

富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金
二〇一九年半年度报告
(摘要)

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 27 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 4 月 17 日(基金合同生效日)起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| 基金简称 | 富国中债 1-5 年农发行债券指数 | |
| 基金主代码 | 007197 | |
| 基金运作方式 | 契约型，开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 04 月 17 日 | |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 南京银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 5,086,917,412.48 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 富国中债 1-5 年农发行债券指数 A | 富国中债 1-5 年农发行债券指数 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 007197 | 007198 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 5,086,889,856.58 份 | 27,555.90 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 中债-1-5 年农发行债券指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

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 | 南京银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵瑛 | 王峰 |
| | 联系电话 | 021-20361818 | 021-24198808 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | njtg@njcbtg.com |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 95302 |
| 传真 | | 021-20361616 | 021-54662130 |

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层 南京银行股份有限公司 上海市徐家汇路518号南京银行 |

§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) 富國中債 1-5 年農發行債券指數 A

金額單位：人民幣元

| 3.1.1 期間數據和指標 | 2019年4月17日(基金合同生效日)至 2019年6月30日 |
|---------------|------------------------------------|
| 本期已實現收益 | 31,764,903.38 |
| 本期利潤 | 47,506,156.22 |
| 加權平均基金份額本期利潤 | 0.0090 |
| 本期基金份額淨值增長率 | 0.95% |
| 3.1.2 期末數據和指標 | 報告期末(2019年06月30日) |
| 期末可供分配基金份額利潤 | 0.0030 |
| 期末基金資產淨值 | 5,119,988,815.40 |
| 期末基金份額淨值 | 1.0065 |

(2) 富國中債 1-5 年農發行債券指數 C

金額單位：人民幣元

| 3.1.1 期間數據和指標 | 2019年4月17日(基金合同生效日)至 2019年6月30日 |
|---------------|------------------------------------|
| 本期已實現收益 | 161.01 |
| 本期利潤 | 258.31 |
| 加權平均基金份額本期利潤 | 0.0093 |
| 本期基金份額淨值增長率 | 0.93% |
| 3.1.2 期末數據和指標 | 報告期末(2019年06月30日) |
| 期末可供分配基金份額利潤 | 0.0028 |
| 期末基金資產淨值 | 27,729.12 |
| 期末基金份額淨值 | 1.0063 |

注：本基金於2019年4月17日成立，自合同生效日起至本報告期末不足半年。

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) 富国中债 1-5 年农发行债券指数 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 | 0.53% | 0.03% | 0.50% | 0.03% | 0.03% | 0.00% |
| 自基金合同生效日起至今 | 0.95% | 0.03% | 1.08% | 0.04% | -0.13% | -0.01% |

(2) 富国中债 1-5 年农发行债券指数 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 | 0.52% | 0.03% | 0.50% | 0.03% | 0.02% | 0.00% |
| 自基金合同生效日起至今 | 0.93% | 0.03% | 1.08% | 0.04% | -0.15% | -0.01% |

注：本基金业绩比较基准为：中债 1-5 年农发行债券指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。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_t）按下列公式计算： $benchmark_t = 95\% * [中债 1-5 年农发行债券指数_t / (中债 1-5 年农发行债券指数_{t-1}) - 1] + 5\% * 同期银行人民币活期存款利率（税后）/ 360$ ；其中， $t=1, 2, 3, \dots$ ； T, T 表示时间截至日；期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算： $benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$ 其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + benchmark_t)$ 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中债 1-5 年农发行债券指数 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2019年6月30日。

2、本基金于2019年4月17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2019年4月17日起至2019年10月16日，本期末建仓期还未结束。

(2) 自基金合同生效以来富國中債1-5年農發行債券指數C基金累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較



注：1、截止日期为2019年6月30日。

2、本基金于2019年4月17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2019年4月17日起至2019年10月16日，本期末建仓期还未结束。

§ 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2019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一百三十七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 | | |
| 武磊 | 本基金基金经理 | 2019-04-17 | — | 8 | 博士，2011年7月至2012年3月任华泰联合证券有限责任公司研究员；2012年4月至2013年7月任华泰证券股份有限公司投资经理；2013年8月至2014年10月任国泰君安证券股份有限公司资本市场部董事；2014年11月至2016年12月任上海国泰君安证券资产管理有限公司投资经理；2016年12月加入富国基金管理有限公司，2017年3月起任富国产业债债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起任富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018年7月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）（原：富国新天锋定期开放债券型证券投资基金）基金经理；2018年9月起任富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年3月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理，2019年4月起任富国中债1-5年农发行债券指数证券投资基金 |

| | | | | | |
|-----|---------|------------|---|-----|--|
| | | | | | 基金经理，兼任固定收益投资部固定收益投资总监助理。具有基金从业资格。 |
| 张明凯 | 本基金基金经理 | 2019-04-30 | — | 5.9 | 硕士，自2009年6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资深信用研究员、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、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自2019年4月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金、富国金融债债券型证券投资基金、富国中债1-5年农发行债券指数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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中债1-5年农发行债券指数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》、《富国中债1-5年农发行债券指数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

