

# 富国创新科技混合型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

富国创新科技混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2016 年 4 月 11 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2016】739 号）。本基金的基金合同于 2016 年 6 月 16 日生效。

基金管理人保证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投资价值、收益和市场前景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，请认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，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，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：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，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特定风险等等。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，由投资者自行承担。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

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对本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，但由于证券、期货投资具有一定的风险，因此既不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，该券种具有较高的流动性风险和信用风险。中小企业私募债的信用风险是指中小企业私募债券发行人可能由于规模小、经营历史短、业绩不稳定、内部治理规范性不够、信息透明度低等因素导致其不能履行还本付息的责任而使预期收益与实际收益发生偏离的可能性，从而使基金投资收益下降。基金可通过多样化投资来分散这种非系统风险，但不能完全规避。流动性风险是指中小企业私募债券由于其转让方式及其投资持有人数的限制，存在变现困难或无法在适当或期望时变现引起损失的可能性。

本招募说明书所载内容截止至 2019 年 6 月 16 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2019 年 3 月 31 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：裴长江

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：5.2亿元人民币

股权结构（截止于2019年06月16日）：

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。

公司目前下设二十八个部门、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、养老金业务部、银行业务部、机构服务部、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、合规稽核部、风险管理部、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：负责公司在中国境外（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：负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金FOF、海外客户等客群的

销售与服务；养老金业务部：负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务；银行业务部：负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务；机构服务部：负责协调三个机构销售部门对接公司资源，实现项目落地，提供专业支持和项目管理，对公司已有机构客户进行持续专业服务；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；合规稽核部：履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责，开展内部审计，管理信息披露、法律事务等；风险管理部：执行公司整体风险管理策略，牵头拟定公司风险管理制度与流程，组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对，负责公司旗下各投资组合合规监控等；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2019年5月31日，公司有员工450人，其中69.3%以上具有硕士以上学历。

## 二、 主要人员情况

### （一） 董事会成员

裴长江先生，董事长，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。

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，加拿大特许会计师。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，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、首席风险官、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。

张信军先生，董事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司财务总监、海通国际控股有限公司副总经理兼财务总监。历任海通证券有限公司财务会计部员工、计划财务部资产管理部副经理/经理、海通国际证券集团有限公司首席财务官、海通国际控股有限公司首席风险官。

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。

张科先生，董事，本科学历，经济师。现任山东省国际信托股份有限公司固有业务管理部总经理。历任山东省国际信托股份有限公司基金贷款部业务员、基金投资部业务员、基建基金管理部业务员、基建基金管理部信托经理、基建基金管理部副总经理、固有业务管理部副总经理。

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（Cary S. Ng）先生，独立董事，研究生学历，加拿大特许会计师。现已退休。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，圣力嘉学院 (Seneca College) 工商系会计及财务金融科教授。

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，风险管理办公室副主任，公司律师。历任上海市高级人民法院助理研究员，上海市中级人民法院、上海市第二中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长，办公室综合科科长，以及上海仲裁委员会仲裁员。

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副总经理，历任海通证券股份有限公司稽核部二级部副经理、二级部经理、稽核部总经理助理等。

李雪薇女士，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司运营部副总经理。历任富国基金管理有限公司资金清算员、登记结算主管、运营总监助理、运营部运营副总监、运营部运营总监。

肖凯先生，监事，博士。现任富国基金管理有限公司集中交易部风控总监。历任上海金新金融工程研究院部门经理、友联战略管理中心部门经理、富国基金管理有限公司监察部风控监察员、高级风控监察员、稽核副总监。

杨轶琴女士，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司零售业务部零售总监助理。历任辽宁省证券公司北京西路营业部客户经理、富国基金管理有限公司客户服务经理、营销策划经理、销售支持经理、高级销售支持经理。

沈詹慧女士，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司综合管理部副总经理。历任上海交通大学南洋中学教师、博朗软件开发(上海)有限公司招聘主管、思源电气股份有限公司人事行政部部长、富国基金管理有限公司人事经理、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兼首席信息官。

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（MSCI BARRA）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；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基金经理。

