

富国中证国有企业改革指数分级证券投资 基金

招募说明书（更新）

（摘要）

（二〇一六年第一号）

【重要提示】

富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）已于2014年11月18日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2014】1206号）。本基金的基金合同于2014年12月17日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相

对稳定的特征；富国国企改革 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止至 2016 年 6 月 17 日，基金投资组合报告截止至 2016 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

一、基金管理人概况

名称：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：(021) 20361818

传真：(021) 20361616

联系人：范伟隽

注册资本：1.8 亿元人民币

股权结构（截止于 2016 年 6 月 17 日）：

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申万宏源证券有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托股份有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设二十三个部门、三个分公司和二个子公司，分别是：权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益研究部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、董事会办公室、综合管理部、机构业务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、信息技术部、运营部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理（香港）有限公司、富国资产管理（上海）有限公司。权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益投资部：负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分（包括公司自有资金等）的投资管理；固定收益专户投资部：负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理；固定收益研究部：负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分的研究管理等；；量化投资部：负责公司有关量化投资管理业务；海外权益投资部：负责公司在境外（含香港）的权益投资管理，包括 QDII 权益类公募基金、以香港投资为主的沪港深权益类公募基金、以香港权益及权益类衍生品为主的专户投资基金等；权益专户投资部：负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理；养老金投资部：负责养老金（企业年金、职业年金、基本养老金、社保等）及类养老金专户等产品的投资管理；权益研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责投资交易和风险控制；董事会办公室：履行公司章程规定的工作职责，暂与综合管理部合署办公；综合管理部：负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司（内部）宣传、信息调研、行政后勤管理等工作；机构业务部：负责年金、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作；零售业务部：管理华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心（广州分公司）、北方营销中心（北京分公司）、西部营销中心（成都分公司）、华北营销中心，负责共同基金的零售业务；营销管理部：负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒体关系管理,为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持；客户服务部：拟定客户服务策略，制定客户服务规范，建设客户服务团队，提高客户满意度，收集客户信息，分析客户需求，支持公司决策；电子商务部：负责基金电子商务发展趋势分析，拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则，有效推进公司电子商务业务；战略与产品部：负责开发、维护公募和非公募产品，协助管

理层研究、制定、落实、调整公司发展战略，建立数据搜集、分析平台，为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持；监察稽核部：负责监察、风控、法务和信息披露；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；富国资产管理（香港）有限公司：证券交易、就证券提供意见和提供资产管理；富国资产管理（上海）有限公司：经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

截止到 2016 年 5 月 31 日，公司有员工 334 人，其中 62.3%以上具有硕士以上学历。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

薛爱东先生，董事长，研究生学历，高级经济师。历任交通银行扬州分行监察室副主任、办公室主任、会计部经理、证券部经理，海通证券股份有限公司扬州营业部总经理，兴安证券有限责任公司托管组组长，海通证券股份有限公司黑龙江管理总部总经理兼党委书记、上海分公司总经理兼党委书记、公司机关党委书记兼总经理办公室主任。

陈戈先生，董事，总经理，研究生学历。历任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、基金经理、研究部总经理、总经理助理、副总经理，2005 年 4 月至 2014 年 4 月任富国天益价值证券投资基金基金经理。

麦陈婉芬女士（Constance Mak），董事，文学及商学学士，加拿大注册会计师。现任 BMO 金融集团亚洲业务总经理（General Manager, Asia, International, BMO Financial Group），中加贸易理事会董事和加拿大中文电视台顾问团的成员。历任 St. Margaret's College 教师，加拿大毕马威（KPMG）会计事务所的合伙人。

方荣义先生，董事，研究生学历，高级会计师。现任申万宏源证券有限公司副总经理、财务总监。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任，厦门大学工商管理教育中心副教授，中国人民银行深圳经济特区分行（深圳市中心支行）会计处副处长，中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构处处

长，中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长，申银万国证券股份有限公司财务总监。

裴长江先生，董事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司副总经理。历任上海万国证券公司研究部研究员、闸北营业部总经理助理、总经理，申银万国证券公司闸北营业部总经理、浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监，华宝兴业基金管理有限公司董事兼总经理。

Edgar Normund Legzdins 先生，董事，本科学历，加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团国际业务全球总裁（SVP & Managing Director, International, BMO Financial Group）。1980 年至 1984 年在 Coopers & Lybrand 担任审计工作；1984 年加入加拿大 BMO 银行金融集团蒙特利尔银行。

