富国可转换债券证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：	2019年04月22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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国可转换债券
基金主代码	100061
交易代码	前端交易代码：100061 后端交易代码：100062
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
报告期末基金份额总额（单位：份）	467,011,965.67
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，低于股票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。
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

§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01月01日–2019年03月31日）
1.本期已实现收益	60,702,529.56
2.本期利润	98,867,103.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.2104
4.期末基金资产净值	690,073,781.41
5.期末基金份额净值	1.510

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。

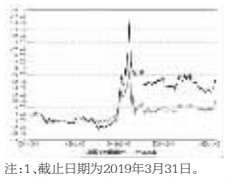
3.2 基金净值表现

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	14.22%	0.82%	13.79%	0.74%	0.43%	0.08%

注：过去三个月指2019年1月1日－2019年3月31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3月31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		
俞晓斌	本基金基金经理	2018-08-31	–	6	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月起任富国天惠护盾保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08月起任富国转化增强债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、富国锐意成长灵活配置混合型证券投资基金、富国稳利纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年12月起任富国纯化增强债券证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国新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、富国环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、富国稳利纯债债券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	–	5.75	硕士，自2008年4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固定收益研究员，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、富国环利定期开放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、富国稳利纯债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 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、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在进入2019年之后，大类资产出现切换走势，一方面源于海外市场美联储加息预期逐渐弱化，缩表进程也实质上暂缓，在全球流动性由紧转松的环境下，风险偏好得到显著的提升；另一方面国内经济下行压力仍然较大背景下，管理层稳增长政策不断出台，叠加去年无风险利率大幅下行，令权益类等风险资产风险收益比显著提升。

组合积极配置转债资产，采取跟随性策略，看中转债资产本身攻守兼备的特性，采取自上而下的投资思路，分散化配置与绝对价格占优择券并存。进入到春节后，随着权益资产快速上涨，转债价格大幅提升，其债券属性显著下降，基本与权益属性无异，本组合从转债自身特性出发采取相对稳健的操作思路，适当降低高价位转债持仓，置换为低价位转债，同时在总仓位中增加债性转债的占比。

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14.22%，同期业绩比较基准收益率为13.79%

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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,497,000.00	0.89
	其中：股票	6,497,000.00	0.89
2	固定收益投资	602,569,492.56	82.33
	其中：债券	602,569,492.56	82.33
	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	108,563,266.13	14.83
7	其他资产	14,227,852.18	1.94
8	合计	731,847,610.87	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	–	–
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	3,483,000.00	0.50
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	3,014,000.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	6,497,000.00	0.94

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	601878	浙商证券	300,000	3,483,000.00	0.50
2	600797	浙大网新	200,000	3,014,000.00	0.44

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	7,013,100.00	1.02
2	央行票据	–	–
3	金融债券	99,506,192.60	14.42
	其中：政策性金融债	99,506,192.60	14.42
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	496,040,199.96	71.88
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	602,569,492.56	87.32

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	132015	18中油K1	620,000	62,291,400.00	9.03
2	180210	18国开10	600,000	61,560,000.00	8.92
3	132009	17中油K1	400,000	40,760,000.00	5.91
4	113508	新风转债	323,200	34,462,816.00	4.99
5	018005	国开1701	329,260	33,929,392.60	4.92

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

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 申明本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	136,231.64
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,031,898.12
5	应收申购款	10,069,722.42
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	14,227,852.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	132015	18中油K1	62,291,400.00	9.03
2	132009	17中油K1	40,760,000.00	5.91
3	113508	新风转债	34,462,816.00	4.99
4	128034	江银转债	25,977,843.06	3.76
5	113011	光大转债	24,235,272.60	3.51
6	110042	航电转债	16,161,287.00	2.34
7	113516	吴银转债	12,992,700.00	1.88
8	132011	17新K1	12,596,000.00	1.83
9	113017	吉视转债	10,133,232.00	1.47
10	123010	博世转债	8,754,400.00	1.27
11	113515	高能转债	8,426,674.20	1.22
12	128027	崇达转债	8,030,593.34	1.16
13	128029	太阳转债	7,804,768.30	1.13
14	128022	众信转债	7,497,225.00	1.09
15	128033	迪龙转债	7,434,854.10	1.08
16	128018	时达转债	6,502,282.40	0.94
17	132006	16新E1	5,222,000.00	0.76
18	128035	久其转债	4,199,600.00	0.61
19	132007	16凤凰K1	3,946,000.00	0.57
20	128024	宁行转债	3,867,916.70	0.56
21	113505	杭电转债	3,509,011.10	0.51
22	110043	无锡转债	3,287,648.00	0.47
23	127006	敦东转债	3,239,700.00	0.47
24	123002	国祯转债	3,153,693.34	0.46
25	128023	亚太转债	2,962,188.12	0.43
26	128037	岩土转债	2,697,410.92	0.39
27	113015	隆基转债	2,601,475.20	0.38
28	128045	机电转债	2,348,400.00	0.34
29	113514	威帝转债	2,174,200.00	0.32
30	113504	艾华转债	1,139,800.00	0.17
31	128026	众兴转债	1,120,068.28	0.16
32	127004	模塑转债	967,400.00	0.14
33	128036	金农转债	911,785.70	0.13
34	113013	国君转债	65,125.50	0.01
35	113507	天马转债	45,177.00	0.01
36	128032	双环转债	23,602.80	0.00

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	287,569,451.22
报告期期间基金总申购份额	573,295,968.01
减：报告期期间基金总赎回份额	383,853,453.56
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	457,011,965.67

