

富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

二〇二〇年中期报告

2020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： 中国银行股份有限公司

送出日期： 2020年08月31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。本中期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 2020 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。本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	7
2.6	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理	9
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	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6	中期财务报表(未经审计)	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4	报表附注	16
§7	投资组合报告	36
7.1	期末基金资产组合情况	36
7.2	期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布	37
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	37
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	37
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	37
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	37
7.7	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	38

7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..38	38
7.9	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..38	38
7.10	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.....38	38
7.11	投资组合报告附注 .....	39
§8	基金份额持有人信息 .....	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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.....40	40
§9	开放式基金份额变动 .....	41
§10	重大事件揭示 .....	41
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	41
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.....41	41
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4	基金投资策略的改变 .....	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8	其他重大事件 .....	47
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
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 .....	47
§12	备查文件目录 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）
基金简称	富国亚洲收益债券（QDII）
基金主代码	008367
交易代码	008367
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月07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	207,028,603.98份
基金合同存续期	不定期

注：本基金业绩比较基准为彭博巴克莱新兴亚洲高等级美元信用指数×80%+人民币\_银行活期存款利率×20%。富国亚洲收益债券（QDII）含人民币份额（份额代码：008367）及美元现汇份额（008368），交易代码仅列示人民币份额代码。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚洲债券市场，通过积极主动的资产管理，在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下，通过积极和深入的研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。
投资策略	本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。本基金将根据对全球市场经济发展的判断，以及对不同国家和地区宏观经济、财政政策、货币政策、金融市场环境和走势的分析，确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。根据全球宏观经济发展走向、中国经济政策、法律法规等可能影响证券市场的重要因素进行分析和预测，以期获得稳健的回报。本基金还将运用股票投资策略、基金投资策略、衍生品投资策略、汇率避

	险策略和资产支持证券投资策略等进行投资。
业绩比较基准	彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率×80%+人民币活期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66594319
	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
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	刘连舸

### 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	-	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
本期已实现收益	152,624.61
本期利润	2,390,808.44
加权平均基金份额本期利润	0.0115
本期加权平均净值利润率	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	152,624.61
期末可供分配基金份额利润	0.0007
期末基金资产净值	209,419,412.42
期末基金份额净值	1.0115
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.15%

注：本基金于 2020 年 4 月 7 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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
过去一个月	0.81%	0.16%	0.41%	0.15%	0.40%	0.01%
自基金合同生效日起至今	1.15%	0.13%	3.27%	0.22%	-2.12%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准为：彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率×80%+人民币活期存款利率（税后）×20%。

彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数（Bloomberg Barclays EM Asia USD Credit High Grade Index）包含了新兴市场亚洲国家（除日本外）发行的美元计价的高等级国债、政府债、公司债与固定利率证券化债券。

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）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = [\text{彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率}_t / (\text{彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率}_{t-1} - 1)] * 80\% + [\text{人民币活期存款利率(税后)}] * 20\%;$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日；

期间 $T$ 日收益率（ $\text{benchmark}_T$ ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 $t$ 日至 $T$ 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 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



注：1、截止日期为2020年6月30日。

2、本基金于2020年4月7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2020年4月7日起至2020年10月6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 2020 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一百六十八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	2020-04-07	—	9.5	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 (QDII) 基金经理,2019 年 8 月起任富国景利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,2020 年 4 月起任富国中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、富国亚洲收益债券型证券投资基金 (QDII) 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 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亚洲收益债券型证券投资基金 (QDII) 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》、《富国亚洲收益债券型证券投资基金 (QDII) 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。

## 4.4 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 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

2020 上半年，美元债券市场跌宕起伏，市场经历了巨幅震动。整体而言，美元债市场大致可以分为三个阶段：第一阶段为延续 2019 年以来的涨势阶段，美元债受中美贸易第一阶段协议顺利签署等利好影响，2020 年开年继续上涨，根据彭博-巴克莱指数，美国、亚洲、中资投资级总回报上半年最高点分别为 5.75%、5.08%和 5.16%，高收益债券总回报上半年最高的分别为 1.26%、1.92%和 1.98%；第二阶段为市场大幅下跌阶段，由于疫情在全球的爆发引发市场对经济衰退的担忧，尤其是疫情在日韩、欧洲、美国等传统经济发达地区的广泛传播，使得市场避险情绪急剧升温，加上原油市场引发价格战，原油价格暴跌，彻底引爆了市场悲观情绪，叠加流动性挤兑、回购市场被迫降杠杆和美元流动性枯竭等多重不利因素，债券市场在短期内巨幅下跌，美国、亚洲、中资美元债投资级最大回撤分别达到 15.44%、7.42%、5.56%，高收益债券则分别为 20.78%、16.14%、

