

# 上证综指交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

## (更新)

### 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会 2010 年 10 月 11 日证监许可【2010】1379 号文核准。本基金的基金合同于 2011 年 1 月 30 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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

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 2017 年 7 月 30 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2017 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

### 第一部分 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：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 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：赵瑛

注册资本：3 亿元人民币

股权结构（截止于 2017 年 07 月 30 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。

公司目前下设二十四部门、三个分公司和二子公司，分别是：权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、多元资产投资部、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、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、综合管理部（董事会办公室）、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；固定收益信用研究部：建立和完善债券信用评级体系，开展信用研究等，为公司固定收益类投资决策提供研究支持；固定收益策略研究部：开展固定收益投资策略研究，统一固定收益投资中台管理，为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制；多元资产投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责 FOF 基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理。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：负责在中国境外（含香港）的权益投资管理；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；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、广东营销中心、深圳营销中心、北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心，负责公募基金的零售业务；营销管理部：负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理，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；综合管理部（董事会办公室）：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；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 2017 年 6 月 30 日，公司有员工 384 人，其中 65.4%以上具有硕士以上学历。

## 二、主要人员情况

### （一）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. Margarets 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，博士，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、董事会秘书。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。

EdgarNormundLegzdins 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（SVPManagingDirector,International,BMOFinancialGroup）。1980 年至 1984 年在 CoopersLybrand 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，山东省国际信托股份有限公司自营业务部副总经理。

何宗豪先生，董事，硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务管理总部总经理。历任人民银行上海市徐汇区办事处计划信贷科、组织科科员；工商银行徐汇区办事处建国西路分理处党支部代书记、党支部书记兼分理处副主任（主持工作）；上海申银证券公司财会部员工；上海申银证券公司浦东公司财会部筹备负责人；上海申银证券公司浦东公司财会部副经理、经理；申银万国证券股份有限公司浦东分公司财会部经理、申银万国证券股份有限公司财会管理总部部门经理、总经理助理、申银万国证券股份有限公司计划财会管理总部副总经理、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。

季文冠先生，独立董事，研究生学历。现任上海金融业联合会常务副理事长。历任上海仪器仪表研究所计划科副科长、办公室副主任、办公室主任、副所长；上海市浦东新区综合规划土地局办公室副主任、办公室主任、局长助理、副局长、党组副书记；上海市浦东新区政府办公室主任、外事办公室主任、区政府党组成员；上海市松江区委常委、副区长；上海市金融服务办公室副主任、中共上海市金融工作委员会书记；上海市政协常委、上海市政协民族和宗教委员会主任。

伍时焯(CaryS.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(SenecaCollege)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 ThorneRiddell 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 NeoMaterialsTechnologiesInc.前身

AMRTechnologiesInc.,MLJGlobalBusinessDevelopmentsInc.,UniLinkTele.comInc.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。

## （二）监事会成员

付吉广先生，监事长，研究生学历。现任山东省国际信托股份有限公司风控总监。历任济宁信托投资公司投资部科员；济宁市留庄港运输总公司董事、副总经理；山东省国际信托投资有限公司投行业务部业务经理、副经理；山东省国际信托投资有限公司稽核法律部经理；山东省中鲁远洋渔业股份有限公司财务总监；山东省国际信托有限公司信托业务四部经理。

沈寅先生，监事，本科学历。现任申万宏源证券有限公司合规与风险管理中心法律合规总部副总经理，公司律师。历任上海市高、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审判员、办公室综合科科长。

张晓燕女士，监事，博士。现任蒙特利尔银行亚洲区和蒙特利尔银行（中国）有限公司首席风险官。历任美国加州理工学院化学系研究员；加拿大多伦多大学化学系助理教授；蒙特利尔银行市场风险管理部模型发展和风险审查高级经理；蒙特利尔银行操作风险资本管理总监；道明证券交易风险管理部副总裁兼总监；华侨银行集团市场风险控制主管；新加坡交易所高级副总裁和风险管理部主管。

侍旭先生，监事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司稽核部总经理助理，历任海通证券股份有限公司稽核部二级部经理等。

孙琪先生，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司信息技术部运维总监。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、IT 副总监。

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。

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副总监。历任汇添富基金电子商务经理，富国基金管理有限公司高级电子商务经理、资深电子商务经理、电子商务部电子商务总监助理。

