富国收益宝交易型货币市场基金 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

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	富国收益宝交易型货币		
场内简称	富国货币		
基金主代码	511900		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年11月24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	17,855,810,525.78份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015年12月9日		
下属三级基金的基金简称	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币H
下属三级基金场内简称	富国货币	富国货币	富国货币
下属三级基金的交易代码	001981	001982	511900
报告期末下属三级基金的份额总额（单位：份）	82,420,687.65	14,925,766,776.93	2,847,623,061.20

注：本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为"富国货币"，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元；场外基金份额（A类基金份额）简称为"富国收益宝交易型货币A级"，基金份额净值为1.00元；场外基金份额（B类基金份额）简称为"富国收益宝交易型货币B级"，基金份额净值为1.00元。

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 在投资管理过程中，基金管理人将基于"定性与定量相结合、保守与积极相结合"的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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）富国收益宝交易型货币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	1,455,861.92
本期利润	1,455,861.92
本期净值收益率	2.0804%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末基金资产净值	82,420,687.65
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
累计净值收益率	8.5092%

（2）富国收益宝交易型货币B

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	213,284,281.08
本期利润	213,284,281.08
本期净值收益率	2.2019%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末基金资产净值	14,925,766,776.93
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
累计净值收益率	8.5544%

（3）富国收益宝交易型货币H

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	75,888,200.18
本期利润	75,888,200.18
本期净值收益率	2.0791%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末基金资产净值	2,847,623,061.20
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
累计净值收益率	8.5346%

注：上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1）A级

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.3300%	0.0008%	0.0292%	0.0000%	0.3008%	0.0008%
过去三个月	1.0119%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	0.9234%	0.0011%
过去六个月	2.0804%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	1.9044%	0.0011%
过去一年	4.1411%	0.0010%	0.3549%	0.0000%	3.7862%	0.0010%
自基金合同生效日起至今	8.5092%	0.0024%	0.9236%	0.0000%	7.5856%	0.0024%

（2）B级

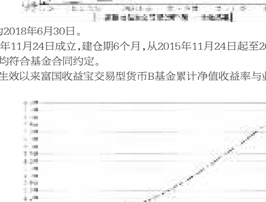
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3498%	0.0008%	0.0292%	0.0000%	0.3206%	0.0008%
过去三个月	1.0722%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	0.9837%	0.0011%
过去六个月	2.2019%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	2.0259%	0.0011%
过去一年	4.3917%	0.0010%	0.3549%	0.0000%	4.0368%	0.0010%
自基金合同生效日起至今	8.5544%	0.0035%	0.9236%	0.0000%	7.6308%	0.0035%

（3）H级

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.3298%	0.0008%	0.0292%	0.0000%	0.3006%	0.0008%
过去三个月	1.0111%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	0.9226%	0.0011%
过去六个月	2.0791%	0.0011%	0.1760%	0.0000%	1.9031%	0.0011%
过去一年	4.1392%	0.0010%	0.3549%	0.0000%	3.7843%	0.0010%
自基金合同生效日起至今	8.5346%	0.0025%	0.9236%	0.0000%	7.6110%	0.0025%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

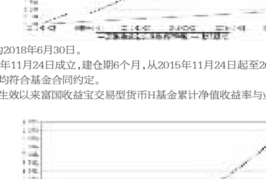
（1）自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币A基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2018年6月30日。

2、本基金于2015年11月24日成立，建仓期6个月，从2015年11月24日起至2016年5月23日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

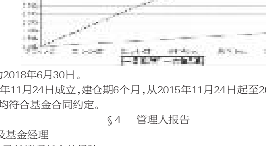
（2）自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币B基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2018年6月30日。

2、本基金于2015年11月24日成立，建仓期6个月，从2015年11月24日起至2016年5月23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）自基金合同生效以来富国收益宝交易型货币H基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2018年6月30日。