13.68%。不仅完全抵消了前期涨幅，整体还录得巨幅下跌；第三阶段为政策托市与市场反弹阶段，由于疫情对经济和金融市场的打击巨大，各国政府和央行纷纷采取措施，避免经济和金融系统走向崩溃，而在美元债市场，美联储和美国政府的政策成为推动市场的主导因素，美国采取了财政+货币双管齐下的政策，在财政方面接连推出2万亿美元的刺激计划、1万亿美元基建计划等；在货币方面两次紧急降息至接近零利率、推出无限量QE、一级市场信贷机制、二级市场信贷机制、买债范围涵盖“fallen angel”等多项措施，总额高达2.3万亿美元；市场信心迅速得到修复和提振，短期内大幅反弹，并持续至今，截止于上半年，美国、亚洲、中资美元债投资级回报率分别为5.18%、3.78%、4.12%，高收益债券则分别为-3.54%、-1.36%、1.47%。

本基金4月开始正式运作，由于当时美元债券市场已经很大程度上从大跌中反弹。对此，我们对策略做出一定调整，由于当时评级公司正对企业评级做出大面积负面调整，企业信用风险骤然提升，fallen angel 频繁出现，且市场短期内建仓成本过高，我们优先选择配置优质地产债，随后选择配置具有较佳资质的投资级债券，并从二级市场为主逐步调整为一二级联动的配置策略，至6月大致完成建仓工作。此后，我们将组合调整重点转至优化组合结构。在此期间对整体组合的外汇敞口进行了主动管理和对冲。

#### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2020年6月30日，本基金份额净值为1.0115元；份额累计净值为1.0115元；本报告期，本基金份额净值增长率为1.15%，同期业绩比较基准收益率为3.27%

#### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

在市场波动剧烈背景下，政府和央行全力支撑经济和金融市场，使得美元债市场在迅速反弹后已经接近历史高点，我们对未来市场走势持谨慎乐观的展望。由于美联储持等海外央行持续QE，并持续向市场提供流动性，维持极低利率水平，预期美元债将随之从中获益。考虑到疫情发展仍具有高度不确定性，在美元货币超发导致的普涨后期将出现信用分化。同时，我们也关注到中美关系的变化和美元走弱的趋势，亦可能对组合的外汇和债券价格出现阶段性的影响。

#### **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

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”）在富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）（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，对本基金投资运作的监督，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 托管人对本中期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 中期财务报表(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 (2020年06月30日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,559,300.91
结算备付金	7,270,251.49
存出保证金	2,432,100.00
交易性金融资产	177,488,175.66
其中：股票投资	—
基金投资	8,953,882.58
债券投资	168,534,293.08
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	18,802,523.84
应收利息	2,103,364.49
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	209,655,716.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2020年06月30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	—
应付管理人报酬	136,910.25
应付托管费	34,227.54
应付销售服务费	—
应付交易费用	175.00
应交税费	22,351.68
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	42,639.50
负债合计	236,303.97
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	207,028,603.98
未分配利润	2,390,808.44
所有者权益合计	209,419,412.42
负债和所有者权益总计	209,655,716.39

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0115，基金份额总额 207,028,603.98 份。本基金合同生效日 2020 年 04 月 07 日。

## 6.2 利润表

会计主体：富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2020 年 04 月 07 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效 日)至 2020 年 6 月 30
-----	--

	日
<b>一、收入</b>	2,963,787.86
1. 利息收入	1,569,906.23
其中：存款利息收入	44,490.36
债券利息收入	1,226,747.02
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	298,668.85
证券出借利息收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-472,841.49
其中：股票投资收益	—
基金投资收益	-63,858.42
债券投资收益	54,469.39
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	-484,311.29
股利收益	20,858.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,238,183.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-371,460.71
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—
<b>减：二、费用</b>	572,979.42
1. 管理人报酬	381,254.87
2. 托管费	95,313.71
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	22,643.33
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 税金及附加	4,394.41
7. 其他费用	69,373.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	2,390,808.44
减：所得税费用	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	2,390,808.44

