富国金利定期开放混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:	2018年08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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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2018年1月1日起至2018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	213,718,915.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	富国金利定期开放混合A	富国金利定期开放混合C
下属两级基金的交易代码	005129	005130
报告期末下属两级基金的份额总额	200,966,538.14份	12,752,377.50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,升动态调整组合,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

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楼 托管人住所

§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

(1)富国金利定期开放混合A

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期已实现收益	2,204,613.35
本期利润	1,614,807.80
加权平均基金份额本期利润	0.0080
本期基金份额净值增长率	0.80%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0087
期末基金资产净值	202,723,206.20
期末基金份额净值	1.0087

(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	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期已实现收益	114,321.85
本期利润	76,968.71
加权平均基金份额本期利润	0.0060
本期基金份额净值增长率	0.60%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0066
期末基金资产净值	12,836,809.80
期末基金份额净值	1.0066

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
过去一个月	-0.28%	0.07%	-1.28%	0.25%	1.00%	-0.18%
过去三个月	0.13%	0.08%	-1.22%	0.23%	1.35%	-0.15%
过去六个月	0.80%	0.06%	-0.92%	0.23%	1.72%	-0.17%
自基金合同生效起至今	0.87%	0.06%	-0.94%	0.23%	1.81%	-0.17%

(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
过去一个月	-0.31%	0.07%	-1.28%	0.25%	0.97%	-0.18%
过去三个月	0.03%	0.08%	-1.22%	0.23%	1.25%	-0.15%
过去六个月	0.60%	0.06%	-0.92%	0.23%	1.52%	-0.17%
自基金合同生效起至今	0.66%	0.06%	-0.94%	0.23%	1.60%	-0.17%

注:本基金业绩比较基准为: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%

中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成分股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

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 = 80%* [中债综合全价指数t/中债综合全价指数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;

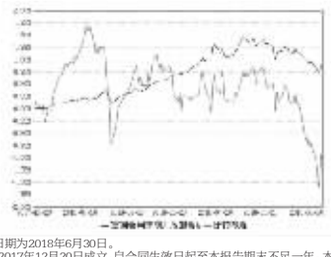
期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

benchmarkT =[ΠTt=1(1+benchmark)]-1

其中,T=2,3,4, ···;ΠTt=1(1+benchmark)表示t日至T日的(1+benchmark)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

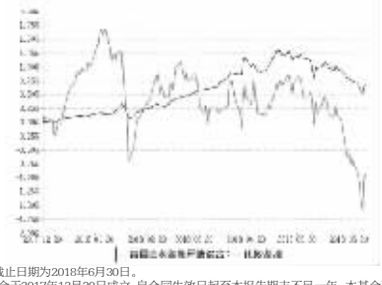
(1)自基金合同生效以来富国金利定期开放混合A基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为2018年6月30日。

2、本基金于2017年12月20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6月30日。

2、本基金于2017年12月20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。

§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。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理富国天惠远洋配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选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)、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题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、富国天丰强化收益债券型证券投资基金(LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国天益深证成指分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国景钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国沪深300指数增强型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)、富国弘利纯债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、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金、富国景利纯债债券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、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国金利定期开放混合型证券投资基金、富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金、富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金、富国成长优选三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、富国军工主题混合型证券投资基金、富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国转型机遇混合型证券投资基金、富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)等一百一十二只证券投资基金。

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 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

