

# 信息披露

## 富国转型机遇混合型证券投资基金

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月至6月20日（基金合同生效日）至2018年6月30日期间内的经营成果和现金流量。本财务报表的编制基础是持续经营。

4.6 重要会计政策和会计估计

4.6.1 重要会计政策

本财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则》、《企业会计准则应用指南》、《企业会计准则解释》以及其他相关规定进行编制。本基金按照公允价值进行估值。在公允价值计量过程中，本基金采用如下估值政策：

(1) 上市交易股票、发行首日之后有明确收盘价的可转债、封闭式基金和上市交易的可转债按照公允价值估值。

(2) 停牌股票按照最近交易日的收盘价估值。

(3) 对于长期停牌且无公允价值的股票，本基金采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括但不限于：参考类似股票的市场价格、参考同行业公司的市盈率、参考同行业公司的市净率等。

4.6.2 重要会计估计

本基金在资产负债表日，对公允价值计量所使用的输入值进行了评估，并确定了公允价值计量的层次。

4.6.3 金融资产的分类和计量

本基金的金融资产在初始确认时分为以下三类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项。

4.6.4 金融负债的分类和计量

本基金的金融负债在初始确认时分为以下三类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、融资租赁负债。

## 2018年半年度报告摘要

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一按20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期末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

6.4.7.2 本报告期末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

序号	股票代码	股票名称	本期持仓买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002828	兴发集团	13,187,144.00	0.70
2	000029	南方航空	82,676,200.00	4.63
4	600048	保利地产	80,265,793.00	4.37
5	600008	光大银行	80,354,763.00	4.37
6	002027	分众传媒	76,302,977.00	4.15
7	600019	贵州茅台	70,130,077.00	3.81
8	002076	立讯精密	66,767,243.00	3.58
9	000079	群兴能源	64,576,280.00	3.43
10	000098	顺络电子	60,677,815.00	3.26
11	601228	陕西国力	61,119,020.00	3.24
12	000073	恒立通信	46,904,321.00	2.50
13	600067	内蒙一羊	46,475,370.00	2.47
14	600076	中航光电	45,070,950.00	2.37
15	600009	新南村	44,411,121.00	2.34
16	002029	东方锆业	43,322,482.00	2.28
17	600067	特变电工	42,699,371.00	2.26
18	600306	中信特钢	37,565,524.00	2.03
19	601018	中国平安	35,571,923.00	2.11
20	300056	中航高科	34,919,763.00	2.07
21	000058	五粮液	34,830,870.00	2.07
22	002139	万达路桥	34,348,302.00	2.04
23	600036	招商银行	34,060,517.00	1.82
24	600007	中国神华	32,488,422.00	1.73

2018年上半年，市场呈现大幅下跌格局，一季度市场呈现显著波动，存在局部热点，二季度则持续阴跌，市场整体情绪偏弱。中美贸易摩擦升级以及信用债违约风险上升等因素，对市场整体走势产生不利影响。本基金于4月末、5月中旬和6月中旬三次调仓，调整后持仓集中度在仓位、行业配置和风险偏好等方面进行了调整，以期在控制回撤的前提下，把握市场结构性机会。

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

4.3 基金管理人报告期内履行职责的情况

4.3.1 基金管理人报告期内履行职责的情况

4.3.2 基金管理人报告期内履行职责的情况

4.3.3 基金管理人报告期内履行职责的情况

项目	基金管理人	基金托管人
名称	富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
法定代表人	陈皓	田国立
信息披露负责人	陈皓	田国立
联系电话	021-30538888	010-67606666
电子邮箱	public@funds.com.cn	public@ccb.com.cn
网址	www.fund123.com.cn	www.ccb.com.cn
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1500号27层	北京市西城区金融大街25号

6.1 资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富国转型机遇混合型证券投资基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%。

期间	基金净值增长率	业绩比较基准	超额收益
自基金合同生效日至2018年6月30日	-6.61%	-6.61%	0.00%
自基金合同生效日至2018年6月30日	-6.61%	-6.61%	0.00%
自基金合同生效日至2018年6月30日	-6.61%	-6.61%	0.00%

项目	与基金总资产
长期股权投资	2.78
持有至到期投资	4.37
贷款和应收款项	4.15
其他金融负债	2.37
融资租赁负债	2.03
其他金融负债	2.11
其他金融负债	2.07
其他金融负债	2.07
其他金融负债	2.07
其他金融负债	2.07

6.2 基金管理人报告期内履行职责的情况

6.2.1 基金管理人报告期内履行职责的情况

6.2.2 基金管理人报告期内履行职责的情况

6.2.3 基金管理人报告期内履行职责的情况

关联方名称	项目	金额
富国基金	公允价值变动损益	675,400,000.00
富国基金	公允价值变动损益	522,465,624.00
富国基金	公允价值变动损益	341,063,688.81

6.3 关联方关系及其交易

6.3.1 关联方关系及其交易

6.3.2 关联方关系及其交易

6.3.3 关联方关系及其交易

关联方名称	项目	金额
富国基金	公允价值变动损益	675,400,000.00
富国基金	公允价值变动损益	522,465,624.00
富国基金	公允价值变动损益	341,063,688.81

6.4 关联方交易

6.4.1 关联方交易

6.4.2 关联方交易

6.4.3 关联方交易

6.4.4 关联方交易

6.4.5 关联方交易

6.4.6 关联方交易

6.4.7 关联方交易

6.4.8 关联方交易

6.4.9 关联方交易

6.4.10 关联方交易

6.4.11 关联方交易

6.4.12 关联方交易

6.4.13 关联方交易

6.4.14 关联方交易

6.4.15 关联方交易

6.4.16 关联方交易

6.4.17 关联方交易

6.4.18 关联方交易

6.4.19 关联方交易

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

序号	股票代码	股票名称	本期持仓买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002828	兴发集团	13,187,144.00	0.70
2	000029	南方航空	82,676,200.00	4.63
4	600048	保利地产	80,265,793.00	4.37
5	600008	光大银行	80,354,763.00	4.37
6	002027	分众传媒	76,302,977.00	4.15
7	600019	贵州茅台	70,130,077.00	3.81
8	002076	立讯精密	66,767,243.00	3.58
9	000079	群兴能源	64,576,280.00	3.43
10	000098	顺络电子	60,677,815.00	3.26
11	601228	陕西国力	61,119,020.00	3.24
12	000073	恒立通信	46,904,321.00	2.50
13	600067	内蒙一羊	46,475,370.00	2.47
14	600076	中航光电	45,070,950.00	2.37
15	600009	新南村	44,411,121.00	2.34
16	002029	东方锆业	43,322,482.00	2.28
17	600067	特变电工	42,699,371.00	2.26
18	600306	中信特钢	37,565,524.00	2.03
19	601018	中国平安	35,571,923.00	2.11
20	300056	中航高科	34,919,763.00	2.07
21	000058	五粮液	34,830,870.00	2.07
22	002139	万达路桥	34,348,302.00	2.04
23	600036	招商银行	34,060,517.00	1.82
24	600007	中国神华	32,488,422.00	1.73

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。

富国转型机遇混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

截至2018年6月30日，本基金前十大重仓股为：贵州茅台、中国平安、五粮液、招商银行、中信特钢、东方锆业、特变电工、中航光电、内蒙一羊、光大银行。