注：本基金合同生效日为2020年4月7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：富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2020年04月07日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020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）	207,028,603.98	—	207,028,603.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	2,390,808.44	2,390,808.44
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）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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）	207,028,603.98	2,390,808.44	209,419,412.42

注：本基金合同生效日为2020年4月7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

富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）（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]2235号文《关于准予富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自2020年4月1日至2020年4月3日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（2020）验字第60467606\_B14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2020年4月7日正式生效。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）共折合人民币207,028,603.98元，折合基金份额207,028,603.98份，其中人民币份额206,380,686.86元，折合基金份额206,380,686.86份；美元现汇份额91,550.69元，折合人民币647,917.12元，折合基金份额647,917.12份。募集资金在募集期间未产生利息。以上收到的实收基金（本息）共折合人民币207,028,603.98元，折合基金份额207,028,603.98份，其中人民币份额206,380,686.86元，折合基金份额206,380,686.86份；美元现汇份额91,550.69元，折合人民币647,917.12元，折合基金份额647,917.12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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行。



本基金投资于境内境外市场。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：

- 1、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；
- 2、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；
- 3、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；
- 4、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；
- 5、远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；
- 6、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。

针对境内投资，本基金可投资于国内债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、国债期货和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

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，投资于亚洲市场债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于境内发行的债券资产的比例不高于基金资产的 20%。每个交易日日终，在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

“亚洲市场债券”包括亚洲国家或地区的政府发行的债券，登记注册在亚洲国家或地区或主要业务收入/资产在亚洲国家或地区的机构、企业等发行的债券。

如果法律法规对上述比例要求有变更的，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。

本基金的业绩基准为：彭博巴克莱新兴市场亚洲高等级美元信用债指数收益率  $\times 80\%$  + 人民币活期存款利率（税后）  $\times 20\%$

#### 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

度报告和中期报告》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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 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 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 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股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具等；

###### **(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股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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或现金股利，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，或该金融资产已转移，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；

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);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) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

#### (2) 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;

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

#### (4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认;

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益,股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

#### (6) 回购协议

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。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。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

### 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摊余成本及实际利率（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) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 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；

(7) 权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(11) 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分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每一基金份额享有同等分配权。如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可按监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施前在指定媒介公告。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### **6.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **6.4.4.13 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **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**

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。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；

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费附加的单位外）及地方教育费附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
活期存款	1,559,300.91
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	1,559,300.91

注：

本基金本报告期末未持有定期存款。本基金合同生效日为2020年04月07日。无上年度同期对比数据。

币种	2020年6月30日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
美元	187,736.69	7.0795	1,329,081.90

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	—	—	—	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	9,907,160.00	9,916,000.00	8,840.00
	其它场外交易市场	157,005,963.54	158,618,293.08	1,612,329.54
	合计	166,913,123.54	168,534,293.08	1,621,169.54
资产支持证券	—	—	—	
基金	8,954,391.15	8,953,882.58	-508.57	
其他	—	—	—	
合计	175,867,514.69	177,488,175.66	1,620,660.97	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

金额单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—	—
其他衍生工具	-95,847,841.29	—	—	—
合计	-95,847,841.29	—	—	—

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
应收活期存款利息	21.41
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,016.80
应收债券利息	2,101,326.28
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	—
合计	2,103,364.49

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元



项目	本期末（2020年06月30日）
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	175.00

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	30,000.00
预提审计费	12,639.50
合计	42,639.50

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日2020年4月7日	207,028,603.98	207,028,603.98
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	207,028,603.98	207,028,603.98

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于2020年4月7日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币207,028,603.98元，在募集期间产生的存款利息为人民币0.00元，以上实收基金(本息)合计为人民币207,028,603.98元，折合207,028,603.98份基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日2020年4月7日	—	—	—
本期利润	152,624.61	2,238,183.83	2,390,808.44
本期基金份额交易产生的变动	—	—	—

数			
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	152,624.61	2,238,183.83	2,390,808.44

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6月30日
活期存款利息收入	34,485.45
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	10,004.91
其他	—
合计	44,490.36

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	3,732,465.20
减：卖出/赎回基金成本总额	3,796,323.62
基金投资收益	-63,858.42

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	16,149,881.18
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	16,079,523.85
减：应收利息总额	15,887.94
买卖债券差价收入	54,469.39

#### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
外汇期货投资收益	-484,311.29

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	—
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	20,858.83
合计	20,858.83

