

富国全球债券证券投资基金

二〇一八年年度报告

(摘要)

2018年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019年03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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 1.2

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国全球债券（QDII-FOF）
基金主代码	100050
交易代码	前端交易代码：100050 后端交易代码：000163
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月20日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	37,243,398.51份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球债券市场，通过运用基金中基金（FOF：fund of funds）这种国际流行的投资管理模式，力争实现资产运作精细化、组合配置最优化、风险管理精细化、风险调整后收益最大化，从而谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用战略资产配置与战术资产配置相结合的策略，通过“自上而下”的方式进行资产配置，在有效分散风险（即：分散投资于单一国家或区域债券基金、单一债券类型基金以及单一基金公司及管理人的投资风险）的同时，力争实现基金资产风险调整后收益最大化。在本基金资产组合的构建过程中，根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征，基金资产被区分为核心资产和卫星资产。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：Barclay Global Aggregate Index。
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010-666105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010-66105798

注：公司已于 2019 年 03 月 28 日发布《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，裴长江先生自 2019 年 03 月 27 日起担任公司董事长。

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

## 2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

注：信息披露报纸为截止至本报告期末信息。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-82,214.89	1,919,973.29	868,856.25
本期利润	90,656.17	-209,502.59	4,130,630.50
加权平均基金份额本期利润	0.0032	-0.0039	0.0852
本期基金份额净值增长率	2.44%	-1.30%	10.88%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.0492	0.0510	0.0150
期末基金资产净值	40,669,281.79	30,074,976.94	73,303,739.09
期末基金份额净值	1.092	1.066	1.080

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

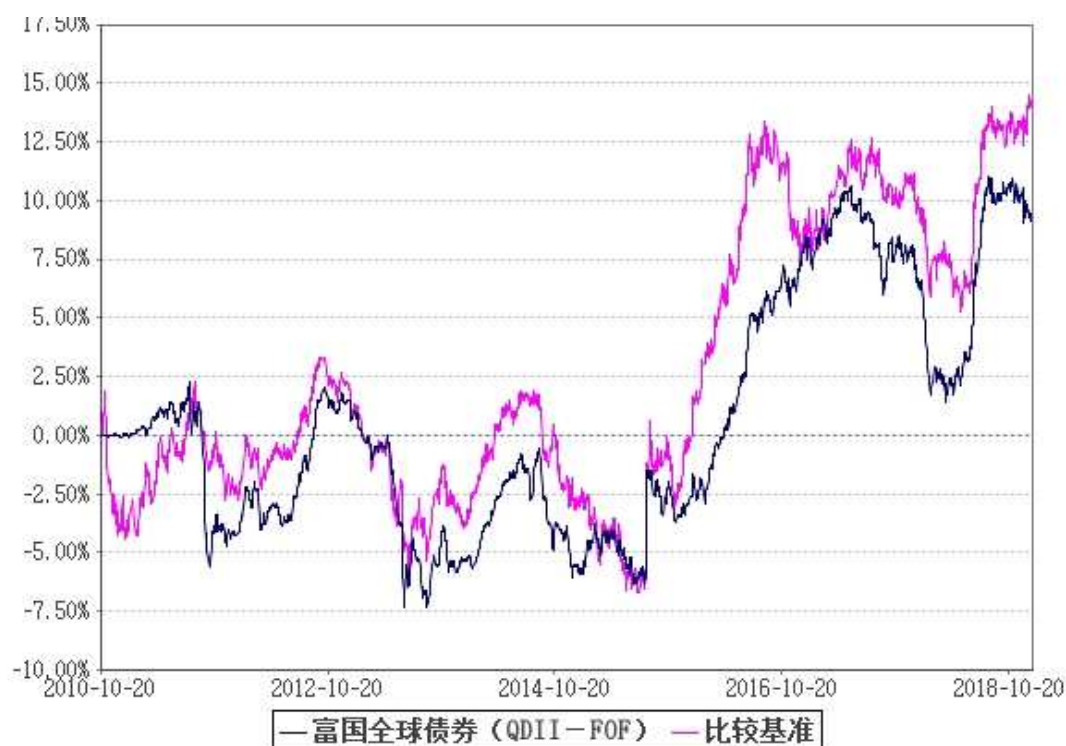
基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 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
过去三个月	-1.36%	0.22%	0.96%	0.30%	-2.32%	-0.08%
过去六个月	2.44%	0.26%	4.00%	0.32%	-1.56%	-0.06%
过去一年	2.44%	0.26%	3.77%	0.32%	-1.33%	-0.06%
过去三年	12.11%	0.23%	14.48%	0.34%	-2.37%	-0.11%
过去五年	15.43%	0.23%	18.78%	0.34%	-3.35%	-0.11%
自基金合同生效日起至今	9.20%	0.22%	14.29%	0.33%	-5.09%	-0.11%