#### （五）本基金基金经理

##### （1）现任基金经理：

李元博，硕士，自2009年9月至2010年12月在湘财证券有限责任公司任研究员；自2010年12月至2011年9月在天治基金管理有限公司任研究员；自2011年9月至2015年7月在汇丰晋信基金管理有限公司任研究员、基金经理；2015年7月加入富国基金管理有限公司，2015年11月起任富国高新技术产业混合型证券投资基金基金经理，2016年6月起任富国创新科技混合型证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

#### （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：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## 二、 主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 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 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《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 64 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：裴长江

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：021-20513177

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

## （二） 代销机构

### （1）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：陈四清

联系人员：郭明

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

### （2）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：刘连舸

联系人员：陈洪源

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

### （3）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：田国立

联系人员：张静

客服电话：95533

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

( 4 )交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法人代表：彭纯

联系人员：王菁

客服电话：95559

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

( 5 )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

联系人员：曾里南

客服电话：95555

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

( 6 )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：李庆萍

联系人员：常振明

客服电话：95558

公司网站：bank.ecitic.com

(7)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

联系人员：唐小姐

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(8)中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路4号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法人代表：董文标

联系人员：杨成茜

客服电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

(9)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

联系人员：蔡宇洲

客服电话：95511-3

公司网站：www.bank.pingan.com

( 10 ) 青岛银行股份有限公司

注册地址：青岛市市南区香港中路 68 号

办公地址：青岛市市南区香港中路 68 号

法人代表：郭少泉

联系人员：滕克

客服电话：96588 青岛-、40066-96588 全国-

公司网站：www.qdccb.com

( 11 ) 广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

法人代表：王继康

联系人员：黎超雄

客服电话：020-961111

公司网站：www.grcbank.com

( 12 ) 苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

法人代表：王兰凤

联系人员： 葛晓亮

客服电话： 96067

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

( 13 ) 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

联系人员： 芮敏琪

客服电话： 400-8888-666/ 95521

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

( 14 ) 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

联系人员： 周杨

客服电话： 95536

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

( 15 ) 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： 深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

法人代表： 宫少林

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)

( 16 )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 8 号中信证券大厦

法人代表： 张佑君

联系人员： 顾凌

客服电话： 95548 或 4008895548

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

( 17 )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

联系人员： 邓颜

客服电话： 4008-888-888

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

( 18 )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： 周杰

联系人员： 李笑鸣

客服电话： 95553

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

( 19 )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

联系人员: 黄莹

客服电话: 95523 或 4008895523

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

( 20 )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

联系人员: 刘晨、李芳芳

客服电话: 95525

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

( 21 )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

联系人员: 安岩岩

客服电话: 95360

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

( 22 )中银国际证券股份有限公司

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

联系人员： 王炜哲

客服电话： 400-620-8888

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

( 23 )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

联系人员： 吴阳

客服电话： 95538

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

( 24 )第一创业证券股份有限公司

注册地址： 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址： 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法人代表： 刘学民

联系人员： 吴军

客服电话： 95358

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

( 25 )华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元

法人代表：俞洋

联系人员：杨莉娟

客服电话：95323

公司网站：<http://www.cfsc.com.cn/>

( 26 ) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法人代表：张彦

联系人员：张燕

客服电话：400-166-1188

公司网站：<http://8.jrj.com.cn>

( 27 ) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 5 层 01、02、03 室

办公地址：上海浦东陆家嘴金融世纪广场 3 号楼 5F

法人代表：冷飞

联系人员：李娟

客服电话：021-50810673

公司网站：<http://www.wacaijijin.com/>

( 28 ) 民商基金销售(上海)有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座) 6 楼 A31 室



办公地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

法人代表： 贲惠琴

联系人员： 杨一新

客服电话： 021-50206003

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

（ 29 ）北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址： 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址： 北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法人代表： 张旭阳

联系人员： 孙博超

客服电话： 95055-4

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

（ 30 ）深圳众禄基金销售股份有限公司

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

联系人员： 汤素娅

客服电话： 4006-788-887

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

（ 31 ）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： 上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 楼

法人代表： 其实

联系人员： 潘世友

客服电话： 400-1818-188

公司网站： [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

( 32 )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

联系人员： 张茹

客服电话： 4007-009-665

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

( 33 )蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址： 杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址： 杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法人代表： 陈柏青

联系人员： 张裕

客服电话： 4000-766-123

公司网站： [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

( 34 )上海长量基金销售有限公司

注册地址： 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址： 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法人代表： 张跃伟