2、本基金于2015年11月24日成立，建仓期6个月，从2015年11月24日起至2016年5月23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盛灵活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、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、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、富国富钱包货币市场基金、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）、富国泓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、富国金利定期开放债券型证券投资基金、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、富国定期开放债券型证券投资基金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
万莉	本基金基金经理	2015-12-07	–	12	硕士，自2006年7月至2008年6月在广州银行任债券交易员；自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作，历任债券交易员、基金经理助理、基金经理；自2013年7月至2014年6月在中融基金（原道富基金）管理有限公司工作，任现金管理投资总监；自2014年6月加入富国基金管理有限公司，自2014年6月至2015年10月任固定收益投资部现金管理主管；2015年10月起任富国天时货币市场基金、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；2015年12月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理。现任固定收益策略研究部现金投资总监兼基金经理。具有基金从业资格。
张波	本基金基金经理	2018-01-29	–	6	硕士，2012年7月至2013年9月任上海耀之资产管理中心(有限合伙) 交易员；2013年9月至2017年10月历任鑫元基金管理有限公司交易员、交易副总监（主持工作）；2017年10月加入富国基金管理有限公司，2018年1月起任富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理，2018年6月起任富国富钱包货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。
王颀亮	本基金前任基金经理	2015-11-24	2018-01-30	8	硕士，曾任上海国利货币经纪有限公司经纪人，自2010年9月至2013年7月在富国基金管理有限公司任交易员；2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2014年8月至2016年6月任富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年4月至2016年1月任富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理，2015年4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，2015年4月至2016年6月任富国富钱包货币市场基金基金、富国天时货币市场基金基金经理；2015年11月至2018年1月任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理；2015年12月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2016年2月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2016年5月起任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基金经理，2016年8月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理，2016年12月起任富国两年期理财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

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国收益宝交易型货币市场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》、《富国收益宝交易型货币市场基金基金合同》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年上半年全球经济复苏势头得到延续，各经济体表现有所分化。美国经济增长稳固，在减税等政策刺激下，商业和消费者信心强劲，失业率创新低，在此基础上美联储加息两次。欧元区复苏步伐有所放缓，但各项数据尚处于较好状态，欧央行货币政策偏鹰派，对结束QE的方式更有耐心，加息时间也比市场预期要晚。日本经济则更显疲弱，日本央行下调通胀预期，继续维持宽松的货币政策。新兴市场国家经济增速继续快于发达国家。

上半年我国GDP同比增长6.8%，经济延续总体平稳的发展态势，新动能、新兴经济进一步发展。外部需求方面，进出口保持相对平稳；内部需求方面，固定资产投资和社会消费品零售总额增速小幅回落，对经济增长的贡献有所减弱。货币政策方面，央行保持稳健中性的货币政策，主要通过逆回购、中期借贷便利和准备金率调整市场流动性。元旦后央行宣布建立"临时准备金动用安排"工具，平滑春节取现需求导致的货币市场波动；上半年央行仅上调1次逆回购和中期借贷便利利率，幅度也仅为5BP；一二季度各实施了1次定向降准，缓解市场长期流动性缺口。上半年市场流动性边际上得到大幅改善。

上半年，基金管理人严格按照基金合同进行投资管理，在利率波动的环境中，优先保证基金资产的流动性和安全性，在此基础上提升资产配置，充分赚取骑乘和票息收益，根据市场情况调整资产配置比例、组合杠杆和剩余期限，从而较大地提升了货币基金抵御流动性风险的能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金每万份基金净收益A级为1.0786元，B级为1.1444元；每百份基金净收益H级为1.0780元；7日年化收益率A级为4.249%，B级为4.501%，H级为4.243%；本报告期，本基金份额净值收益率A级为2.0804%，B级为2.2019%，H级为2.0791%，同期业绩比较基准收益率A级为0.1760%，B级为0.1760%，H级为0.1760%

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2018年下半年，全球经济仍将保持复苏势头，不过在贸易保护主义升级和美联储货币政策持续收紧等的影响下，经济发展前景存在一定的下行风险。下半年国内经济在消费和新动能的支撑下将继续保持相对平稳增长，不过贸易摩擦、房地产与基建投资将是经济增长的隐忧。7月份国务院常务会议要求积极财政政策更加积极，稳健的货币政策要松紧适度，下半年市场流动性边际上的改善大概率得以延续。

基金管理人将继续保持谨慎操作的态度，在保证安全性和流动性的前提下，积极把握市场利率波动，合理调整资产配置比例、组合杠杆和剩余期限，尽量创造更多的超额收益。

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

本基金本报告期已按《基金合同》的约定："本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，计入投资者收益账户，投资者收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。"的条款进行收益分配。