蒲冰先生，董事，本科学历，中级审计师。现任山东省国际信托股份有限公司自营业务部副总经理。历任山东正源和信会计师事务所审计部、评估部员工，山东省鲁信置地有限公司计财部业务经理，山东省国际信托有限公司计财部业务经理，山东省国际信托股份有限公司合规审计部副总经理。

张克均先生，董事，研究生学历。现任申万宏源证券有限公司战略规划总部总经理。历任福建兴业银行厦门分行电脑部副经理、计划部副经理、证券部副经理、杏林支行副行长；申银万国证券股份有限公司厦门证券营业部副经理、经理、深圳分公司副总经理兼厦门夏禾路证券营业部经理、经纪总部总经理。

黄平先生，独立董事，研究生学历。现任上海盛源实业（集团）有限公司董事局主席。历任上海市劳改局政治处主任；上海华夏立向实业有限公司副总经理；上海盛源实业（集团）有限公司总经理、总裁。

伍时焯（Cary S. Ng）先生，独立董事，研究生学历，加拿大特许会计师。现任圣力嘉学院（Seneca College）工商系会计及财务金融科教授。1976 年加入加拿大毕马威会计事务所的前身 Thorne Riddell 公司担任审计工作，有 30 余年财务管理及信息系统项目管理经验，曾任职在 Neo Materials Technologies Inc. 前身 AMR Technologies Inc., MLJ Global Business Developments Inc., UniLink Tele.com Inc. 等国际性公司为首席财务总监 (CFO) 及财务副总裁。

李宪明先生，独立董事，研究生学历。现任上海市锦天城律师事务所律师、高级合伙人。历任吉林大学法学院教师。

2、监事会成员

岳增光先生，监事长，本科学历，高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司纪委书记、风控总监。历任山东省济南市经济发展总公司会计，山东正源和信有限责任会计师事务所室主任，山东鲁信实业集团公司财务，山东省鲁信投资控股集团有限公司财务，山东省国际信托股份有限公司财务部经理。

沈寅先生，监事，本科学历。现任申银宏源证券有限公司合规与风险管理总部总经理助理及公司律师。历任上海市中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长；上海市第二中级人民法院办公室综合科科长。

夏瑾璐女士，监事，研究生学历。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。历任上海大学外语系教师；荷兰银行上海分行结构融资部经理；蒙特利尔银行金融机构部总裁助理；荷兰银行上海分行助理副总裁。

仇夏萍女士，监事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司计划财务部总经理。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所任职；在华夏证券有限公司东方路营业部任职。

孙琪先生，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司 IT 副总监。历任杭州恒生电子股份公司职员，东吴证券有限公司职员，富国基金管理有限公司系统管理员、系统管理主管、IT 总监助理。

唐洁女士，监事，本科学历，CFA。现任富国基金管理有限公司策略研究员。历任上海夏商投资咨询有限公司研究员，富国基金管理有限公司研究助理、助理研究员。

王旭辉先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司华东营销中心总经理。历任职于郟县政府办公室职员，郟县国营一厂厂长，富国基金管理有限公司客户经理、高级客户经理。

陆运天先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司电子商务部电子商务总监助理。历任汇添富基金任电子商务经理，富国基金管理有限公司资深电子商务经理。

3、督察长

范伟隽先生，督察长。中共党员，硕士研究生。曾任毕马威华振会计师事务所项目经理，中国证监会上海监管局主任科员、副处长。2012年10月20日开始担任富国基金管理有限公司督察长。

4、经营管理层人员

陈戈先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

林志松先生，副总经理。中共党员，大学本科，工商管理硕士。曾在漳州商检局办公室、晋江商检局检验科、厦门证券公司投资发展部工作。曾任富国基金管理有限公司监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、经理、督察长。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

陆文佳女士，研究生学历，13年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理。历任中国建设银行上海市分支行职员、经理，华安基金管理有限公司上海营销总部投资顾问、总监助理、市场部总监助理、上海分公司总经理助理、市场部总经理、市场总监、公司副营销总裁。

李笑薇女士，研究生学历，高级经济师，13年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。历任国家教委外资贷款办公室项目官员，摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCIBARRA）BARRA 股票风险评估部高级研究员，巴克莱国际投资管理公司（Barclays Global Investors）大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员，富国基金管理有限公司量化与海外投资部总经理兼基金经理、总经理助理兼量化与海外投资部总经理兼基金经理。