2019 年上半年，在“宽信用”、“稳预期”等政策的呵护下，中国经济表现平稳，但结构性矛盾仍然突出，经济增速仍然面临回落压力。央行年初再度下调存款准备金率，并通过 MLF 投放和公开市场操作平抑资金面。受经济数据和风险偏好扰动，债券市场宽幅震荡，中短端利率品种总体表现平稳，标的指数有所增长。本基金通过抽样复制、动态优化跟踪标的指数，力争控制跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.0065 元，C 级为 1.0063 元；份额累计净值 A 级为 1.0095 元，C 级为 1.0093 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 0.95%，C 级为 0.93%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.08%，C 级为 1.08%

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，全球经济下行压力已迫使主要央行放松货币政策，美联储可能会进行“预防性降息”。中国经济仍然面临结构性调整压力，但随着消费占比提

高、产能过剩情况缓解，中国经济仍可能表现出较强韧性，经济数据回落的速度可能较为缓慢。当前经济环境依然需要政策呵护，预计“宽货币、宽财政”政策仍将延续，债券市场仍具投资价值。本基金将继续跟踪标的指数，力争控制跟踪误差。

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

本基金对本报告期内利润共进行 1 次收益分配。于 2019 年 6 月 18 日公告每 10 份 A/B 级基金份额派发红利 0.03 元，每 10 份 C 级基金份额派发红利 0.03 元。报告期内 A/B 级基金份额共计派发红利 11263992.55 元，C 级基金份额共计派发红利 82.66 元。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，本基金托管人在对富国中债 1-5 年农发行债券指数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，富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国中债 1-5 年农发行债券指数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。本基金对本报告期内利润共进行 1 次收益分配。于 2019 年 6 月 18 日公告每 10 份 A/B 级基金份额派发红利 0.03 元，每 10 份 C 级基金份额派发红利 0.03 元。报告期内 A/B 级基金份额共计派发红利 11263992.55 元，C 级基金份额共计派发红利 82.66 元。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国中债 1-5 年农发

行债券指数证券投资基金 2019 年半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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 (2019 年 06 月 30 日) |
|-----------------|-----------------------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 490,127,813.77 |
| 结算备付金 | 33,620,078.29 |
| 存出保证金 | 21,067.41 |
| 交易性金融资产 | 4,540,704,633.00 |
| 其中：股票投资 | — |
| 基金投资 | — |
| 债券投资 | 4,540,704,633.00 |
| 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 | — |
| 应收利息 | 56,556,421.57 |
| 应收股利 | — |
| 应收申购款 | — |
| 递延所得税资产 | — |
| 其他资产 | — |
| 资产总计 | 5,121,030,014.04 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 (2019 年 06 月 30 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 | — |
| 应付证券清算款 | — |
| 应付赎回款 | 10.02 |
| 应付管理人报酬 | 486,781.31 |
| 应付托管费 | 162,260.43 |

| | |
|---------------|------------------|
| 应付销售服务费 | 2.40 |
| 应付交易费用 | 45,523.12 |
| 应交税费 | — |
| 应付利息 | — |
| 应付利润 | — |
| 递延所得税负债 | — |
| 其他负债 | 318,892.24 |
| 负债合计 | 1,013,469.52 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 5,086,917,412.48 |
| 未分配利润 | 33,099,132.04 |
| 所有者权益合计 | 5,120,016,544.52 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,121,030,014.04 |

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0065 元，基金份额总额 5,086,917,412.48 份。其中：富国中债 1-5 年农发行债券指数 A 份额净值 1.0065 元，份额总额 5,086,889,856.58 份；富国中债 1-5 年农发行债券指数 C 份额净值 1.0063 元，份额总额 27,555.90 份。本基金合同生效日 2019 年 04 月 17 日。

6.2 利润表

会计主体：富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金

本报告期：2019 年 04 月 17 日至 2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2019 年 4 月 17 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------------|--|
| 一、收入 | 50,399,350.01 |
| 1. 利息收入 | 32,964,171.81 |
| 其中：存款利息收入 | 13,732,283.02 |
| 债券利息收入 | 17,524,709.47 |
| 资产支持证券利息收入 | — |
| 买入返售金融资产收入 | 1,707,179.32 |
| 其他利息收入 | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 1,693,828.06 |
| 其中：股票投资收益 | — |
| 基金投资收益 | — |
| 债券投资收益 | 1,693,828.06 |
| 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 | — |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 15,741,350.14 |
| 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 | 2,892,935.48 |
| 1. 管理人报酬 | 1,629,106.54 |
| 2. 托管费 | 543,035.53 |
| 3. 销售服务费 | 5.92 |
| 4. 交易费用 | 39,540.44 |
| 5. 利息支出 | 361,954.81 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 361,954.81 |
| 6. 税金及附加 | — |
| 7. 其他费用 | 319,292.24 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 47,506,414.53 |
| 减：所得税费用 | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 47,506,414.53 |