§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	–
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期末管理人持有的本基金份额	–
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	–

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国可转换债券证券投资基金的文件

2、富国可转换债券证券投资基金基金合同

3、富国可转换债券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、富国可转换债券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

9.2 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

9.3 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04月22日

富国两年期理财债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	招商银行股份有限公司
报告送出日期：	2019年04月22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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国两年期理财债券
基金主代码	002898
基金运作方式	契约型开放式，以运作期滚动的形式运作
基金合同生效日	2016年12月01日
报告期末基金份额总额	2,768,671,764.08
投资目标	本基金严格采用持有到期投资的策略，投资于剩余期限（权利在投资者一方的含权债按照行权剩余期限计算）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求为投资者获取持续稳定的收益。
投资策略	在封闭期内，本基金严格采用买入并持有策略，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配。投资于剩余期限（权利在投资者一方的含权债按照行权剩余期限计算）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产在封闭期结束前可完全变现。
业绩比较基准	该封闭期起始日的两年期定存利率（税后）+1%
风险收益特征	本基金为理财债券型基金（固定组合类），属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票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	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	富国两年期理财债券A级 富国两年期理财债券C级
下属分级基金的交易代码	002898 002899
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	2,768,341,602.45 330,161.63

§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01月01日–2019年03月31日）	C级 报告期（2019年01月01日–2019年03月31日）
1.本期已实现收益	20,909,229.83	2,081.62
2.本期利润	20,909,229.83	2,081.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0076	0.0063
4.期末基金资产净值	2,797,746,316.92	333,091.19
5.期末基金份额净值	1.011	1.009

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	0.80%	0.03%	0.76%	0.01%	0.04%	0.02%

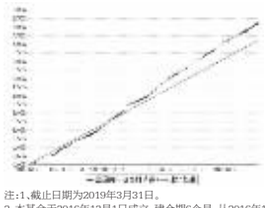
（2）C级

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	0.60%	0.03%	0.76%	0.01%	–0.16%	0.02%

注：过去三个月指2019年1月1日－2019年3月31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两年期理财债券A级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3月31日。

2、本基金于2016年12月1日成立，建仓期6个月，从2016年12月1日起至2017年5月31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两年期理财债券C级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3月31日。

2、本基金于2016年12月1日成立，建仓期6个月，从2016年12月1日起至2017年5月31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		
王晓亮	本基金基金经理	2016-12-14	–	9	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月任富国广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月至2018年12月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月任富国景悦债券型证券投资基金基金经理，富国天时货币市场基金基金经理，2015年11月至2018年1月任富国欣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月至2018年7月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2016年5月至2018年12月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。
俞晓斌	本基金基金经理	2018-12-14	–	6	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2006年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2008年3月任富国天时货币市场基金基金经理，2008年10月至2019年3月任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理，2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理，2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理，2015年3月至2019年3月任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2016年12月至2019年2月富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2015年3月至2018年7月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2015年5月至2019年3月任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至2019年3月任富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金、富国纯利纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月至2018年7月任富国惠利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月至2019年3月任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年8月至2019年3月任富国新收益增强债券型证券投资基金基金经理，2017年9月至2019年3月任富国环利定期开放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基金经理，2017年11月至2019年3月任富国泰利定期开放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基金经理，2018年1月至2019年3月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018年2月至2019年3月任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年3月至2019年3月任富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，离任固定收益投资部固定收益投资总监。具有基金从业资格。
钟智伦	本基金前任基金经理	2015-03-13	2019-03-19	25	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2006年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2008年3月任富国天时货币市场基金基金经理，2008年10月至2019年3月任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理，2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理，2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理，2015年3月至2019年3月任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2016年12月至2019年2月富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2015年3月至2018年7月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2015年5月至2019年3月任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至2019年3月任富国新收益增强债券型证券投资基金、富国环利定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年3月至2019年3月任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，2017年6月至2018年7月任富国惠利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年8月至2019年3月任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年9月至2019年3月任富国祥利定期开放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基金经理，2018年1月至2019年3月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018年2月至2019年3月任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年3月至2019年3月任富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，离任固定收益投资部固定收益投资总监。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 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、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

随着国内比较明确以及多元化的政策导向，货币信号从稳健中性变为松紧适度，财政政策也积极发力。政策在维稳的基础上，无论对企业和居民的减税降费，对小微和民营的纾困支持，对基建发力对地产因城施策等等，在各个领域都采用了防守和救助的方式。一月份央行除了降准1个百分点，释放1.5万亿置换MLF以外，还首次开展TMLF操作，给宽信用提供了足够的支持，春节前债市收益率一路下行，风险偏好的局部回升也带动了权益以及信用类资产的一季度上行。1月份金融数据全面超预期，天量社融也给宽信用提振了信心，但市场对持续性存疑。长端利率在节后有所回调，区间震荡，期限利差进一步拉大。但受到海外美联储3月份议息会议的鸽派言论以及欧洲数据的弱化又带动收益率向下。总体来看还要进一步的观察才能逐步明确经济的走向，并且中美贸易谈判的结果以及海外的走势也不容小觑。

在上述环境下，基金管理人严格按照基金合同进行投资管理；在一季度进行适当的利率债波段操作，对部分持仓进行了调整，增强了个券的流动性水平。意图以较为灵活的持仓水平、结构来面对充满不确定性的明年变化。

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1.52%，同期业绩比较基准收益率为0.62%

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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	5,106,364,924.77	97.33
	其中：债券	5,106,364,924.77	97.33
	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