## （三）督察长

赵瑛女士，研究生学历，硕士学位。曾任职于海通证券有限公司国际业务部、上海国盛（集团）有限公司资产管理部/风险管理部、海通证券股份有限公司合规与风险管理总部、上海海通证券资产管理有限公司合规与风控部；2015年7月加入富国基金管理有限公司，历任监察稽核部总经理，现任富国基金管理有限公司督察长。

#### （四）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，本科学历，工商管理硕士学位。曾任漳州进出口商品检验局秘书、晋江进出口商品检验局办事处负责人、厦门证券公司业务经理；1998年10月参与富国基金管理有限公司筹备，历任监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、部门经理、督察长，现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，硕士学位。曾任中国建设银行上海市分行职员，华安基金管理有限公司市场总监、副营销总裁；2014年5月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金管理有限公司副总经理。

李笑薇女士，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾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（BarclaysGlobalInvestors）大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009年6月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理、量化与海外投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。

朱少醒先生，研究生学历，博士学位。2000年6月加入富国基金管理有限公司，历任产品开发主管、基金经理助理、基金经理、研究部总经理、权益投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼权益投资部总经理兼基金经理。

#### （五）本基金基金经理

##### （1）现任基金经理：

王保合，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；兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。

方旻，硕士，自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015年5月起任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金的基金经理，2015年10月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017年6月起任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。

（2）历任基金经理：李笑薇自2011年1月至2012年5月担任本基金基金经理。

##### （六）投资决策委员会成员

公司投委会成员：总经理陈戈，分管副总经理朱少醒，分管副总经理李笑薇

##### （七）其他

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 第二部分基金托管人

##### （一）基金托管人基本情况

名称：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

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## （二）主要人员情况

截至 2017 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承诚实信用、勤勉尽责的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 709 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 53 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金销售机构

#### （一）直销机构

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼

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 楼

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

直销网点：直销中心

直销中心地址：上海市杨浦区大连路 588 号宝地广场 A 座 23 楼

客户服务统一咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

传真：021-80126257、80126253

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

#### （二）场外代销机构

##### (1)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

##### (2)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](http://www.gtja.com)

(3)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](http://www.csc108.com)

(4)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 3945 层  
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 3945 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](http://www.newone.com.cn)

(5)广发证券股份有限公司  
注册地址:广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)  
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼  
法人代表:孙树明  
联系电话: (020) 87555305  
传真电话: (020) 87555305  
联系人员: 黄岚  
客服电话: 95575  
公司网站: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(6)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](http://www.swhysc.com)

(7)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路 268 号

办公地址:浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法人代表:兰荣

联系电话:0591-38281963

传真电话: 0591-38281963

联系人员: 夏中苏

客服电话: 95562

公司网站: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(8)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址:武汉新华路特 8 号长江证券大厦

法人代表:尤习贵

联系电话:(027) 65799999

传真电话: 027-85481900

联系人员: 李良

客服电话: 95579 或 4008-888-999

公司网站: [www.95579.com](http://www.95579.com)

(9)安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法人代表:牛冠兴

联系电话:(0755) 82558305

传真电话: (0755) 82558002

联系人员: 陈剑虹

客服电话: 400-800-1001

公司网站: [www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(10)国元证券股份有限公司

注册地址:合肥市寿春路 179 号

办公地址:合肥市寿春路 179 号

法人代表:蔡咏

联系电话:(0551) 62207935

传真电话: (0551) 62207935

联系人员: 李蔡

客服电话: 95578

公司网站: [www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(11)华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市江东中路 228 号

办公地址:南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法人代表:周易

联系电话:0755-82492193

传真电话: 0755-82492962

联系人员: 庞晓芸

客服电话: 95597

公司网站: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(12)山西证券股份有限公司

注册地址:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法人代表:侯巍

联系电话:0351-8686659

传真电话: 0351-8686659

联系人员: 郭熠

客服电话: 400-666-1618、95573

公司网站: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(13)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](http://www.cindasc.com)

(14)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址:上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

法人代表:潘鑫军

联系电话:021-63325888

传真电话: 021-63326729

联系人员: 胡月茹

客服电话: 95503

公司网站: [www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(15)东北证券股份有限公司

注册地址:长春市自由大路 1138 号

办公地址:长春市自由大路 1138 号

法人代表:杨树财

联系电话:0431-85096517

传真电话: 0431-85096517

联系人员: 安岩岩

客服电话: 400-600-0686

公司网站: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(16)平安证券股份有限公司

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](http://stock.pingan.com)