注：本基金合同生效日为2019年4月17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：富国中债1-5年农发行债券指数证券投资基金

本报告期：2019年04月17日至2019年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期2019年4月17日(基金合同生效日)至2019年6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） | 6,756,475,214.61 | — | 6,756,475,214.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 47,506,414.53 | 47,506,414.53 |
| 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） | -1,669,557,802.13 | -3,143,207.28 | -1,672,701,009.41 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,388,192,618.71 | 12,307,879.12 | 2,400,500,497.83 |
| 2. 基金赎回款 | -4,057,750,420.84 | -15,451,086.40 | -4,073,201,507.24 |
| 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） | — | -11,264,075.21 | -11,264,075.21 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 5,086,917,412.48 | 33,099,132.04 | 5,120,016,544.52 |

注：本基金合同生效日为2019年4月17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 |
| 基金管理人负责人 | 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

富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金

(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(2019)488号《关于准予富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人自 2019 年 4 月 8 日至 2019 年 4 月 16 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(2019)验字第 60467606_B10 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 4 月 17 日生效。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 6,756,470,743.08 元，折合 6,756,470,743.08 份基金份额，其中 A 类基金份额 6,756,442,393.91 份，C 类基金份额 28,349.17 份。募集资金在募集期间产生的利息为人民币 4,471.53 元，折合 4,471.53 份基金份额，其中 A 类基金份额 4,464.38 份，C 类基金份额 7.15 份。以上收到的实收基金(本息)共计人民币 6,756,475,214.61 元，折合 6,756,475,214.61 份基金份额，其中 A 类基金份额 6,756,446,858.29 份，C 类基金份额 28,356.32 份。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为南京银行股份有限公司。本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，基金还可投资于国内依法发行上市的政策性金融债、债券回购、银行存款。本基金不投资于除政策性金融债以外的债券资产。

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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；其中投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中债-1-5 年农发行债券指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%

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2019年6月30日的财务状况以及2019年4月17日（基金合同生效日）至2019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。

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。本期财务报表的实际编制期间系2019年4月17日（基金合同生效日）至2019年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债券投资等；

(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债券等，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，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) 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；

(2) 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金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式默认为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为相应类别的基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

2、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

—

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

2. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

3. 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。

4. 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 |
| 申万宏源证券有限公司（“申万宏源”） | 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。

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 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.4 回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为2019年04月17日。无上年度同期对比数据。

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2019年4月17日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
|-----------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,629,106.54 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | — |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期2019年4月17日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
|----|----------------------------------|
|----|----------------------------------|

| | |
|----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 543,035.53 |
|----------------|------------|

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

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2019年4月17日(基金合同生效日)至2019年6月30日 | | |
|----------------|----------------------------------|------|------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | A级 | C级 | 合计 |
| 富国基金管理有限公司 | — | 5.92 | 5.92 |
| 合计 | — | 5.92 | 5.92 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。本基金C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

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

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日为2019年04月17日，无上年度同期对比数据。

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

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为2019年4月17日，无上年度同期对比数据。

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

富国中债1-5年农发行债券指数A：

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末（2019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（%） |
| 海通证券股份有限 | 29,999,000.00 | 0.59 |

| | | |
|----|--|--|
| 公司 | | |
|----|--|--|

注：本基金合同生效日为 2019 年 04 月 17 日，无上年度末对比数据。

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 2019 年 4 月 17 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 | |
|------------|--|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 南京银行股份有限公司 | 490,127,813.77 | 1,554,320.68 |

注：本基金合同生效日为 2019 年 04 月 17 日，无上年度同期对比数据。

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：本报告期内本基金未在承销期内直接购入关联方承销证券。本基金合同生效日为 2019 年 04 月 17 日，无上年度同期对比数据。

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

本报告期内本基金无其他关联方交易事项。本基金合同生效日为 2019 年 04 月 17 日，无上年度同期对比数据。

6.4.9 利润分配情况

富国中债 1-5 年农发行债券指数 A:

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放 | 再投资形式发放 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|---------------|---------|---------------|----|
| 1 | 2019-06-19 | 2019-06-19 | 0.030 | 11,263,872.48 | 120.07 | 11,263,992.55 | — |
| 合计 | | | 0.030 | 11,263,872.48 | 120.07 | 11,263,992.55 | — |