联系人员： 沈雯斌

客服电话： 400-089-1289

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

( 35 )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

联系人员： 吴强

客服电话： 4008-773-772

公司网站： [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

( 36 )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

联系人员： 曹怡晨

客服电话： 400-067-6266

公司网站： <http://a.leadfund.com.cn>

( 37 )嘉实财富管理有限公司

注册地址： 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址： 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

法人代表： 赵学军

联系人员： 张倩

客服电话： 400-021-8850

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

( 38 ) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址： 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法人代表： 沈伟桦

联系人员： 程刚

客服电话： 400-609-9200

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

( 39 ) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址： 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址： 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法人代表： 钱燕飞

联系人员： 王锋

客服电话： 95177

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

( 40 ) 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址： 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法人代表： 李悦章

联系人员： 张林

客服电话： 400-066-8586

公司网站: <https://www.igesafe.com/>

( 41 )北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法人代表: 周斌

联系人员: 马鹏程

客服电话: 400-786-8868

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

( 42 )北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法人代表: 王伟刚

联系人员: 丁向坤

客服电话: 400-619-9059

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

( 43 )深圳盈信基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1 (811-812)

办公地址: 辽宁省大连市中山区海军广场街道人民东路 52 号民生金融中心 22 楼盈信基金

法人代表: 苗宏升

联系人员: 葛俏俏

客服电话: 4007-903-688

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

( 44 )上海大智慧财富管理有限公司

注册地址： 上海自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼

办公地址： 上海自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1108 室

法人代表： 申健

联系人员： 印强明

客服电话： 021-20292031

公司网站： <https://8.gw.com.cn/>

( 45 )北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址： 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室

办公地址： 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室、海淀北二街 10 号秦鹏大厦 12 层

法人代表： 张琪

联系人员： 付文红

客服电话： 010-62675369

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

( 46 )济安财富(北京)资本管理有限公司

注册地址： 北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址： 北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法人代表： 杨健

联系人员： 李海燕

客服电话： 400-673-7010

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

( 47 )上海万得投资顾问有限公司

注册地址： 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址： 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法人代表： 王廷富

联系人员： 姜吉灵

客服电话： 400-821-0203

公司网站： [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

( 48 )上海基煜基金销售有限公司

注册地址： 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 上海泰和经济发展区-

办公地址： 上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法人代表： 王翔

联系人员： 蓝杰

客服电话： 400-820-5369

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

( 49 )上海陆金所基金销售有限公司

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： 鲍东华

联系人员： 宁博宇

客服电话： 4008-219-031

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

( 50 )珠海盈米基金销售有限公司

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

联系人员： 黄敏娥

客服电话： 020-89629066

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

( 51 )奕丰基金销售有限公司

注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市

办公地址： 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115、1116、1307 室

法人代表： TEO WEE HOWE

联系人员： 项晶晶

客服电话： 400-684-0500

公司网站： <http://www.ifastps.com.cn>

( 52 )北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址： 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址： 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法人代表： 江卉

联系人员： 徐伯宇

客服电话： 95118

公司网站： <http://fund.jd.com/>

( 53 )大连网金基金销售有限公司

注册地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室



法人代表： 樊怀东

联系人员： 贾伟刚

客服电话： 4000-899-100

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

( 54 )深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址： 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址： 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

法人代表： 赖任军

联系人员： 刘昕霞

客服电话： 400-930-0660

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

( 55 )北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址： 北京市朝阳区望京 SOHO T2 B 座 2507

法人代表： 钟斐斐

联系人员： 戚晓强

客服电话： 4000-618-518

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

( 56 )上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址： 上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址： 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法人代表： 李一梅

联系人员： 仲秋月

客服电话： 400-817-5666

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

( 57 ) 申银万国期货有限公司

注册地址： 上海市东方路 800 号 7、8、10 楼

办公地址： 上海市东方路 800 号 7、8、10 楼

法人代表： 李建中

联系人员： 史艺斐

客服电话： 400-888-7868

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

( 58 ) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址： 拉萨市北京中路 101 号

办公地址： 拉萨市北京中路 101 号

法人代表： 陈宏

联系人员： 唐湘怡

客服电话： 95357

公司网站： <http://www.18.cn>

(三) 其他

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

二、 基金登记机构

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 层

法定代表人：裴长江

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：徐慧

### 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

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼和 16 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼和 16 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、孙睿