朱少醒先生，研究生学历，16年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。历任富国基金管理有限公司产品开发主管、基金经理助理、基金经理、研究部总经理兼基金经理、总经理助理兼研究部总经理兼基金经理、总经理助理兼权益投资部总经理兼基金经理。5、本基金基金经理

（1）现任基金经理：

1) 王保合先生，博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起任富国中证

移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理, 2015 年 5 月起任富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金基金经理; 兼任量化投资总监。具有基金从业资格。

2) 张圣贤先生, 硕士, 自 2007 年 7 月至 2015 年 3 月任上海申银万国证券研究所有限公司分析师; 自 2015 年 3 月至 2015 年 6 月任富国基金管理有限公司基金经理助理; 2015 年 6 月起任富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理; 2015 年 8 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; 2016 年 2 月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。具有基金从业资格。

(2) 本基金历任基金经理: 章榭元先生自 2014 年 12 月至 2015 年 5 月担任本基金基金经理。

6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下:

投资决策委员会成员构成如下: 公司总经理陈戈先生, 主动权益及固定收益投资副总经理朱少醒先生和量化与海外投资副总经理李笑薇女士。

列席人员包括: 督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。

本基金采取集体投资决策制度。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称: 中国农业银行股份有限公司 (简称中国农业银行)

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人: 刘士余

成立日期: 2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保

障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 334 只。

(二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

一、基金销售机构

1、直销机构：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16、17层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16、17层

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

直销网点：上海投资理财中心

上海投资理财中心地址：上海市杨浦区大连路588号宝地广场A座23楼

电话：(021) 20361818

传真：(021) 20361544

联系人：林燕珺

客户服务统一咨询电话：95105686，4008880688

公司网站：www.fullgoal.com.cn

2. 场外代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法人代表：刘士余（已不担任法人代表）

联系电话：（010）85108227

传真电话：（010）85109219

联系人员：曾艳

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

（2）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法人代表：姜建清

联系电话：（010）95588

传真电话：（010）95588

联系人员：杨先生

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

（3）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法人代表：田国立

联系电话：（010）66594946

传真电话：（010）66594946

联系人员：陈洪源

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（4）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法人代表：王洪章

联系电话：（010）66275654

传真电话：010—66275654

联系人员：张静

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

（5）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法人代表：牛锡明

联系电话：（021）58781234

传真电话：（021）58408483

联系人员：张宏革

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法人代表：李建红

联系电话：（0755）83198888

传真电话：（0755）83195109

联系人员：曾里南

客服电话：95555

公司网站：www.cmbchina.com

（7）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号文化大厦

法人代表：常振明

联系电话：（010）65550827

传真电话：（010）65550827

联系人员：常振明

客服电话： 95558

公司网站： bank.ecitic.com

(8)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址： 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址： 上海市北京东路 689 号