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,620,122.54
股票投资	—
债券投资	1,621,169.54
资产支持证券投资	—
基金投资	-1,047.00
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	618,061.29
权证投资	—
期货投资	618,061.29
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—

合计	2,238,183.83
----	--------------

#### 6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	22,468.33
银行间市场交易费用	175.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	22,643.33

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	12,639.50
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	26,333.60
其他	400.00
合计	69,373.10

#### 6.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通国际证券集团有限公司(“海通国际”)	基金管理人的股东控制的子公司

摩根大通银行	基金境外托管行
--------	---------

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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2020年04月07日，无上年度同期对比数据。

###### 6.4.10.1.2 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2020年04月07日，无上年度同期对比数据。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
HAITONG INTERNATIONAL	10,594,820.07	7.06
JPMorgan	16,777,065.00	11.19

注：本基金合同生效日为2020年04月07日，无上年度同期对比数据。

###### 6.4.10.1.4 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2020年04月07日，无上年度同期对比数据。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

###### 6.4.10.1.6 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2020年04月07日。无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	381,254.87
其中：支付销售机构的客户维护费	6,395.78

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2020年4月7日(基金合同生效日)至2020
----	---------------------------

	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	95,313.71

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证

##### 券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的

##### 证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2020 年 04 月 07 日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.5.2 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未投资本基金。本基金合同生效日为 2020 年 04 月 07 日，无上年度末对比数据。

#### 6.4.10.6 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 2020 年 4 月 7 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	230,258.80	34,485.45
摩根大通银行	1,329,042.11	0.00

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

—

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2020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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证

券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金净值的10%，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过合同及法规规定。本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资等。

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。



单位：人民币元

本期末（2020年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,559,300.91	—	—	—	—	—	1,559,300.91
结算备付金	7,270,251.49	—	—	—	—	—	7,270,251.49
存出保证金	2,432,100.00	—	—	—	—	—	2,432,100.00
交易性金融资产	—	—	66,984,734.45	97,977,030.54	3,572,528.09	8,953,882.58	177,488,175.66
应收证券清算款	—	—	—	—	—	18,802,523.84	18,802,523.84
应收利息	—	—	—	—	—	2,103,364.49	2,103,364.49
资产总计	11,261,652.40	—	66,984,734.45	97,977,030.54	3,572,528.09	29,859,770.91	209,655,716.39
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	136,910.25	136,910.25
应付托管费	—	—	—	—	—	34,227.54	34,227.54
应付交易费用	—	—	—	—	—	175.00	175.00
应付税费	—	—	—	—	—	22,351.68	22,351.68
其他负债	—	—	—	—	—	42,639.50	42,639.50
负债总计	—	—	—	—	—	236,303.97	236,303.97
利率敏感度缺口	11,261,652.40	—	66,984,734.45	97,977,030.54	3,572,528.09	29,623,466.94	209,419,412.42

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）
		本期末（2020年06月30日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-325,203.09
	2. 基准点利率减少0.1%	325,203.09

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）				合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产					
银行存款	1,329,081.90	—	—	—	1,329,081.90
交易性金融资产	167,572,175.66	—	—	—	167,572,175.66
结算备付金	2,436,134.82	—	—	—	2,436,134.82
应收利息	2,078,518.06	—	—	—	2,078,518.06
资产合计	173,415,910.44	—	—	—	173,415,910.44
以外币计价的负债					
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	173,415,910.44	—	—	—	173,415,910.44

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。
----	--

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：元）
		本期末（2020年06月30日）
	美元相对人民币贬值1%	-1,734,159.10
	美元相对人民币升值1%	1,734,159.10

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于亚洲债券市场，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金主要投资于亚洲债券市场，通过积极主动的资产管理，在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下，通过积极和深入的研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。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，投资于亚洲市场债券的资产占非现金基金资产的比例不低于80%；投资于境内发行的债券资产的比例不高于基金资产的20%。每个交易日日终，在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

金额单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	—	—
交易性金融资产—基金投资	8,953,882.58	4.28
交易性金融资产—债券投资	168,534,293.08	80.48
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	177,488,175.66	84.75

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券，因此其他价格风险因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 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2020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8,953,882.58元，属于第二层次的余额为人民币168,534,293.08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：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	8,953,882.58	4.27%
3	固定收益投资	168,534,293.08	80.39%
	其中：债券	168,534,293.08	80.39%