联系人：孙睿

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

### 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（特殊普通合伙）

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

富国创新科技混合型证券投资基金

#### 第五部分 基金类型

混合型

#### 第六部分 投资目标

本基金主要投资于创新科技主题的上市公司发行的股票，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

#### 第七部分 基金投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、固定收益类资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产）、衍生工具（权证、股指期货等），以及法律法规或中国证监会允许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：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于创新科技主题的上市公司发行的股票不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如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。

#### 第八部分 基金投资策略

##### 1、大类资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

本基金主要考虑的因素为：

(1) 宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、货币供应量、固定资产投资、进出口贸易数据等，以判断当前所处的经济周期阶段；

(2) 市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化；

(3) 政策因素，包括货币政策、财政政策、资本市场相关政策等；

(4) 行业因素：包括相关行业所处的周期阶段、行业政策扶持情况等。

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

## 2、股票投资策略

### (1) 创新科技主题的界定

创新科技主题是指基金管理人以“科技创新、技术研发、科技服务行业上市公司，或者其他科技创新类公司、转型切入科技行业的公司”作为创新科技主题并重点考察。本基金界定创新科技主题包括以下两类公司：

#### 1) 科技创新、技术研发、科技服务行业上市公司。

科技创新、技术研发、科技服务行业上市公司主要是指 TMT (Technology, Media, Telecom)，以及其他行业中从事技术研发和服务的公司；本基金将 28 个申万一级行业中的计算机、传媒、电子、通信这四个一级行业归为 TMT 产业。

如果未来由于技术进步或经济结构变化导致本基金 TMT 产业的覆盖范围发生变动，基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。如果申万证券调整或停止行业分类，或者基金管理人认为有更适当的产业划分标准，基金管理人有权对 TMT 产业的界定方法进行变更并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### 2) 其他科技创新类公司或者转型切入科技行业的公司。

本基金所指其他科技创新类行业包括新能源、新能源汽车、节能环保、新材料、生物医药、高端制造和信息这七大战略性新兴产业领域。此外，通过转型切入到科技行业的公司也属于本基金的投资范畴。

### (2) 子行业配置策略

本基金主要投资处于创新科技主题中发展空间大、确定性较好，并且自身持续成长潜力大的上市公司。在子行业的配置上，本基金将通过三步来进行筛选：

首先，行业研究员通过对各子行业面临的国家政策、竞争格局、行业发展趋势和空间进行研判，动态

调整各自所属行业的投资评级和配置建议；

其次，行业内进行比较分析，结合内外部研究资源，对各子行业的相对投资价值提出配置比重建议；

最后，基金经理将根据行业研究员的建议，并结合市场投资环境的判断确定整体仓位和各子行业的配置比重。对行业发展空间大，趋势明确，业绩确定性强的子行业进行重点配置。

### （3）个股精选策略

在行业选择和权重确定的基础上，本基金将着重选择那些产品或者服务已经过前期的技术和产业准备、下游需求在政策刺激下将大幅增长、具有良好业绩成长性的上市公司。因此，本基金将从上市公司的成长性、研发能力、治理结构，并结合估值水平等方面进行综合评价：

1) 成长性：本基金对科技主题上市公司的成长性分析将包括定量及定性两方面。在定量的分析方法上，我们主要参考主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净资产收益率（ROE）、毛利率等成长性指标。在成长性的定性分析上，本基金强调企业成长能力的可持续性，重点从行业成长前景、行业地位、用户消费习惯、产品前景、盈利能力、财务结构等方面进行研判。

2) 研发能力：本基金将选择那些产品具有较高科技含量或公司具有较强技术开发能力的上市公司，考虑的因素包括：产品技术含量、技术发展前景、技术成熟程度、研究经费投入规模、配套政策支持、研究成果转化的经济效果等。

3) 治理结构：公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。因此，公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定上市公司盈利能力能否持续的重要因素。

4) 估值水平分析：基金管理人将对创新科技主题的上市公司给与估值分析，并结合行业地位分析，优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估、且在各自行业中具有领先地位的优质上市公司股票进行投资。本基金采用的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）等。

### 3、债券投资策略

本基金将采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

（1）久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险；

（2）期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券

的相对价格变化中获利；

(3) 市场转换是指管理人将针对债券子市场间不同运行规律和风险-收益特性构建和调整组合，提高投资收益；

(4) 相对价值判断是在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的类属，减持相对高估、价格将下降的类属；