(17)国海证券股份有限公司

注册地址:广西桂林市辅星路 13 号

办公地址:广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3F

法人代表:张雅锋

联系电话: (0755) 83709350

传真电话: (0755) 83704850

联系人员: 牛孟宇

客服电话: 95563

公司网站: [www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(18)中原证券股份有限公司

注册地址:郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址:郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法人代表:菅明军

联系电话:037169099882

传真电话: 0371-65585899

联系人员: 程月艳

客服电话: 95377

公司网站: [www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

(19)东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层 23 号投资广场 18 层

办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法人代表:赵俊

联系电话:021-20333333

传真电话: 021-50498825

联系人员: 王一彦

客服电话: 95531; 400-8888-588

公司网站: [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(20)中银国际证券有限责任公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法人代表:许刚

联系电话:021-20328309

传真电话: 021-50372474

联系人员: 王炜哲

客服电话: 400-620-8888

公司网站: [www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

(21)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](http://www qlzq.com.cn)

(22)华福证券有限责任公司

注册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法人代表:黄金琳

联系电话:0591-87383600

传真电话：0591-87383610

联系人员：张宗锐

客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网站：[www.hfq.com.cn](http://www.hfq.com.cn)

(23)华龙证券股份有限公司

注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

法人代表:李晓安

联系电话:0931-4890208

传真电话：（0931）4890628

联系人员：李昕田

客服电话：（0931）96668、4006898888

公司网站：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

(24)江海证券有限公司

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法人代表:孙名扬

联系电话:0451-85863719

传真电话：0451-82287211

联系人员：刘爽

客服电话：400-666-2288

公司网站：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

（三）二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

（四）其他

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金销售机构，并及时公告。

## 二、基金登记机构

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：韩炯  
电话：（021）31358666  
传真：（021）31358600  
联系人：黎明  
经办律师：吕红、黎明

#### 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

#### 第四部分基金名称

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

#### 第五部分基金类型

股票型

#### 第六部分投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 第七部分基金投资方向

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 第八部分基金投资策略

本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用跟踪误差最小化的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，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偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。

##### 1、最优化目标组合的构建

###### （1）股票预筛选

由于上证指数包含在上海证券交易所上市交易的所有 A 股和 B 股股票，本基金在最优化抽样前，根据所有股票可投资性、流动性、行业代表性等进行预筛选。

###### （2）最优化抽样

结合指数的特点，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素，在长期稳定的风险模型的基础上进行最优化抽样，得到目标组合。

###### （3）调整频率

本基金采用最优化抽样复制方法跟踪标的指数，基金所构建的目标组合将根据标的指数成分股及其权重进行相应的调整，以保证基金跟踪偏离和跟踪误差的最小化。

#### 【1】定期半年度调整

本基金构建的目标组合为根据最优化抽样方法得到的最优化抽样组合，将每半年根据上述最优化抽样复制方法对目标组合进行定期调整。

#### 【2】不定期调整

根据上证综合指数编制规则，因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整。本基金将紧密跟踪标的指数和最优化目标组合之间的差异，如果由于标的指数自身的较大变化或者其他原因引起的较大幅度的偏差时，需要及时根据最优化抽样复制方法调整目标组合。

### 2、其他金融工具投资策略

本基金基于流动性管理的需要，可以少量投资于新股、期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

### 第九部分标的指数与基金业绩比较基准

#### 1、本基金的标的指数为上证综合指数。

上证综合指数以上海证券交易所上市交易的全部股票作为样本，能够全面反映股市运行的特点，是中国最具影响力的指数。如果上证综合指数被停止编制及发布，或上证综合指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致上证综合指数不宜继续作为标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的标的指数和业绩比较基准，并及时公告。