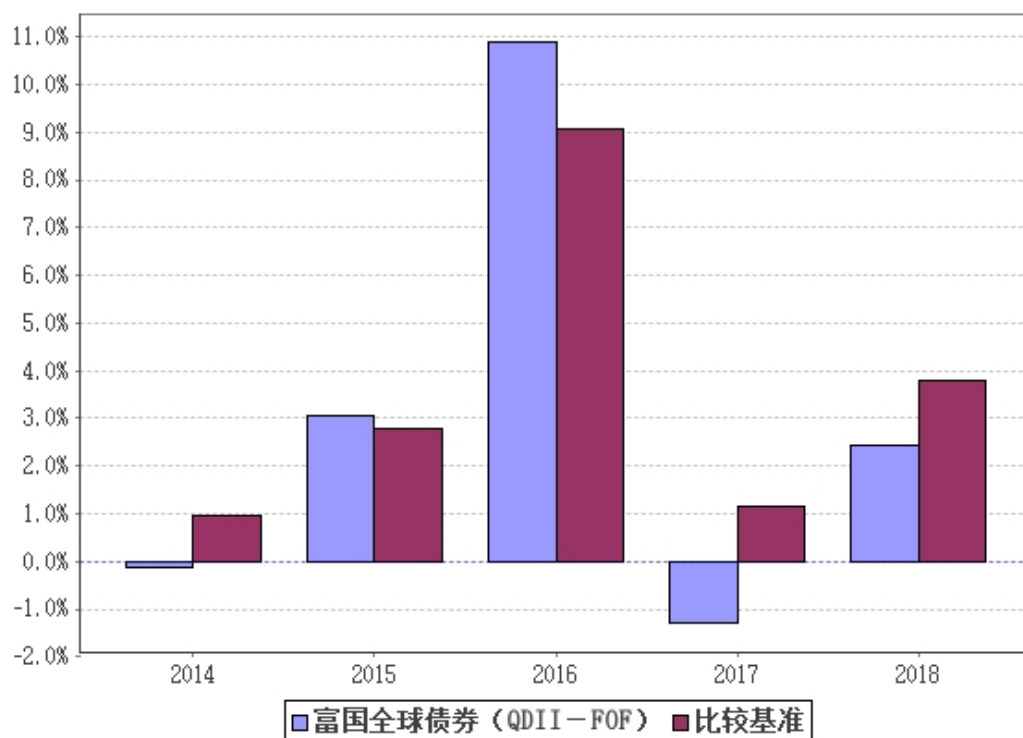
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2018年12月31日。

2、本基金于2010年10月20日成立，建仓期6个月，从2010年10月20日起至2011年4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。

### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年本基金未进行利润分配。

## § 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 2018 年 12 月 31 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一百二十四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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈博文	本基金基金经理	2018-07-11	—	8	硕士，自 2011 年 01 月至 2013 年 06 月任国泰君安国际控股有限公司研究部分析师；2013 年 07 月至 2018 年 03 月任中投国际（香港）有限责任公司债券投资部副经理；2018 年 03 月加入富国基金管理有限公司，2018 年 7 月起任富国全球债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
王乐乐	本基金前任基金经理	2016-10-17	2018-07-11	8	博士，自 2010 年 6 月至 2011 年 11 月在上海证券有限责任公司任研究员；自 2011 年 11 月至 2012 年 6 月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自 2012 年 7 月至 2015 年 5 月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，2015 年 8 月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 7 月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017 年 10 月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 11 月起任富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2018 年 11 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 12 月起任富国中证价值交易型开放式