	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	8,829,552.40	4.21
8	其他各项资产	23,337,988.33	11.13
9	合计	209,655,716.39	100.00

## 7.2 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。

## 7.3 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。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

## 7.6 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（%）
A+	3,572,528.09	1.71
A	12,726,051.78	6.08
A-	19,920,509.49	9.51
Baa1	5,734,876.40	2.74
Baa2	10,635,320.47	5.08
Ba3	3,565,837.96	1.70
BBB+	7,101,375.66	3.39

BBB	29,332,131.30	14.01
BBB-	6,470,967.42	3.09
BB	19,355,784.86	9.24
BB+	11,613,601.18	5.55
BB-	22,903,336.47	10.94
B	8,517,657.95	4.07
NA	7,084,314.05	3.39

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。

### 7.7 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200206	20 国开 06	100,000	9,916,000.00	4.73
2	WUXIND 5.3 12/19/21	WUXIND 5.3 12/19/21	10,000	7,167,993.75	3.42
3	CNSHAN 3.8 06/01/21	CNSHAN 3.8 06/01/21	10,000	7,101,375.66	3.39
4	CNSHAN 3.95 08/01/22	CNSHAN 3.95 08/01/22	10,000	7,076,668.20	3.38
5	DALWAN 6 7/8 07/23/23	DALWAN 6 7/8 07/23/23	10,000	6,757,311.96	3.23

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	外汇期货	UC2009	—	—

注：

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)
UC2009	UC2009	-134	-95,229,780.00	618,061.29
公允价值变动总额合计(元)				618,061.29
股指期货投资本期公允价值变动(元)				618,061.29

### 7.10 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	INVESCO FUNDS SICAV	开放式	普通开放式基金	Invesco Funds	7,295,509.70	3.48
2	PIMCO-HI YIELD BD-\$IN ST INC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	1,658,372.88	0.79

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

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。

#### 7.11.3 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	2,432,100.00
2	应收证券清算款	18,802,523.84
3	应收股利	—
4	应收利息	2,103,364.49
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	23,337,988.33

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 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。

### § 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

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(%)
243	851,969.56	199,996,000.00	96.60	7,032,603.98	3.40

#### 8.2 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	464,957.43	0.2246

#### 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	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



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年04月07日)基金份额总额	207,028,603.98
基金合同生效日2020年4月7日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日2020年4月7日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日2020年4月7日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	207,028,603.98

## § 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。

### 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		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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOC HONG KONG BRANCH	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Security Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCOM International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CIMB Securities Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC Securities	0	—	—	5,002,661.56	3.34	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchant International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Renaissance	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Citigroup Global Markets Limited	0	—	—	16,151,709.11	10.77	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	2,752,259.47	1.83	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guo Yuan Securities (Hong Kong) Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securities HK Finacial Holding CO LTD	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK)	0	—	—	23,402,413.06	15.60	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HAITONG INTERNATIONAL	0	—	—	10,594,820.07	7.06	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HSBC	0	—	—	26,284,391.02	17.52	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings	0	—	—	7,738,018.20	5.16	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ICBC International Securities	0	—	—	24,054,209.24	16.04	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
JPMorgan	0	—	—	16,777,065.00	11.19	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Jefferies	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

Macquarie Bank Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	0	—	—	11,899,961.57	7.93	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Orient Securities (HongKong) Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Sanford C. Bernstein 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	—	—	5,335,689.26	3.56	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	561,300,000.00	27.96	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	202,300,000.00	10.08	—	—	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	320,300,000.00	15.96	—	—	—	—	—	—	—
新时代证券	2	—	—	—	—	154,800,000.00	7.71	—	—	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	206,300,000.00	10.28	—	—	—	—	—	—	—
浙商证券	2	—	—	—	—	46,800,000.00	2.33	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	515,600,000.00	25.68	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国亚洲收益债券型证券投资基金 QDII 基金合同生效公告	规定披露媒介	2020 年 04 月 08 日

## § 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	2020-04-07 至 2020-06-30	49,999,000.00	-	-	49,999,000.00	24.15%
	2	2020-04-07 至 2020-06-30	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	48.30%
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>							

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）的文件 2、富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）基金合同	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	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： <a href="http://www.fullgoal.com">http://www.fullgoal.com</a>

<p>3、富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国亚洲收益债券型证券投资基金（QDII）财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>		<p>om. cn。</p>
---	--	----------------