#### 2、本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，业绩比较基准随之变更并公告。

### 第十部分基金的风险收益特征

本金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 第十一部分投资组合报告

#### 一、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 140,301,312.49 97.66

其中：股票 140,301,312.49 97.66

2 固定收益投资 — —

其中：债券 — —

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 3,362,818.84 2.34

7 其他资产 699.48 —

8 合计 143,664,830.81 100.00

注：上表中的股票投资项的金额包含可退替代款估值增值，而5.3的合计项不含可退替代款估值增值。

#### 二、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 三、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	833,689.00	0.58
B	采矿业	16,796,121.97	11.71
C	制造业	41,918,950.79	29.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,377,241.20	5.14
E	建筑业	7,555,918.41	5.27
F	批发和零售业	4,566,936.06	3.18
G	交通运输、仓储和邮政业	7,514,888.70	5.24
H	住宿和餐饮业	567,648.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,852,385.30	1.99
J	金融业	40,633,183.23	28.33
K	房地产业	5,812,626.55	4.05
L	租赁和商务服务业	391,820.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	742,284.60	0.52
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	2,340,003.00	1.63
S	综合	397,615.68	0.28
	合计	140,301,312.49	97.81

### 四、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

#### （一）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	601857	中国石油	906,758.00	6,972,969.02	4.86
2	601288	农业银行	1,488,739.00	5,240,361.28	3.65
3	601988	中国银行	1,124,100.00	4,159,170.00	2.90
4	601628	中国人寿	120,343.00	3,246,854.14	2.26
5	600028	中国石化	524,788.00	3,111,992.84	2.17
6	600519	贵州茅台	6,193.00	2,922,167.05	2.04
7	600036	招商银行	110,422.00	2,640,190.02	1.84
8	601318	中国平安	51,700.00	2,564,837.00	1.79
9	601166	兴业银行	134,170.00	2,262,106.20	1.58
10	601088	中国神华	92,121.00	2,053,377.09	1.43

#### （二）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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 五、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 六、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

注：本基金本报告期末未持有债券。

七、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。

八、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。

九、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。

十、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(一) 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。

(二) 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。

十一、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(一) 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。

(二) 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。

(三) 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。

十二、投资组合报告附注

(一) 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。

(二) 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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(三) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 20.52

2 应收证券清算款 —

3 应收股利 —

4 应收利息 678.96

5 应收申购款 —

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

9 其他 —

10 合计 699.48

#### （四）报告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。

#### （五）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 601088 中国神华 2,053,377.09 1.43 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：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### （六）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。

#### 第十二部分基金的业绩

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。

#### 一、本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2011.01.30-2011.12.31 -23.92% 1.08% -20.10% 1.13% -3.82% -0.05%

2012.01.01-2012.12.31 6.03% 1.09% 3.17% 1.09% 2.86% 0.00%

2013.01.01-2013.12.31 -3.73% 1.19% -6.75% 1.15% 3.02% 0.04%

2014.01.01-2014.12.31 56.72% 1.10% 52.87% 1.09% 3.85% 0.01%

2015.01.01-2015.12.31 8.52% 2.40% 9.41% 2.45% -0.89% -0.05%

2016.01.01-2016.12.31 -9.69% 1.38% -12.31% 1.45% 2.62% -0.07%

2017.01.01-2017.06.30 5.16% 0.50% 2.86% 0.55% 2.30% -0.05%

2011.01.30-2017.06.30 25.43% 1.41% 15.97% 1.43% 9.46% -0.02%

#### 二、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 2017 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2011 年 1 月 30 日成立，建仓期 3 个月，从 2011 年 1 月 30 日起至 2011 年 4 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

#### 第十三部分费用概览

##### 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、标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；

9、基金收益分配中发生的费用；

10、基金上市费及年费；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## 二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \times \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、标的指数许可使用费

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标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数使用费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元。

上述一、基金费用的种类中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要内容如下：

- 1、重要提示部分对招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新。
- 2、第三部分基金管理人部分对基金管理人信息进行了更新。
- 3、第四部分基金托管人部分对基金托管人信息进行了更新。



- 4、第五部分相关服务机构部分对相关服务机构信息进行了更新。
- 5、第十部分基金份额的申购与赎回部分对本基金申购、赎回清单进行了更新。
- 6、第十一部分基金的投资部分对本基金的投资组合报告更新至 2017 年第 2 季度。
- 7、第十二部分基金的业绩部分对基金业绩更新至 2017 年 6 月 30 日，并更新了历史走势对比图。
- 8、第二十三部分对基金份额持有人的服务部分对基金份额持有人服务的主要内容进行了更新。
- 9、第二十四部分其它应披露事项部分对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

富国基金管理有限公司

2017 年 09 月 05 日