法人代表： 吉晓辉

联系电话： (021) 61618888

传真电话： (021) 63604199

联系人员： 唐小姐

客服电话： 95528

公司网站： www.spdb.com.cn

(9)中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址： 北京市西城区金融大街 3 号

法人代表： 李国华

联系电话： (010) 68858057

传真电话： (010) 68858057

联系人员： 王硕

客服电话： 95580

公司网站： www.psbc.com

(10)华夏银行股份有限公司

注册地址： 北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址： 北京市东城区建国门内大街 22 号

法人代表： 吴建

联系电话： 010-85238667

传真电话： 010-85238680

联系人员： 郑鹏

客服电话： 95577

公司网站： www.hxb.com.cn

(11)深圳平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法人代表：肖遂宁

联系电话：（0755）22197874

传真电话：（0755）22197874

联系人员：蔡宇洲

客服电话：95511-3

公司网站：www.bank.pingan.com

（12）东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：东莞市莞城区体育路 21 号

法人代表：廖玉林

联系电话：0769-22100193

传真电话：0769-22117730

联系人员：巫渝峰

客服电话：0769-96228

公司网站：www.dongguanbank.cn

（13）东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市莞城南城路 2 号

办公地址：东莞市莞城南城路 2 号

法人代表：何沛良

联系电话：0769-22866268

传真电话：0769-22866268

联系人员：何茂才

客服电话：0769-961122

公司网站：www.drcbank.com

（14）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法人代表：杨德红

联系电话：（021）38676666

传真电话：（021）38670666

联系人员：芮敏琪

客服电话：400-8888-666/ 95521

公司网站：www.gtja.com

（15）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法人代表：王常青

联系电话：（010）65183888

传真电话：（010）65182261

联系人员：权唐

客服电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

（16）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法人代表：何如

联系电话：（0755）82130833

传真电话：（0755）82133952

联系人员：周杨

客服电话：95536

公司网站：www.guosen.com.cn

（17）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法人代表：宫少林

联系电话：（0755）82943666

传真电话：（0755）82943636

联系人员：林生迎

客服电话： 95565、400-8888-111

公司网站： www.newone.com.cn

(18) 中信证券股份有限公司

注册地址： 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场二期北座

办公地址： 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法人代表： 张佑君

联系电话： (010) 84588888

传真电话： (010) 84865560

联系人员： 顾凌

客服电话： 95558

公司网站： www.cs.ecitic.com

(19) 中国银河证券股份有限公司

注册地址： 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址： 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法人代表： 陈有安

联系电话： (010) 66568292

传真电话： (010) 66568990

联系人员： 邓颜

客服电话： 4008-888-888

公司网站： www.chinastock.com.cn

(20) 海通证券股份有限公司

注册地址： 上海市广东路 689 号

办公地址： 上海市广东路 689 号

法人代表： 王开国

联系电话： (021) 23219000

传真电话： (021) 23219000

联系人员： 李笑鸣

客服电话： 95553

公司网站： www.htsec.com

(21) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法人代表：李梅

联系电话：（021）33389888

传真电话：（021）33388224

联系人员：黄莹

客服电话：95523 或 4008895523

公司网站：www.swhysc.com

（22）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法人代表：余维佳

联系电话：023-63786464

传真电话：023-637862121

联系人员：张煜

客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

（23）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

法人代表：余政

联系电话：（010）85127999

传真电话：（010）85127917

联系人员：赵明

客服电话：400-6198-888

公司网站：www.msza.com

（24）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法人代表：吴万善

联系电话：0755-82569143

传真电话：0755-82492962

联系人员：孔晓君

客服电话：95597

公司网站：www.htsc.com.cn

(25) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法人代表：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真电话：0532-85022605

联系人员：吴忠超

客服电话：95548

公司网站：www.citicssd.com

(26) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法人代表：张志刚

联系电话：010-63080985

传真电话：01063080978

联系人员：唐静

客服电话：95321

公司网站：www.cindasc.com

(27) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法人代表：薛峰

联系电话：021-22169999

传真电话：021-22169134

联系人员：刘晨、李芳芳

客服电话： 95525

公司网站： www.ebscn.com

(28)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法人代表：杨宇翔

联系电话：95511-8

传真电话： 95511-8

联系人员： 吴琼

客服电话： 95511-8

公司网站： stock.pingan.com

(29)国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法人代表：常喆

联系电话：（010）84183333

传真电话：（010）84183311-3389

联系人员： 黄静

客服电话： 400-818-8118

公司网站： www.guodu.com

(30)华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法人代表：杨炯洋

联系电话：010-52723273

传真电话： 028-86157275

联系人员： 谢国梅

客服电话： 95584

公司网站： www.hx168.com.cn

(31)申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

法人代表：许建平

联系电话：010-88085858

传真电话：010-88085858

联系人员：李巍

客服电话：4008-000-562

公司网站：www.hysec.com

(32) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法人代表：李玮

联系电话：0531-68889155

传真电话：0531-68889185

联系人员：吴阳

客服电话：95538

公司网站：www.qlzq.com.cn

(33) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法人代表：王宜四

联系电话：0791-86768681

传真电话：0791-86770178

联系人员：戴蕾

客服电话：400-8866-567

公司网站：www.avicsec.com

(34) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 3 层

法人代表：李剑阁

联系电话：010-65051166

传真电话：010-65051166

联系人员：陶亭

客服电话：010-65051166

公司网站：<http://www.cicc.com.cn>

(35) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层
-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21
层

法人代表：高涛

联系电话：(0755) 82023442

传真电话：(0755) 82026539

联系人员：张鹏

客服电话：95532、400-600-8008

公司网站：www.china-invs.cn

(36) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层

法人代表：祝献忠

联系电话：010-85556012

传真电话：010-85556053

联系人员：李慧灵

客服电话：400-898-9999

公司网站：www.hrsec.com.cn

(37) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法人代表：余磊

联系电话：027-87610052

传真电话：027-87618863

联系人员：杨晨

客服电话：4008005000

公司网站：www.tfzq.com

(38) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法人代表：汪静波

联系电话：021-3860-0672

传真电话：021-3860-2300

联系人员：张姚杰

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(39) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法人代表：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真电话：0755-82080798

