69,245,031.90 | 3.34 |
| 4 | GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H | 广州药业股份 | 874 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2200000 | 68,217,633.00 | 3.29 |
| 5 | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 恒基地产 | 12 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1782000 | 67,483,204.87 | 3.26 |
| 6 | CIMC ENRIC HOLDINGS LTD | 中集安瑞科 | 3899 | 香港