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"）在富国收益宝交易型货币市场基金（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费用开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：富国收益宝交易型货币市场基金

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	7,649,121,006.76	5,660,634,061.82
结算备付金	1,200.00	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	9,806,533,972.64	6,356,431,937.60
其中：股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	9,806,533,972.64	6,356,431,937.60
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	3,411,077,596.60	2,274,009,327.43
应收证券清算款	–	–
应收利息	100,788,582.51	55,037,189.58
应收股利	–	–
应收申购款	3,159,861.71	939,260.31
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	20,970,682,220.22	14,347,051,776.74
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	3,106,274,555.35	804,283,427.26
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	3,930,377.91	2,847,420.53
应付托管费	1,122,965.11	813,548.73
应付销售服务费	802,372.22	904,860.54
应付交易费用	206,487.78	81,731.87
应交税费	74,453.24	–
应付利息	1,716,830.22	475,228.92
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	743,652.61	760,440.38
负债合计	3,114,871,694.44	810,166,658.23
所有者权益：		
实收基金	17,855,810,525.78	13,536,885,118.51
未分配利润	–	–
所有者权益合计	17,855,810,525.78	13,536,885,118.51
负债和所有者权益总计	20,970,682,220.22	14,347,051,776.74

注：报告截止日2018年06月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额17,855,810,525.78份，其中A级基金份额总额82,420,687.65份，其中B级基金份额总额14,925,766,776.93份，其中H级基金份额总额2,847,623,061.20份。

6.2 利润表

会计主体：富国收益宝交易型货币市场基金

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）	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
一、收入	340,248,797.11	133,828,705.58
1.利息收入	336,508,292.61	132,101,165.48
其中：存款利息收入	153,397,832.50	70,585,679.50
债券利息收入	145,669,489.28	50,749,047.87
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	37,440,970.83	10,766,438.11
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	3,740,504.50	1,727,540.10
其中：股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	3,740,504.50	1,727,540.10
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	–	–
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	49,620,453.93	28,946,113.02
1. 管理人报酬	18,827,534.71	10,144,507.81
2. 托管费	5,379,295.63	2,898,430.79
3. 销售服务费	5,153,368.65	8,628,918.56
4. 交易费用	–	450.00
5. 利息支出	19,977,457.68	7,042,724.67
其中：卖出回购金融资产支出	19,977,457.68	7,042,724.67
6. 税金及附加	35,966.73	–
7. 其他费用	246,830.53	231,081.19
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	290,628,343.18	104,882,592.56
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	290,628,343.18	104,882,592.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国收益宝交易型货币市场基金

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）	13,536,885,118.51	–	13,536,885,118.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	290,628,343.18	290,628,343.18
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）	4,318,925,407.27	–	4,318,925,407.27
其中：1.基金申购款	28,750,902,039.91	–	28,750,902,039.91
2.基金赎回款	-24,431,976,632.64	–	-24,431,976,632.64
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）	–	-290,628,343.18	-290,628,343.18
五、期末所有者权益（基金净值）	17,855,810,525.78	–	17,855,810,525.78

项目	上年度可比期间（2017年01月01日至2017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）	18,798,247,772.57	–	18,798,247,772.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	104,882,592.56	104,882,592.56
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）	-13,220,711,369.31	–	-13,220,711,369.31
其中：1.基金申购款	7,929,017,135.35	–	7,929,017,135.35
2.基金赎回款	-21,149,728,504.66	–	-21,149,728,504.66
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）	–	-104,882,592.56	-104,882,592.56
五、期末所有者权益（基金净值）	5,577,536,403.26	–	5,577,536,403.26

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

富国收益宝交易型货币市场基金（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[2015]2445号文《关于准予富国收益宝交易型货币市场基金注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集。基金合同于2015年11月24日生效。首次设立募集规模为7,105,509,813.60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为富国基金管理有限公司，基金的注册登记机构为为富国基金管理有限公司和中国证券登记结算有限责任公司，基金的托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人于2015年11月25日发布的《富国收益宝交易型货币市场基金基金份额折算的公告》，H类基金份额在本基金基金合同生效当日进行份额折算，折算后H类每份基金份额对应的面值为人民币100.00元。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款、短期融资券（含超短期融资券），期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据和大额存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、中期票据和资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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编报规则》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 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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称"资管产品运营业务"），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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
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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
海通开元投资有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
海通创新证券投资有限公司	基金管理人的股东控制的子公司