					指数证券投资基金联接基金基金经理；兼任量化投资部量化投资总助理。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

## 4.3 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全球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》、《富国全球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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

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。



#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年以来，随着全球经济从同步复苏状态转为美国一枝独秀，美元指数进入强势区间，同时随着美联储加息的按期执行，对债券市场带来较大冲击。全年来看，无论是发达国家还是新兴市场国家的国债和信用债均取得负回报。

具体来看，上半年美国国债受到加息影响，收益率跳升，资产价格下跌，但美国高收益债券受到美国经济向好、美股持续上涨的影响，获得较高回报；与此同时，中资美元债市场处于对房地产和城投板块的担忧，出现了信用价差大幅加宽的情况。上半年富国全球债由于没有配置亚洲高收益债券，同时有美国高收益基金的头寸，对组合有一定的正面帮助。同时该阶段美元指数的持续走强，对基金回报带来了正面贡献。

而进入第三季度，随着市场对美国经济见顶后续出现衰退的担忧，市场预期美联储将减少加息次数，美债收益率出现倒挂，美股下跌，使得美国高收益债券市场也出现大幅下跌，而投资级市场也由于Fallen Angel的增加而出现信用价差的持续加宽。富国全球债在7月开放了基金的申购赎回，并开始逐步减持美国高收益债券基金，在国债收益率较高时增加了国债的配置。此外，美元兑人民币的升值也给组合带来少量正面贡献。

接近年底时，美国高收益债券持续下跌，亚洲信用市场情绪疲弱，避险情绪的提升和对美联储19年加息次数的进一步减少的预期使得美国国债收益率大幅下行。富国全球债在此期间增加了部分有估值吸引力的信用债配置。但4季度人民币的升值给基金带来了负面影响。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，本基金份额净值为1.092元；份额累计净值为1.092元；本报告期，本基金份额净值增长率为2.44%，同期业绩比较基准收益率为3.77%

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着美联储加息预期进入中后期，对债券市场的不利因素有所减少。结构上来说，我们认为美国投资级债券仍有更多Fallen Angel出现的可能，应保持谨慎，高收益市场上半年可能受到美股业绩的影响。而亚洲方面随着2018

估值的调整，可能出现一轮估值修复的行情。

#### **4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自2018年1月2日至本报告期末（2018年12月28日），本基金存在资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，基金管理人已向中国证监会报告此情形并将采取适当措施。

### **§ 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，本基金托管人在对富国全球债券证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **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，富国全球债券证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国全球债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国全球债券证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国全球债券证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。  
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>		
银行存款	4,036,598.33	2,824,793.38
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	37,104,688.38	26,945,767.94
其中：股票投资	—	—
基金投资	25,479,468.38	26,945,767.94
债券投资	11,625,220.00	—
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	—	—
应收证券清算款	—	1,191,378.66
应收利息	109,624.57	210.59
应收股利	—	62,298.83
应收申购款	17,777.64	56,096.49
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	41,268,688.92	31,080,545.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2018 年 12 月 31 日)</b>	<b>上年度末 (2017 年 12 月 31 日)</b>
<b>负债：</b>		
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	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	528,522.56	915,497.41
应付管理人报酬	31,776.12	24,152.72
应付托管费	7,767.53	5,903.99
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
应交税费	1,212.54	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	30,128.38	60,014.83
负债合计	599,407.13	1,005,568.95
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	37,243,398.51	28,201,058.61
未分配利润	3,425,883.28	1,873,918.33
所有者权益合计	40,669,281.79	30,074,976.94
负债和所有者权益总计	41,268,688.92	31,080,545.89