联系人员：汤素娅

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn

(40) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法人代表：其实

联系电话：021-54509998

传真电话：021-64385308

联系人员： 潘世友

客服电话： 400-1818-188

公司网站： www.1234567.com.cn

(41) 上海好买基金销售有限公司

注册地址： 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址： 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法人代表： 杨文斌

联系电话： (021) 58870011

传真电话： (021) 68596916

联系人员： 张茹

客服电话： 4007009665

公司网站： www.ehowbuy.com

(42) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址： 杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址： 浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法人代表： 凌顺平

联系电话： 0571-88911818

传真电话： 0571-86800423

联系人员： 吴强

客服电话： 4008-773-772

公司网站： www.5ifund.com

(43) 上海利得基金销售有限公司

注册地址： 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址： 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法人代表： 沈继伟

联系电话： 021-50583533

传真电话： 021-50583633

联系人员： 曹怡晨

客服电话： 400-067-6266

公司网站： <http://a.leadfund.com.cn>

(44)北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

法人代表：梁蓉

联系电话：（010）66154828

传真电话：（010）88067526

联系人员：张旭

客服电话：400-6262-818

公司网站：www.5irich.com

(45)上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法人代表：燕斌

联系电话：021-52822063

传真电话：021-52975270

联系人员：凌秋艳

客服电话：400-046-6788

公司网站：www.66zichan.com

(46)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法人代表：陈继武

联系电话：021-63333319

传真电话：021-63332523

联系人员：李晓明

客服电话：4000-178-000

公司网站：www.lingxianfund.com

(47)上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法人代表：郭坚

联系电话：021-20665952

传真电话：021-22066653

联系人员：宁博宇

客服电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

(48) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
B1201-1203

法人代表：肖雯

联系电话：020-89629099

传真电话：020-89629011

联系人员：吴煜浩

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金代销机构，并及时公告。

3、场内代销机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。本基金认购期结束前获得基金代销业务资格的会员单位经深圳证券交易所确认后也可代理场内基金份额的发售。

(二) 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：(010) 59378839

传真：(010) 59378907

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、 基金的名称

富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金

五、 基金的类型

股票型

六、 基金份额的分级

本基金的基金份额包括富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额（即“富国国企改革份额”）、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“富国国企改革 A 份额”）与富国中证国有企业改革指

数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“富国国企改革 B 份额”）。其中，富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

七、 基金的份额配对转换

本基金基金合同生效后，在富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理配对转换业务。

配对转换是指本基金的富国国企改革份额与富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

1、分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份富国国企改革份额的场内份额申请转换成 1 份富国国企改革 A 份额与 1 份富国国企改革 B 份额的行为。

2、合并

合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份富国国企改革 A 份额与 1 份富国国企改革 B 份额申请转换成 2 份富国国企改革份额的场内份额的行为。

八、 基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证国有企业改革指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

九、 基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证国有企业改革指数的成份股、备选成份股、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及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）。

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：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

十、 基金的投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证国有企业改革指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证国有企业改革指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证国有企业改革指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约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，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、股票投资组合构建

(1) 组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现。

（2）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证国有企业改革指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与中证国有企业改革指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

①定期调整

根据中证国有企业改革指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

②不定期调整

A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪中证国有企业改革指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在中证国有企业改革指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

4、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资

效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

十一、 业绩比较基准

$95\% \times \text{中证国有企业改革指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率(税后)}$

由于本基金投资标的指数为中证国有企业改革指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{中证国有企业改革指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率(税后)}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。若业绩比较基准和标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若业绩比较基准、标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名、指数编制方案调整等)，则无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应与基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

十二、 风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；富国国企改革 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

十三、 基金投资组合报告

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	13,376,887,997.30	91.94
	其中：股票	13,376,887,997.30	91.94
2	固定收益投资	1,634,316.20	0.01
	其中：债券	1,634,316.20	0.01
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	976,061,612.25	6.71
7	其他资产	195,327,390.97	1.34
8	合计	14,549,911,316.72	100.00

2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	404,357,312.54	2.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,451,062.50	0.03
E	建筑业	119,709.48	0.00
F	批发和零售业	47,574,592.28	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	13,960,797.11	0.10
L	租赁和商务服务业	77,590,890.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	548,054,363.91	3.81