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 债券交易

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债券交易。

6.4.8.1.2 回购交易

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回购交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）	上年度可比期间（2017年01月01日至2017年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	18,827,534.71	10,144,507.81
其中：支付销售机构的客户维护费	901,530.20	826,612.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.28%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）	上年度可比期间（2017年01月01日至2017年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	5,379,295.63	2,898,430.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）当期发生的基金应支付的销售服务费 (0011A0)	(0011B0)	(0011H0)	合计
富国基金管理有限公司	40,710.80	439,944.92	1,550,160.52	2,030,816.24
海通证券	748.76	3,375.43	281,436.69	285,560.88
申万宏源	913.72	1,465.96	148,066.05	150,445.73
中国银行股份有限公司	4,948.66	760.05	–	5,708.71
合计	47,321.94	445,546.36	1,979,663.26	2,472,531.56

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2017年01月01日至2017年06月30日）当期发生的基金应支付的销售服务费 (0011A0)	(0011B0)	(0011H0)	合计
富国基金管理有限公司	2,374.39	17,016.02	2,844,537.28	2,863,927.69
海通证券	650.76	–	–	650.76
合计	3,025.15	17,016.02	2,844,537.28	2,864,578.45

注：本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%；本基金B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%；本基金H类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。对于由B类降级为A类的基金份额，年销售服务费率应自其降级后的下一工作日起适用A类基金份额的费率。对于由A类升级为B类的基金份额，年基金销售服务费率应自其升级后的下一工作日起享受B类基金份额的费率。H类基金份额不适用基金份额升降级规则。各类基金份额的销售服务费计提的计算方法如下：

H＝E×销售服务费年费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期（2018年01月01日至2018年06月30日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
–	–	–	–	–	–	–
上年度可比期间（2017年01月01日至2017年06月30日）						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
–	–	–	–	–	–	–

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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币H	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币H
基金合同生效日(0018)持有的基金份额	–	–	–	–	–	–
期初持有的基金份额	–	251,106,987.17	–	–	–	–
期间申购/买入总份额	–	56,516,642.85	–	–	–	–
期间因拆分变动份额	–	–	–	–	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	–	–	–	–	–
期末持有的基金份额	–	307,623,630.02	–	–	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	2.06%	–	–	–	–

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。期间申购/买入总份额含红利再投、转换入及未付收益份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.8.4.2 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

富国收益宝交易型货币B：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2018年06月30日）持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	上年度末（2017年12月31日）持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
海通创新证券投资有限公司	–	–	50,044,556.25	0.60
海通开元投资有限公司	38,283,132.08	0.26	88,799,649.25	1.06

富国收益宝交易型货币H：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2018年06月30日）持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	上年度末（2017年12月31日）持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
海通证券股份有限公司	–	–	–	–
申万宏源证券有限公司	–	–	–	–

注：本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为"富国货币"，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元；场外基金份额（A类基金份额）简称为"富国收益宝交易型货币A级"，基金份额净值为1.00元；场外基金份额（B类基金份额）简称为"富国收益宝交易型货币B级"，基金份额净值为1.00元。

6.4.8.5 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06月30日）期末余额	当期利息收入	上年度可比期间（2017年01月01日至2017年06月30日）期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	9,121,006.76	216,997.35	3,227,799.38	746,628.95

6.4.8.6 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内均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9 利润分配情况

富国收益宝交易型货币A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,455,861.92	–	–	1,455,861.92	–

富国收益宝交易型货币B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
213,284,281.08	–	–	213,284,281.08	–

富国收益宝交易型货币H

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
75,888,200.18	–	–	75,888,200.18	–