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.092 元，基金份额总额 37,243,398.51 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	470,886.82	515,459.88
1. 利息收入	120,015.71	31,489.51
其中：存款利息收入	41,323.80	31,489.51
债券利息收入	78,691.91	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	210,523.86	2,728,520.21
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	-359,708.19	1,332,532.08
债券投资收益	-31,993.36	—

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	602,225.41	1,395,988.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	172,871.06	-2,129,475.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-37,951.37	-122,011.83
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,427.56	6,937.87
<b>减：二、费用</b>	380,230.65	724,962.47
1. 管理人报酬	272,416.80	526,164.13
2. 托管费	66,590.80	128,617.85
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	10,825.38	9,586.49
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	259.67	—
7. 其他费用	30,138.00	60,594.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	90,656.17	-209,502.59
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	90,656.17	-209,502.59

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年12月31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）	28,201,058.61	1,873,918.33	30,074,976.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	90,656.17	90,656.17
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）	9,042,339.90	1,461,308.78	10,503,648.68
其中：1. 基金申购款	31,527,724.62	3,064,493.55	34,592,218.17
2. 基金赎回款	-22,485,384.72	-1,603,184.77	-24,088,569.49
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）	37,243,398.51	3,425,883.28	40,669,281.79
项目	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年12月31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）	67,867,181.62	5,436,557.47	73,303,739.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-209,502.59	-209,502.59
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）	-39,666,123.01	-3,353,136.55	-43,019,259.56
其中：1. 基金申购款	28,328,184.11	2,490,997.92	30,819,182.03
2. 基金赎回款	-67,994,307.12	-5,844,134.47	-73,838,441.59
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）	28,201,058.61	1,873,918.33	30,074,976.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐 慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外托管行
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 7.4.4.1.2 权证交易

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权证交易。

###### 7.4.4.1.3 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。

###### 7.4.4.1.4 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。

###### 7.4.4.1.5 基金交易

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基金交易。

###### 7.4.4.1.6 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。

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至 2018年12月31日）	上年度可比期间（2017年01月 01日至2017年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	272,416.80	526,164.13
其中：支付销售机构的客户维护费	103,403.21	214,548.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值0.90%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.90\% / \text{当年天数}$

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

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2018年01月01日至 2018年12月31日)	上年度可比期间(2017年01 月01日至2017年12月31日)
当期发生的基金应支付的 托管费	66,590.80	128,617.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.4.4.2 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

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。

#### 7.4.4.5 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12月31 日)		上年度可比期间(2017年01月01日至2017 年12月31日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
布朗兄弟哈里曼银行	3,392,368.03	27,249.88	2,144,248.16	8,220.32
中国工商银行股份有限	644,230.30	14,073.92	680,545.22	23,269.19



公司				
----	--	--	--	--

#### 7.4.4.6 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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无因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。

###### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 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 25,391,730.11 元，属于第二层次的余额为人民币 11,620,723.30 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2017 年

12月31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26,945,767.94元，属于第二层次的余额为人民币0.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元）。

#### 7.4.14.1.2.2 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。

#### 7.4.14.1.2.3 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。

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	权益投资	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	25,479,468.38	61.74
3	固定收益投资	11,625,220.00	28.17
	其中：债券	11,625,220.00	28.17
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
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	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,036,598.33	9.78
8	其他各项资产	127,402.21	0.31
9	合计	41,268,688.92	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

## 8.4 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

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期内无累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期内无累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期无权益投资。

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
Aaa	2,065,153.01	5.08
A+	2,699,680.90	6.64
A-	2,716,770.27	6.68
Baa1	1,356,689.92	3.34
BBB+	1,395,412.10	3.43
Baa2	1,391,513.80	3.42

注：注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、惠誉等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	XS1650054734	CDBLFD 2 5/8	4,000	2,699,680.90	6.64