富国中债 1-5 年农发行债券指数 C:

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放 | 再投资形式发放 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|--------|---------|--------|----|
| 1 | 2019-06-19 | 2019-06-19 | 0.030 | 78.47 | 4.19 | 82.66 | — |
| 合计 | | | 0.030 | 78.47 | 4.19 | 82.66 | — |

6.4.10 期末（2019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。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2019年06月30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。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019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2019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4,540,704,633.00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

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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 | 权益投资 | — | — |
| | 其中：股票 | — | — |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 4,540,704,633.00 | 88.67 |
| | 其中：债券 | 4,540,704,633.00 | 88.67 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 贵金属投资 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 523,747,892.06 | 10.23 |
| 8 | 其他各项资产 | 56,577,488.98 | 1.10 |
| 9 | 合计 | 5,121,030,014.04 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

7.3 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股票资产。

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半年度报告正文

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 4,540,704,633.00 | 88.69 |
| | 其中：政策性金融债 | 4,540,704,633.00 | 88.69 |
| 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） | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 4,540,704,633.00 | 88.69 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 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 | 190402 | 19农发02 | 11,300,000 | 1,128,079,000.00 | 22.03 |
| 2 | 190403 | 19农发03 | 6,200,000 | 619,318,000.00 | 12.10 |
| 3 | 190404 | 19农发04 | 5,700,000 | 569,715,000.00 | 11.13 |
| 4 | 180412 | 18农发12 | 3,300,000 | 330,561,000.00 | 6.46 |
| 5 | 180402 | 18农发02 | 2,500,000 | 256,475,000.00 | 5.01 |

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

本基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

7.12.3 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 | 21,067.41 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 56,556,421.57 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 56,577,488.98 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§ 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 | | 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(%) |
| 富国中债1-5年农发行债券指数A | 231 | 22,021,168.21 | 5,085,925,403.08 | 99.98 | 964,453.50 | 0.02 |
| 富国中债1-5年农发行债券指数C | 28 | 984.14 | — | — | 27,555.90 | 100.00 |
| 合计 | 259 | 19,640,607.77 | 5,085,925,403.08 | 99.98 | 992,009.40 | 0.02 |

8.2 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 | 富国中债1-5年农发行债券指数A | 85,201.89 | 0.0017 |
| | 富国中债1-5年农发行债券指数C | 10,383.72 | 37.6824 |
| | 合计 | 95,585.61 | 0.0019 |

8.3 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 | 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 | 富国中债 1-5 年农 发行债券指数 A | 0~10 |
| | 富国中债 1-5 年农 发行债券指数 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 富国中债 1-5 年农 发行债券指数 A | 0 |
| | 富国中债 1-5 年农 发行债券指数 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 富国中债 1-5 年农发行债 券指数 A | 富国中债 1-5 年农发行债 券指数 C |
|--|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日(2019 年 04 月 17 日)基金 份额总额 | 6,756,446,858.29 | 28,356.32 |
| 基金合同生效日 2019 年 4 月 17 日起至报告 期末基金总申购份额 | 2,388,192,248.85 | 369.86 |
| 减：基金合同生效日 2019 年 4 月 17 日起至 报告期末基金总赎回份额 | 4,057,749,250.56 | 1,170.28 |
| 基金合同生效日 2019 年 4 月 17 日起至报告 期末基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期末基金份额总额 | 5,086,889,856.58 | 27,555.90 |

§ 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

本基金管理人于 2019 年 2 月 23 日发布公告，薛爱东先生自 2019 年 2 月 22 日起不再担任公司董事长，由陈戈先生代行公司董事长职责。

本基金管理人于 2019 年 3 月 28 日发布公告，裴长江先生自 2019 年 3 月 27 日起担任公司董事长。

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。

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。

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 | 股票交易 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 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 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 东方证券 | 2 | — | — | 156,897,724.80 | 100.00 | 6,713,661,000.00 | 94.51 | — | — | 14,102.50 | 100.00 | — |
| 中信证券 | 2 | — | — | — | — | 390,000,000.00 | 5.49 | — | — | — | — | — |

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。本基金合同生效日为 2019 年 4 月 17 日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

§ 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|----------------------------|--------------|----------------|----------------|------------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019-04-17 至 2019-06-30 | 1,499,999.00 | - | 457,756,991.00 | 1,042,242,009.00 | 20.49% |
| | 2 | 2019-06-26 | - | 994,529,090.00 | - | 994,529,090.00 | 19.55% |
| | 3 | 2019-04-17 至 2019-05-20 | 1,700,000.00 | - | 1,400,000.00 | 300,000,000.00 | 5.90% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p> | | | | | | | |