6.4.10 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.2.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2018年06月30日止，基金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为人民币3,106,274,555.35元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180207	18国开07	2018-07-05	99.75	1,800,000	179,558,081.66
170410	17农发10	2018-07-05	99.94	2,000,000	199,886,196.75
180201	18国开01	2018-07-02	100.21	3,150,000	315,658,389.50
150315	15进出15	2018-07-06	100.32	2,000,000	200,637,394.96
180404	18农发04	2018-07-06	100.19	1,000,000	100,187,378.43
111809196	18浦发银行CD196	2018-07-03	98.07	2,000,000	196,149,568.71
111811147	18平安银行CD147	2018-07-03	99.26	260,000	25,806,319.22
111818166	18华夏银行CD166	2018-07-03	99.12	5,000,000	495,594,306.61
111818167	18华夏银行CD167	2018-07-03	98.04	3,000,000	294,125,862.48
111809196	18浦发银行CD196	2018-07-03	98.07	1,000,000	98,074,784.36
180201	18国开01	2018-07-02	100.21	990,000	99,206,922.41
130229	13国开29	2018-07-02	100.00	400,000	39,999,368.38
150418	15农发18	2018-07-02	99.99	900,000	89,988,568.48
170410	17农发10	2018-07-02	99.94	500,000	49,971,549.19
180207	18国开07	2018-07-02	99.75	200,000	19,950,897.96
111807134	18招商银行CD134	2018-07-03	98.04	1,000,000	98,041,954.15
111810263	18兴业银行CD263	2018-07-02	99.23	2,700,000	267,913,742.22
111808164	18中信银行CD164	2018-07-03	98.04	3,700,000	362,755,230.41
111809170	18浦发银行CD170	2018-07-03	99.21	500,000	49,605,046.91
合计				32,100,000	3,183,111,562.79

6.4.10.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年06月30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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1公允价值

6.4.14.1.1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。

6.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2018年6月30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0.00元，属于第二层次的余额为人民币9,806,533,972.64元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	9,806,533,972.64	46.76
	其中：债券	9,806,533,972.64	46.76
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	3,411,077,596.60	16.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	7,649,122,206.76	36.48
4	其他资产	103,948,444.22	0.50
5	合计	20,970,682,220.22	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目		占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		9.22
	其中：买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,106,274,555.35	17.40
	其中：买断式回购融资	–	–

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	25.77	17.40
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	10.92	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	50.14	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天（含）—120天	–	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天（含）—397天（含）	30.03	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	116.86	17.40

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,395,232,126.15	7.81
	其中：政策性金融债	1,395,232,126.15	7.81
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	1,011,489,202.07	5.66
6	中期票据	–	–
7	同业存单	7,399,812,644.42	41.44
8	其他	–	–
9	合计	9,806,533,972.64	54.92
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111810263	18兴业银行CD263	6,000,000.00	595,363,871.59	3.33
2	111818166	18华夏银行CD166	5,000,000.00	495,594,306.61	2.78
3	111808164	18中信银行CD164	5,000,000.00	490,209,770.82	2.75
4	180201	18国开01	4,140,000.00	414,865,311.91	2.32
5	111810255	18兴业银行CD255	3,000,000.00	297,740,194.29	1.67
6	111714255	17江苏银行CD255	3,000,000.00	297,619,388.36	1.67
7	111898930	18北京农商银行CD046	3,000,000.00	297,363,453.21	1.67
8	111809196	18浦发银行CD196	3,000,000.00	294,224,353.07	1.65
9	111818167	18华夏银行CD167	3,000,000.00	294,125,862.48	1.65
10	111817137	18光大银行CD137	3,000,000.00	294,055,470.98	1.65

7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1146%
报告期内偏离度的最低值	0.0212%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0548%

注：以上数据按工作日统计

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

7.9.2 声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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的"18兴业银行CD263"的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称"公司"），由于公司存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则、多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2018年4月19日对公司处以罚款5870万元的行政处罚。

本报告编制日前一年内，本基金持有的"18兴业银行CD255"的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称"公司"），由于公司存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则、多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2018年4月19日对公司处以罚款5870万元的行政处罚。

本报告编制日前一年内，本基金持有的"18浦发银行CD196"的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称"公司"），由于公司存在内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；提供不实说明材料；不配合调查取证；以贷转存，虚增存款；票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；国内信用证业务贸易背景审查不严；贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；为非保本理财产品出具保本承诺函；向关系人发放信用贷款；向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本等违法违规事实，中国银监会于2018年2月12日对公司处以罚款5845万元，没收违法所得10.927万元，罚没合计5855.927万元的行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余7名证券的发行主体本期未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。