3、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	24,371,382.00	0.17
B	采矿业	598,361,957.73	4.16
C	制造业	5,343,742,695.95	37.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	428,463,389.82	2.98
E	建筑业	737,854,567.48	5.13
F	批发和零售业	1,314,723,908.61	9.13
G	交通运输、仓储和邮政业	872,609,354.57	6.06
H	住宿和餐饮业	91,978,936.64	0.64
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,196,931,990.13	8.31
J	金融业	1,027,167,455.23	7.14
K	房地产业	536,280,733.66	3.73
L	租赁和商务服务业	424,489,606.93	2.95
M	科学研究和技术服务业	27,275,407.50	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	154,709,567.22	1.07
S	综合	49,872,679.92	0.35
	合计	12,828,833,633.39	89.12

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600153	建发股份	55,049,886	649,588,654.80	4.51
2	601328	交通银行	75,153,180	418,603,212.60	2.91
3	600637	东方明珠	13,808,043	395,600,431.95	2.75
4	601989	中国重工	48,786,259	350,773,202.21	2.44
5	600050	中国联通	78,634,777	345,206,671.03	2.40
6	600009	上海机场	11,112,074	334,362,306.66	2.32
7	601555	东吴证券	24,219,813	324,787,692.33	2.26
8	601669	中国电建	47,590,621	307,435,411.66	2.14
9	601390	中国中铁	34,909,478	281,021,297.90	1.95
10	000768	中航飞机	12,772,659	247,150,951.65	1.72

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	7,073,104	198,824,953.44	1.38
2	600104	上汽集团	4,326,680	86,793,200.80	0.60
3	600415	小商品城	10,142,600	77,590,890.00	0.54
4	000930	中粮生化	3,593,960	46,110,506.80	0.32
5	600433	冠豪高新	2,842,554	29,278,306.20	0.20

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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）	1,634,316.20	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,634,316.20	0.01

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128010	顺昌转债	13,010	1,634,316.20	0.01

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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、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。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

12、投资组合报告附注

(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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,419,778.10
2	应收证券清算款	182,636,689.77
3	应收股利	—
4	应收利息	214,703.68
5	应收申购款	1,056,219.42
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	195,327,390.97

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128010	顺昌转债	1,634,316.20	0.01

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600153	建发股份	649,588,654.80	4.51	筹划重大事项

2) 期末积极投资前五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五名积极投资股票中未持有流通受限的股票。

(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。

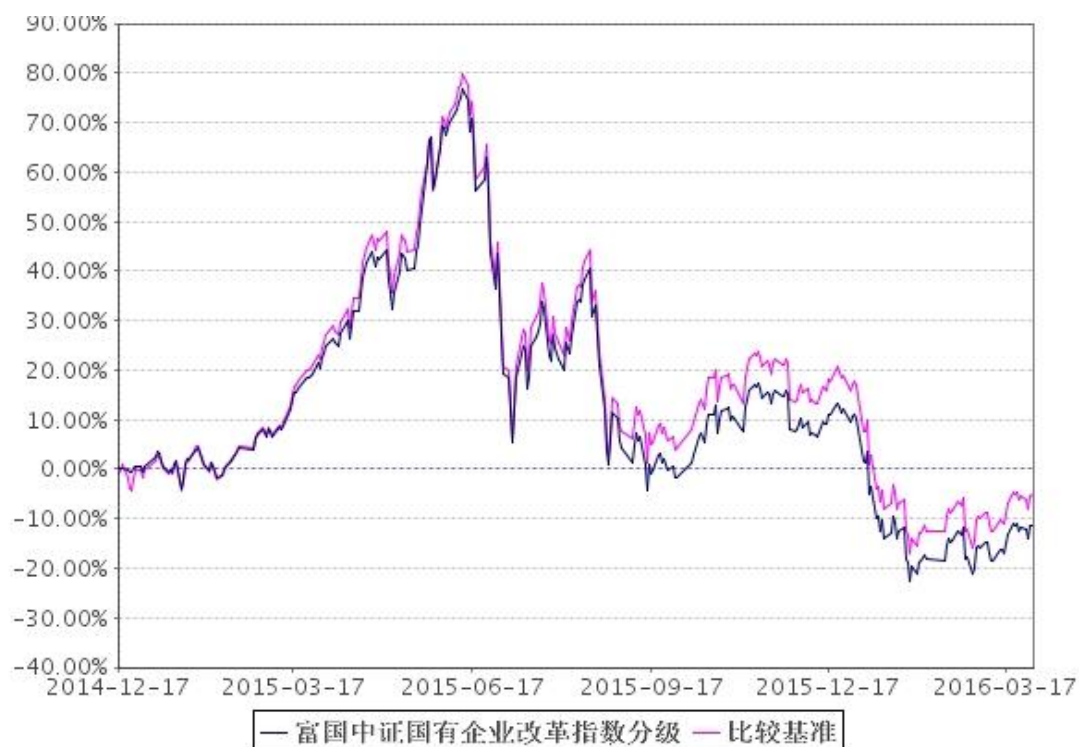
十四、 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.12.17-2014.12.31	0.60%	0.55%	-0.33%	1.60%	0.93%	-1.05%
2015.1.1-2015.12.31	9.66%	2.65%	17.20%	2.70%	-7.54%	-0.05%
2016.1.1-2016.3.31	-19.61%	2.98%	-18.84%	2.95%	-0.77%	0.03%
2014.12.17-2016.3.31	-11.32%	2.67%	-5.19%	2.71%	-6.13%	-0.04%