(5) 信用风险评估是指基金管理人将充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

对于可转换债券的投资，本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性，以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益；本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

#### 4、中小企业私募债券的投资

本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

#### 5、金融衍生工具投资

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。

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。

#### 第九部分 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数\*60%+中证全债指数收益率\*40%。

中证 TMT 产业主题指数由 TMT 产业中规模和流动性较好的 100 只公司股票组成，反映 A 股上市公司中数字新媒体相关产业公司股票的走势；中证全债指数覆盖银行间债券市场和交易所债券市场两大市场国债、金融债及企业债整体走势的指数，具有较广的覆盖面，成分债券的流动性较高。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又当市场出现更合适、更权威的比较基准，并且更接近本基金风格时，经基金托管人同意，报中国证监会备案，可选用新的比较基准，并将及时公告，调整业绩比较基准无需召开基金持有人大会。

#### 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

#### 第十一部分 投资组合报告

##### 一、 报告期末基金资产组合情况

##### 二、 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 三、 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股票投资明细

##### 四、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

##### 五、 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

##### 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。

##### 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。

##### 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

##### 九、 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

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。



## 十、 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

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。

## 十一、 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中旗股份”的发行主体江苏中旗科技股份有限公司（以下简称“公司”）于2018年11月1日公告，公司于2018年10月30日收到南京市江北新区管理委员会环境保护与水务局出具的《行政处罚决定书》（宁新区管环罚[2018]98号和99号文），因公司污水排放口PH自动监测浓度出现6个小时数据超过污水集中处理厂接管标准，违反了《中华人民共和国水污染防治法》第四十五条第三款的规定，南京市江北新区管理委员会环境保护与水务局对公司做出责令立即改正环境违法行为、罚款人民币贰拾壹万叁仟元整的行政处罚；因公司废气排放监测结果显示两个排气筒排放的非甲烷总烃浓度超标，违反了《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条的规定，南京市江北新区管理委员会环境保护与水务局对公司做出责令立即改正环境违法行为、罚款人民币贰拾捌万元整的行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

（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。

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。

（三） 其他资产构成

（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

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。

(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

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2019年3月31日。

2、本基金于2016年6月16日成立，建仓期6个月，从2016年6月16日起至2016年12月15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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金合同生效后基金的证券、期货账户开户费用，银行账户维护费用；

9、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。

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 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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，自动在次月首 2 个工作日内、按照指定的账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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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。

### 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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，自动在次月首 2 个工作日内、按照指定的账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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3-9 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；

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。

#### 五、 与基金销售有关的费用

##### 1、 申购费率

投资者申购本基金份额时，需交纳申购费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金在申购时支付申购费用，该费用按申购金额递减。

本基金份额对通过直销柜台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。具体如下：

##### (1) 申购费率

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

##### (2) 特定申购费率

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险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金等，具体包括：

- a、全国社会保障基金；
- b、可以投资基金的地方社会保障基金；
- c、企业年金单一计划以及集合计划；
- d、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- e、企业年金养老金产品；
- f、个人税收递延型商业养老保险等产品；
- g、养老目标基金；
- h、职业年金计划。

如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，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。

基金申购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

## 2、赎回费率

(1) 赎回费用由基金赎回人承担。投资者认（申）购本基金所对应的赎回费率随持有时间递减。具体如下：

(注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。1年为365天，2年为730天，依此类推)

(2) 投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。

对持续持有期少于30日的投资者收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于90天的投资者收取的赎回费，将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于90天但少于180天的投资者收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于180天的投资者，将赎回费总额的25%归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付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，在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下，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销售费率。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

## 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》、《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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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，主要更新内容如下：

- 1、“重要提示”部分，对招募说明书内容的截止日期及相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”，对基金管理人信息进行了更新。
- 3、“第四部分 基金托管人”，对基金托管人信息进行了更新。
- 4、“第五部分 相关服务机构”，对相关服务机构的信息进行了更新。

5、“第九部分 基金的投资”部分，基金投资组合报告内容更新至2019年3月31日。

6、“第十部分 基金的业绩”，内容更新至2019年3月31日。

7、“第二十二部分 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

2019年07月17日