富国可转换债券证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019年06月30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
送出日期：	2019年08月27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。本半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8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§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	366,480,779.27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	贺俏
	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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现

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	报告期(2019年01月01日至2019年06月30日)
本期已实现收益	60,997,081.97
本期利润	67,947,976.54
加权平均基金份额本期利润	0.1444
本期基金份额净值增长率	11.12%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4691
期末基金资产净值	538,393,149.02
期末基金份额净值	1.469

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
过去一个月	2.23%	0.80%	1.81%	0.53%	0.42%	0.27%
过去三个月	-2.72%	0.68%	-1.76%	0.66%	-0.96%	0.02%
过去六个月	11.12%	0.76%	11.78%	0.71%	-0.66%	0.05%
过去一年	7.54%	0.70%	10.39%	0.61%	-2.85%	0.09%
过去三年	-1.34%	0.73%	13.06%	0.50%	-14.40%	0.23%
自基金合同生效日起至今	46.90%	1.01%	16.87%	0.95%	30.03%	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：

benchmarkt = 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]；

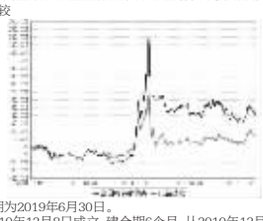
其中，t=1,2,3,…,T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

其中，T=2,3,4,…；∏Tt=1(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)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2019年6月30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。

§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2019年6月30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一百三十七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	-	7	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、富国颐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，2019年3月起任富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金、富国科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
张明凯	本基金基金经理	2019-03-19	-	5.9	硕士，自2009年6月至2013年6月任南京银行金融市场部信用研究员；2013年7月至2018年2月任鑫元基金管理有限公司投资部资深信用研究员、基金经理；2018年2月加入富国基金管理有限公司，自2019年3月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金、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、富国收益增强债券型证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国天利稳健配置混合型证券投资基金、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，自2019年4月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金、富国金融债债券型证券投资基金、富国中债1-5年农发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 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、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。

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 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

上半年权益与债券市场出现较大幅度波动，虽然1季度末信用宽松成果渐显，经济出现显著好转迹象，但其持续性仍然存疑，且由于房价有重拾升势的风险，央行货币政策边际收紧。对于外部因素而言，全球经济增长出现停滞，各国无风险利率水平降至数年新低，虽然中美贸易和谈出现缓和，但不确定性仍然巨大。从后续的结果来看，4-5月份经济数据迅速回落，中美贸易再出波折。基于对基本面的分析，本组合认为上半年权益市场先上后下，出现趋势性机会的概率较低，故在仓位上根据市场波动做出相应调整，并未持续维持一定水平不变。在具体标的选择方面，在信用风险可控的基础上，更关注绝对价格水平因素，策略上将转债分为三类标的，分别为长期持有型、流动性管理型和聆段性博弈型，对于长期持有型主要考虑长期价值，在价格合理区间果断介入，中间不会做频繁调整，对于流动性管理型主要是应对产品规模的变动，以市场中流动性较好的标的为调节目标，对于聆段性博弈型标的尽量做到分散化布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，本基金份额净值为1.469元；份额累计净值为1.469元；本报告期，本基金份额净值增长率为11.12%，同期业绩比较基准收益率为11.78%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年市场预判，我们认为基本面方面仍存在较大不确定性。外部性方面，中美贸易战已成长期性因素，全球性对于再度陷入衰退的担忧有上升迹象，不过与08年相比，本次各国央行出手速度更快，也更果决，可能阶段性上这种经济全面衰退的预期会在政策对冲后有缓和的可能。在内部性方面，复杂程度进一步上升，一方面长期去杠杆的改革目标仍未改变，另一方面经济下行压力仍存，稳增长重要性也不能下调。在内外部环境共同作用下，我们认为政策宽松的逻辑仍然通畅，只是财政还是货币主导存在不确定性。以历史为鉴，财政政策的宽松必然需要货币政策辅助，但这种主次性会对市场预期造成一定边际影响，如果财政为主则对权益更为有利，债券利率下行空间可能有限，但如果财政政策效果一般，仍需货币主导，则债券利率下行空间较大，权益市场则需要稳增长政策见效后可能才有趋势性机会。权益板块方面，站在长周期角度，我们认为未来科技将接棒08年以来消费板块的主导行情，有望获得显著超额收益，具体而言相对看好以5G产业链为核心的，具有自主开发能力的子行业龙头，同时对于具有潜在成长性的标的也需要提高重视程度。债券方面，信用分化仍在持续，预计内在资质的差异将进一步体现在收益率水平上，信用风险定价将更加有效，故在投资选择上需要更为慎重，以控风险为主，同时考虑到政策的舒适度，久期优于杠杆，杠杆优于信用下沉。