2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1. 截止日期为 2016 年 3 月 31 日。

2. 本基金于 2014 年 12 月 17 日成立，建仓期 6 个月，从 2014 年 12 月 17 日至

2015年6月16日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十五、 费用概览

一、与基金运作有关的费用

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的开户费用；
- 9、基金上市费用；
- 10、基金的指数使用许可费；
- 11、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。如上述指数许可使用协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数使用许可费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元。指数使用许可费将按照上述指数许可协议的约定进行支付。

4、除管理费、托管费和基金的指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）场外申购费率

本基金对通过直销中心场外申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。本公司设定的养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额M（含认购费）	申购费率
M<100万元	0.36%
100万元≤M<250万元	0.24%
250万元≤M<500万元	0.15%
M≥500万元	每笔1,000元

除上述养老金客户外,其他投资者申购本基金基金份额的场外申购费率见下表:

申购金额M(含认购费)	申购费率
M<100万元	1.20%
100万元≤M<250万元	0.80%
250万元≤M<500万元	0.50%
M≥500万元	每笔1,000元

(2) 场内申购费率

本基金的场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

2、赎回费率

本基金场内场外赎回费率都为 0.50%。

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低富国国企改革份额的申购费率和赎回费率。

三、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十六、 基金份额折算

一、定期份额折算

(一) 定期份额折算

每年的基金份额定期折算基准日，本基金将按以下规则对富国国企改革 A 份额和富国国企改革份额进行定期份额折算：

1、基金份额定期折算基准日

每年 12 月 15 日(若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日)。

2、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的富国国企改革 A 份额、富国国企改革份额。

3、基金份额折算频率

每年折算一次。

4、基金份额折算方式

定期份额折算后富国国企改革 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前富国国企改革 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为富国国企改革份额的场内份额分配给富国国企改革 A 份额持有人。富国国企改革份额持有人持有的每两份富国国企改革份额将按一份富国国企改革 A 份额获得新增富国国企改革份额的分配，经过上述份额折算后，富国国企改革份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，富国国企改革 A 份额和富国国企改革 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

有关计算公式如下：

(1) 富国国企改革份额

$$NAV_{\text{后}}^{\text{富国}} = \frac{\text{折算前富国国企改革份额的资产净值} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_{\text{后}}^{\text{富国}}}{NUM_{\text{后}}^{\text{富国}}}$$

富国国企改革份额持有人新增的富国国企改革份额

$$\frac{NUM_{\text{后}}^{\text{富国}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{后}}^{\text{富国}}}$$

=

其中：

$NAV_{\text{后}}^{\text{富}}$ ：折算后富国国企改革份额的基金份额净值，下同

$NAV_A^{\text{前}}$ ：折算前富国国企改革 A 份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_A^{\text{前}}$ ：折算前富国国企改革份额的份额数，下同

持有场外富国国企改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国国企改革份额的分配；持有场内富国国企改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国国企改革份额的分配。

（2）富国国企改革 A 份额

定期份额折算后富国国企改革 A 份额的基金份额参考净值=1.000 元

定期份额折算后富国国企改革 A 份额的份额数=定期份额折算前富国国企改革 A 份额的份额数

富国国企改革 A 份额持有人新增的场内富国国企改革份额的份额数

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{后}}^{\text{富}}}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：折算前富国国企改革 A 份额的份额数，下同