2018年上半年,大类资产呈现出债强股弱的格局,表面市场风险偏好明显下降。债券市场结束了近两年的熊市,走出一波牛市行情。一方面,上半年资金面开始出现改善,资金价格显著下行;另一方面,经济基本面减速以及超预期的贸易战因素使得市场风险偏好降低,无风险利率显著下降,同时也今货币政策继续缓和,降准和公开市场操作向市场投放充裕资金。上半年,中债新综合全价指数上涨2.17%。股票市场则大幅下跌,去年表现较好的价值股、金融和周期板块出现回调,相对业绩增速较高的医药板块表现较好。沪深300上半年下跌12.36%。本基金在力控风险前提下,审慎操作,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6月30日,本基金份额净值A级为1.0087元,C级为1.0066元;份额累计净值A级为1.00877元,C级为1.00666元;本报告期,本基金份额净值增长率A级为0.80%,C级为0.60%,同期业绩比较基准收益率A级为-0.92%,C级为-0.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,基本面的小幅减速和贸易摩擦不确定性影响,预计央行的货币政策将向偏宽松方向继续微调。“去杠杆、防风险”可能向“稳杠杆”转变,随着各项制度的落地,过去一段时间“严监管”的不确定因素逐渐消退,信用紧缩的格局也将得到一定程度纠偏。我们对债券市场整体乐观,但也需要看到,到利率下行依然有下边界,短期过于乐观的纠偏有矫枉过正的风险。如果说上半年依靠久期获利颇丰,下半年可能更多需要从票息上挖掘收益。股票方面,经过无风险利率的下行、股票估值相对修复,预计下半年股市表现不会太差,但暂缺乏整体行情的条件,一切还需看未来资易战的进展以及由此带来的国内自身改革的进度。结构上来看,更看好业绩增速稳定及未来成长性较好的行业。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,报告期内,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收益开支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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 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06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
资 产:		
银行存款	3,965,244.15	120,492,890.25
结算备付金	770,882.66	-
存出保证金	45,245.18	-
交易性金融资产	235,507,634.40	28,552,700.00
其中:股票投资	6,739,050.00	-
基金投资	-	-
债券投资	228,768,584.40	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	2,800,000.00	64,400,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,519,654.73	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	247,608,661.12	214,294,589.25
负债和所有者权益	本期末(2018年06月30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	27,656,000.00	-
应付证券清算款	3,779,636.48	347,506.85
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	177,524.95	64,421.19
应付托管费	35,504.99	12,884.23
应付销售服务费	4,229.41	1,537.49
应付交易费用	21,627.79	-
应交税费	19,464.62	-
应付利息	280,271.31	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	74,385.57	-
负债合计	32,048,645.12	426,349.76
所有者权益:		
实收基金	213,718,915.64	213,718,915.64
未分配利润	1,841,100.36	149,323.85
所有者权益合计	215,560,016.00	213,868,239.49
负债和所有者权益总计	247,608,661.12	214,294,589.25

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额净值1.00876元,基金份额总额213,718,915.64份。其中:富国金利定期开放混合A份额净值1.0087元,份额总额200,966,538.14份;富国金利定期开放混合C份额净值1.0066元,份额总额12,752,377.50份。

6.2 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06月30日

单位:人民币元

项 目	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)
一、收入	3,833,744.71
1.利息收入	5,613,402.59
其中:存款利息收入	1,349,509.39
债券利息收入	4,037,443.74
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	226,449.46
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-1,152,499.19
其中:股票投资收益	-551,868.24
基金投资收益	-
债券投资收益	-677,410.21
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	76,779.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-627,158.69
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	2,141,968.20
1. 管理人报酬	1,067,526.58
2. 托管费	213,505.29
3. 销售服务费	25,452.74
4. 交易费用	46,041.00
5. 利息支出	688,702.67
其中:卖出回购金融资产支出	688,702.67
6. 税金及附加	9,604.38
7. 其他费用	91,135.54
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,691,776.51
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,691,776.51

注:本基金合同生效日为2017年12月20日,无上年度同期对比数据。

6.3 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06月30日

单位:人民币元

项目	本期(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)	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)	-	1,691,776.51	1,691,776.51
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	1,841,100.36	215,560,016.00

注:本基金合同生效日为2017年12月20日,无上年度同期对比数据。

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《关于核准富国金利定期开放混合型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自2017年11月13日至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日正式生效。本基金为契约型开放式,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,折合213,703,487.95份基金份额。其中A类基金份额200,954,592.66份,C类基金份额12,748,895.29份。募集资金在募集期间产生的存款利息为人民币15,427.69元,折合15,427.69份基金份额。其中A类基金份额11,945.48份,C类基金份额3,482.21份。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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%

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露报表模板》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》、《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。

6.4.4.1 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6月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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;

本基金目前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;

(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。

6.4.4.4 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,金融资产将终止确认;

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) 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;

(5) 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。

6.4.4.5 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,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值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作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基