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2019年1月1日至2019年6月30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 托管人对本半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半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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 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：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末（2019年06月30日）	上年度末（2018年12月31日）
资 产：		
银行存款	1,840,479.93	189,034.04
结算备付金	2,771,937.34	2,078,751.69
存出保证金	280,898.14	92,813.43
交易性金融资产	528,241,418.89	342,683,649.68
其中：股票投资	22,992,885.00	12,172,870.42
基金投资	-	-
债券投资	505,248,533.89	330,510,779.26
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	21,411,838.22	14,755,066.11
应收利息	1,003,631.08	1,009,274.50
应收股利	-	-
应收申购款	14,887.31	16,257.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	555,565,090.91	366,824,847.10
负债和所有者权益	本期末（2019年06月30日）	上年度末（2018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	8,000,000.00	-
应付证券清算款	8,222,069.20	12,566,772.42
应付赎回款	255,785.02	169,798.48
应付管理人报酬	336,144.49	207,879.57
应付托管费	96,041.27	59,394.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	146,845.00	23,961.91
应交税费	30,060.87	31,353.33
应付利息	-	-3,398.70
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	84,996.04	170,038.68
负债合计	17,171,941.89	13,225,799.84
所有者权益：		
实收基金	366,480,779.27	267,569,451.22
未分配利润	171,912,369.75	86,029,596.04
所有者权益合计	538,393,149.02	353,599,047.26
负债和所有者权益总计	555,565,090.91	366,824,847.10

注：报告截止日2019年06月30日，基金份额净值1.469元，基金份额总额366,480,779.27份。

6.2 利润表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期（2019年01月01日至2019年06月30日）	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）
一、收入	72,000,062.72	-58,606,674.17
1.利息收入	2,753,736.99	2,303,738.49
其中：存款利息收入	239,654.90	153,252.04
债券利息收入	2,313,400.48	2,111,991.39
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	200,681.61	38,495.06
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	61,977,143.48	-32,214,213.69
其中：股票投资收益	6,843,820.10	-8,880,069.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	54,957,409.47	-23,562,102.92
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	175,913.91	227,958.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,950,894.57	-28,795,329.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	318,287.68	99,130.64
减：二、费用	4,052,086.18	4,298,726.30
1. 管理人报酬	2,401,203.25	1,556,638.51
2. 托管费	686,058.04	444,753.83
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	669,173.10	523,792.29
5. 利息支出	179,541.19	1,631,546.53
其中：卖出回购金融资产支出	179,541.19	1,631,546.53
6. 税金及附加	3,555.26	5,150.73
7. 其他费用	112,555.34	136,844.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	67,947,976.54	-62,905,400.47
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	67,947,976.54	-62,905,400.47

6.3 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：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期（2019年01月01日至2019年06月30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）	267,569,451.22	86,029,596.04	353,599,047.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,947,976.54	67,947,976.54
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）	98,911,328.05	17,934,797.17	116,846,125.22
其中：1.基金申购款	940,185,466.37	426,002,347.49	1,366,187,813.86
2.基金赎回款	-841,274,138.32	-408,067,550.32	-1,249,341,688.64
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）	366,480,779.27	171,912,369.75	538,393,149.02
项目	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30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）	-	-62,905,400.47	-62,905,400.47
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）	-46,007,022.09	-6,190,361.95	-52,197,384.04
其中：1.基金申购款	230,478,878.80	132,288,094.01	362,766,972.81
2.基金赎回款	-276,485,900.89	-138,478,455.96	-414,964,356.85
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）	205,690,887.63	75,261,981.04	280,952,868.67