		08/01/20			
2	XS1897112980	CNBG 6 1/4 PERP	2,000	1,395,412.10	3.43
3	XS1912494538	CHSCOI 6 PERP	2,000	1,391,513.80	3.42
4	US9128285B27	T 2 3/4 09/30/20	2,000	1,377,948.27	3.39
5	XS1843450567	SPICLE 4 1/4 10/30/21	2,000	1,376,483.39	3.38

### 8.8 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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资 明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资 明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	PIMCO GBL INV GRADE- INS \$ACC	开放式	普通开放 式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	4,177,757.91	10.27
2	PIMCO- HI YIELD BD-\$IN ST INC	开放式	普通开放 式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	3,565,108.05	8.77
3	PIMCO- GLOBAL BOND-\$ INV ACC	开放式	普通开放 式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	3,427,031.92	8.43
4	FIDELI TY FNDS-U S HIGH YLD-A\$	开放式	普通开放 式基金	FIL Fund Managem ent Ltd	3,314,791.56	8.15
5	X USD ASIACO	开放式	ETF 基金	XTRACKER S II	3,140,003.77	7.72

	RP BOND					
6	PIMCO-GLOBAL BOND-US UH IAC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	2,907,960.63	7.15
7	ISHARES BARCLAYS 1-3 YEAR TR	开放式	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	2,295,603.14	5.64
8	FULLERTON ASIAN BOND-A	开放式	普通开放式基金	FULLERTON FUND MANAGEMENT CO., LTD	2,024,378.19	4.98
9	ISHARES ULTRA SHORT-TERM BON	开放式	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	515,512.11	1.27
10	ISHARES IBOXX H/Y CORP BOND	开放式	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	111,321.10	0.27

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 申明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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

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	应收股利	—

4	应收利息	109,624.57
5	应收申购款	17,777.64
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	127,402.21

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
2,539	14,668.53	1,049.80	0.00	37,242,348.71	100.00

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	106,479.00	0.2859

### 9.3 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	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	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年10月20日)基金份额总额	828,405,192.16
报告期期初基金份额总额	28,201,058.61
本报告期基金总申购份额	31,527,724.62
减：本报告期基金总赎回份额	22,485,384.72
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	37,243,398.51

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为3万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为15年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2018年10月，公司收到上海证监局向公司出具的《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》以及对相关负责人的警示。公司对此高度重视，成立专项整改小组逐条落实整改要求，强化公司内控制度建设和合规管理措施，进一步提升全员合规意识。报告期内公司已通过上海证监局的整改验收。

除上述情况外，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。

### 11.7 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	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
ABCI Security Company	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP Paribas	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Security Limited	0	—	—	1,392,942.82	7.55	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCOM International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CIMB Securities Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CLSA	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CMFU	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Cathay Securities (Hong Kong) Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—



China Everbright Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Industrial Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China International Capital Corp LTD	0	—	—	6,112,007.07	33.13	—	—	—	—	13,836,930.66	42.22	6,287.24	65.21	—
China Merchant International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Renaissance	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Securities International	0	—	—	1,387,420.00	7.52	—	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Vickers	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets (HK) Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bank	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Essence International Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

First Shanghai Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
GF Securities (HK)	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	0	—	—	8,170,002.76	44.29	—	—	—	—	15,663,057.71	47.79	1,716.63	17.80	—
Guo Yuan Securities (Hong Kong) Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securities HK Finacial Holding CO LTD	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK)	0	—	—	1,384,749.72	7.51	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HAITONG INTERNATIONAL	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HSBC	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ICBC International Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
JPMorgan	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Jefferies	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Macquarie Bank Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	0	—	—	—	—	—	—	—	—	3,276,079.52	10.00	1,638.03	16.99	—
Nomura International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Orient Securities (HongKong) Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securites (H.K.)	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian (Hong kong)Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Zhongtai International Securities Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
安信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

国信证券	3	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华金证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	3	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
英大证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：1. 我对基金交易单元的选择是综合考虑券商研究能力及其它相关因素后决定。

2. 基金债券回购交易与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）公用交易单元。租用券商交易单元未发生变动。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。