7.9.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	100,788,582.51
4	应收申购款	3,159,861.71
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	103,948,444.22

7.9.4 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例（%）	个人投资者 持有份额	占总份额比例（%）
富国收益宝交易型货币A	7,279	11,323.08	27,177,894.10	32.97	55,242,793.55	67.03
富国收益宝交易型货币B	8,537	1,748,362.04	14,531,780,907.74	97.36	393,985,869.19	2.64
富国收益宝交易型货币H	3,006	947,313.06	2,084,459,561.20	73.20	763,163,500.00	26.80
合计	18,822	948,667.01	16,643,418,363.04	93.21	1,212,392,162.74	6.79

8.2 期末上市基金前十名持有人

富国收益宝交易型货币H

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	陕西省国际信托股份有限公司－陕国投·荣兴8号证券投资集合资金信托计划	220,394,800	7.74
2	五矿资本控股有限公司	200,811,400	7.06
3	苏云利	173,707,400	6.10
4	DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	137,648,200	4.84
5	陕西省国际信托股份有限公司－陕国投·鑫鑫向荣25号证券投资集合资金信托计划	131,582,300	4.62
6	申万宏源证券有限公司	69,133,100	2.43
7	农银汇理资产－农业银行－辽宁省社会保障基金理事会（省产业（创业）投资引导基金管	54,407,200	1.91
8	中国联合网络通信集团有限公司企业年金计划－招商银行股份有限公司	50,494,000	1.77
9	上海山友通信公司	47,834,200	1.68
10	兴全基金－民生银行－中国民生信托－中国民生信托·FOF一号单一资金信托	47,547,700	1.67

注：本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为"富国货币"，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元。

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,455,428,006.00	0.0815
2	银行类机构	1,000,125,206.00	0.0560
3	基金类机构	858,089,434.80	0.0481
4	银行类机构	797,111,837.20	0.0446
5	银行类机构	505,460,898.50	0.0283
6	其他机构	501,694,044.00	0.0281
6	银行类机构	501,694,044.00	0.0281
8	券商类机构	419,482,119.30	0.0235
9	银行类机构	409,891,183.60	0.0230
10	券商类机构	404,734,132.10	0.0227

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国收益宝交易型货币A	644,705.00	0.7822
	富国收益宝交易型货币B	521,346.65	0.0035
	富国收益宝交易型货币H	–	–
	合计	1,166,051.65	0.0065

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国收益宝交易型货币A	0
	富国收益宝交易型货币B	0
	富国收益宝交易型货币H	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国收益宝交易型货币A	0
	富国收益宝交易型货币B	0
	富国收益宝交易型货币H	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国收益宝交易型货币A	富国收益宝交易型货币B	富国收益宝交易型货币H
基金合同生效日(2015年11月24日)基金份额总额	122,371,834.45	117,123,979.15	6,866,014,000.00
报告期期初基金份额总额	63,273,059.55	8,400,848,916.24	5,072,763,142.72
本报告期基金总申购份额	155,969,699.49	27,027,264,840.24	1,567,667,500.18
减：本报告期基金总赎回份额	136,822,071.39	20,502,346,979.55	3,792,807,581.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–	–	–
报告期期末基金份额总额	82,420,687.65	14,925,766,776.93	2,847,623,061.20

注：1、红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

2、本基金场内基金份额（H类基金份额）简称为"富国货币"，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元；场外基金份额（A类基金份额）简称为"富国收益宝交易型货币A级"，基金份额净值为1.00元；场外基金份额（B类基金份额）简称为"富国收益宝交易型货币B级"，基金份额净值为1.00元。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

1.1

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	备注
东方证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	2	500,000,000.00	60.87	–	–	–
太平洋证券	2	–	–	–	–	–
新时代证券	2	–	–	–	–	–
银河证券	2	321,400,000.00	39.13	–	–	–
浙商证券	2	–	–	–	–	–
中金公司	2	–	–	–	–	–

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本报告期内本基金无偏离度绝对值超过0.5%的情况.

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。