注：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2019年1月1日至2019年6月30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 托管人对本半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半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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 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：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末（2019年06月30日）	上年度末（2018年12月31日）
资 产：		
银行存款	1,840,479.93	189,034.04
结算备付金	2,771,937.34	2,078,751.69
存出保证金	280,898.14	92,813.43
交易性金融资产	528,241,418.89	342,683,649.68
其中：股票投资	22,992,885.00	12,172,870.42
基金投资	-	-
债券投资	505,248,533.89	330,510,779.26
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	21,411,838.22	14,755,066.11
应收利息	1,003,631.08	1,009,274.50
应收股利	-	-
应收申购款	14,887.31	16,257.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	555,565,090.91	366,824,847.10
负债和所有者权益	本期末（2019年06月30日）	上年度末（2018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	8,000,000.00	-
应付证券清算款	8,222,069.20	12,566,772.42
应付赎回款	255,785.02	169,798.48
应付管理人报酬	336,144.49	207,879.57
应付托管费	96,041.27	59,394.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	146,845.00	23,961.91
应交税费	30,060.87	31,353.33
应付利息	-	-3,398.70
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	84,996.04	170,038.68
负债合计	17,171,941.89	13,225,799.84
所有者权益：		
实收基金	366,480,779.27	267,569,451.22
未分配利润	171,912,369.75	86,029,596.04
所有者权益合计	538,393,149.02	353,599,047.26
负债和所有者权益总计	555,565,090.91	366,824,847.10

注：报告截止日2019年06月30日，基金份额净值1.469元，基金份额总额366,480,779.27份。

6.2 利润表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期（2019年01月01日至2019年06月30日）	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）
一、收入	72,000,062.72	-58,606,674.17
1.利息收入	2,753,736.99	2,303,738.49
其中：存款利息收入	239,654.90	153,252.04
债券利息收入	2,313,400.48	2,111,991.39
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	200,681.61	38,495.06
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	61,977,143.48	-32,214,213.69
其中：股票投资收益	6,843,820.10	-8,880,069.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	54,957,409.47	-23,562,102.92
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	175,913.91	227,958.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,950,894.57	-28,795,329.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	318,287.68	99,130.64
减：二、费用	4,052,086.18	4,298,726.30
1. 管理人报酬	2,401,203.25	1,556,638.51
2. 托管费	686,058.04	444,753.83
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	669,173.10	523,792.29
5. 利息支出	179,541.19	1,631,546.53
其中：卖出回购金融资产支出	179,541.19	1,631,546.53
6. 税金及附加	3,555.26	5,150.73
7. 其他费用	112,555.34	136,844.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	67,947,976.54	-62,905,400.47
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	67,947,976.54	-62,905,400.47

6.3 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：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期（2019年01月01日至2019年06月30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）	267,569,451.22	86,029,596.04	353,599,047.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,947,976.54	67,947,976.54
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）	98,911,328.05	17,934,797.17	116,846,125.22
其中：1.基金申购款	940,185,466.37	426,002,347.49	1,366,187,813.86
2.基金赎回款	-841,274,138.32	-408,067,550.32	-1,249,341,688.64
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）	366,480,779.27	171,912,369.75	538,393,149.02
项目	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30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）	-	-62,905,400.47	-62,905,400.47
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）	-46,007,022.09	-6,190,361.95	-52,197,384.04
其中：1.基金申购款	230,478,878.80	132,288,094.01	362,766,972.81
2.基金赎回款	-276,485,900.89	-138,478,455.96	-414,964,356.85
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）	205,690,887.63	75,261,981.04	280,952,868.67

注：报告期末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。

6.4.8.2.2 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。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国可转换债券证券投资基金(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[2010]1452号文《关于核准富国可转换债券证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2010年12月8日正式生效，首次设立募集规模为4,265,146,930.09份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金将投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所投资的固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、次级债、资产证券化产品、可转债（含分离交易可转债）和回购等；本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券，但二级市场的股票仅限于传统可转债对应的标的股票以及分离交易可转债发行人发行的股票。

本基金的投资组合比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%，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%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于可转债（含分离交易可转债）的资产比例不低于固定收益类资产的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会