（3）富国国企改革 B 份额

定期份额折算不改变富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

（4）折算后的富国国企改革份额总份额数

折算后富国国企改革份额的总份额数=折算前富国国企改革份额的份额数+富国国企改革份额持有人新增的富国国企改革份额的份额数+富国国企改革 A 份额持有人新增的场内富国国企改革份额的份额数

（二）不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当富国国企改革份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上；当富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下。

1、当富国国企改革份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将按以下规则进行不定期份额折算：

(1) 基金份额不定期折算基准日

富国国企改革份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，基金管理人将确定不定期折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额和富国国企改革份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当富国国企改革份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额和富国国企改革份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国国企改革 A 份额和富国国企改革 B 份额的比例为 1:1，份额折算后富国国企改革 A 份额的基金份额参考净值、富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值和富国国企改革份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。基金份额折算基准日折算前富国国企改革份额的基金份额净值及富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为富国国企改革份额分别分配给富国国企改革份额、富国国企改革 A 份额和富国国企改革 B 份额的持有人。

1) 富国国企改革份额

富国国企改革份额持有人新增的富国国企改革份额数

$$= \frac{(NAV_{\text{前}} - 1.000) \times NUM_{\text{前}}}{1.000}$$

持有场外富国国企改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国国企改革份额的分配；持有场内富国国企改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国国企改革份额的分配。

2) 富国国企改革 A 份额

折算后富国国企改革 A 份额的份额数保持不变，即 $NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$

富国国企改革 A 份额持有人新增的场内富国国企改革份额的份额数

$$= \frac{(NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_A^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$ ：折算后富国国企改革 A 份额的份额数，下同

3) 富国国企改革 B 份额

折算后富国国企改革 B 份额的份额数保持不变，即 $NUM_B^{\text{后}} = NUM_B^{\text{前}}$

富国国企改革 B 份额持有人新增的场内富国国企改革份额的份额数

$$= \frac{(NAV_B^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_B^{\text{后}}$ ：折算后富国国企改革 B 份额的份额数，下同

$NUM_B^{\text{前}}$ ：折算前富国国企改革 B 份额的份额数，下同

$NAV_B^{\text{前}}$ ：折算前富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值，下同

4) 折算后富国国企改革份额的总份额数

折算后富国国企改革份额的总份额数=折算前富国国企改革份额的份额数+富国国企改革份额持有人新增的富国国企改革份额数+富国国企改革 A 份额持有人新增的场内富国国企改革份额数+富国国企改革 B 份额持有人新增的场内富国国企改革份额数

2、当富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将按以下规则进行不定期份额折算：

(1) 基金份额不定期折算基准日

富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，基金管理人将确定不定期折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额、富国国企改革份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对富国国企改革 A 份额、富国国企改革 B 份额和富国国企改革份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国国企改革 A 份额和富国国企改革 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后富国国企改革份额的基金份额净值、富国国企改革 A 份额和富国国企改革 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。富国国企改革份额、富国国企改革 A 份额和富国国企改革 B 份额的份额数将相应缩减。

1) 富国国企改革 B 份额

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

2) 富国国企改革 A 份额

折算后富国国企改革 A 份额与富国国企改革 B 份额的份额配比保持 1: 1 不变，即 $NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$

富国国企改革 A 份额持有人新增的场内富国国企改革份额的份额数=

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

3) 富国国企改革份额

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.000}$$

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：富国国企改革份额持有人持有的折算后的富国国企改革份额的份

额数，下同

4) 折算后富国国企改革份额的总份额数

折算后富国国企改革份额的总份额数=富国国企改革份额持有人持有的折算后的富国国企改革份额的份额数+富国国企改革 A 份额持有人新增的场内富国国企改革份额数

十七、 对招募说明书更新部分的说明

富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分增加了基金合同生效日、更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、在“第三部分 基金管理人”中，对基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。

3、对“第四部分 基金托管人”相关内容进行了更新。

4、在“第五部分 相关服务机构”中，对代销机构部分信息进行了更新。

5、“第十三部分 基金的投资”部分更新了基金投资组合报告，内容截止至2016年3月31日。

6、更新了“第十四部分 基金的业绩”，内容截止至2016年3月31日，并更新了历史走势对比图。

7、对“第二十六部分 基金份额持有人服务”部分内容进行了更新。

8、更新了“第二十七部分 其他应披露事项”，对本报告期内的其他事项进行披露。

富国基金管理有限公司

二〇一六年七月三十日