

华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证 券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

目录

重要提示.....	2
第一部分 基金管理人.....	4
第二部分 基金托管人.....	9
第三部分 相关服务机构.....	14
第四部分 基金的名称.....	19
第五部分 基金的类型.....	19
第六部分 基金的运作方式.....	19
第七部分 基金的投资目标.....	19
第八部分 基金的投资范围.....	20
第九部分 基金的投资策略.....	21
第十部分 基金的标的指数和业绩比较基准.....	22
第十一部分 基金的风险收益特征.....	22
第十二部分 基金的投资组合报告.....	23
第十三部分 基金的业绩.....	26
第十四部分 基金费用与税收.....	28
第十五部分 对招募说明书更新部分的说明.....	31

重要提示

华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会 2018 年 9 月 5 日证监许可【2018】1432 号准予募集注册。本基金基金合同于 2019 年 1 月 28 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作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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书等信息披露文件。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金属于指数基金，采用代表性分层抽样复制策略跟踪中证 5 年恒定久期国开债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本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的绝对值不超过 0.25%，年跟踪误差不超过 3%。

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，应全面了解本基金的产品特性，自主判断基金的投资价值，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主做出投资决策，并自行承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金特有风险和其他风险等。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载投资组合报告为 2019 年第 3 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 9 月 30 日（本招募说明书财务资料未经审计），基金经理部分的信息更新截止日为 2019 年 9 月 30 日，其余部分所载内容截止日为 2019 年 9 月 30 日。

本招募说明书（更新）关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：华富基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层

邮政编码：200120

法定代表人：章宏韬

设立日期：2004年4月19日

核准设立机关：中国证监会

核准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】47号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

联系人：邵恒

电话：021-68886996

传真：021-68887997

股权结构：华安证券股份有限公司49%、安徽省信用担保集团有限公司27%、合肥兴泰金融控股（集团）有限公司24%

二、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

章宏韬先生，董事长，大学本科学历，工商管理硕士，经济师。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员，安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科级秘书，安徽证券交易中心综合部（办公室）经理助理、副经理（副主任），安徽省证券公司合肥蒙城路营业部总经理，华安证券有限责任公司办公室副主任、总裁助理兼办公室主任、副总裁、总裁。现任华安证券股份有限公司党委书记、董事长，兼任华富基金管理有限公司董事长、华安期货有限责任公司董事，中国证券业协会托管结算专业委员会副主任委员，安徽证券期货业协会会长，安徽省

政协委员。

徐峰先生，董事，工学博士，研究生学历。历任安徽大学助教、讲师，安徽证券交易中心工程师、高级工程师、电讯工程部经理助理、副经理，华安证券股份有限公司信息技术部副总经理、总裁助理兼登记结算部总经理、总裁助理兼任经纪业务部总经理，现任华安证券股份有限公司副总裁、党委委员。

范强先生，董事，大专学历，历任安徽省财政厅工交处副主任科员、主任科员、副处长，安徽省财政厅工交处副处长，省地税局直属分局副局长、局长，省地税局计财处处长，省地税局财监处处长，安徽省信用担保集团副总经理兼任华安证券董事、皖煤投资有限公司董事长，现任安徽省信用担保集团副总经理、党委委员。

郑晓静女士，董事，硕士研究生学历。历任合肥市财政局预外局（非税局）科员，合肥市财政局办公室科员、副主任，合肥市财政局预算处副处长，合肥市金融办（市投融资管理中心）资本市场处（企业融资处）副处长（主持工作），合肥市金融办担保与保险处处长，合肥市金融办资本市场处处长。现任合肥兴泰金融控股（集团）有限公司副总裁，兼任合肥兴泰资本管理有限公司董事长。

曹华玮先生，总经理，硕士学位。历任庆泰信托公司投资银行部客户经理、新疆金新信托投资股份有限公司市场部经理、德恒证券有限责任公司重点客户服务中心经理、嘉实基金管理有限公司渠道部高级经理、汇添富基金管理有限公司机构部总监助理、华泰柏瑞基金管理有限公司机构理财部总监。曾任华富基金管理有限公司总经理助理、机构理财部总监、副总经理、常务副总经理。现任华富基金管理有限公司总经理。

刘瑞中先生，独立董事，研究生学历。历任安徽铜陵财专教师，中国经济体制改革研究所助理研究员、信息部主任，中国国际期货经纪有限公司任信息部经理、深圳公司副总经理，北京商品交易所常务副总裁，深圳特区证券公司（现巨田证券）高级顾问。现任深圳神华期货经纪有限公司独立董事，冠通期货经纪有限公司独立董事。

陈庆平先生，独立董事，工商管理硕士。历任上海金融专科学校讲师、处长，申银证券公司哈尔滨营业部总经理，上海鑫兆投资管理咨询有限公司顾问，宁波国际银行上海分行行长，上海金融学院客座教授。

张赛美女士，独立董事，硕士学位，研究生学历。历任上海张江公社团委副书记，上海建平中学教师，上海社会科学院经济研究所助理研究员，海通证券股份有限公司投资银行部副总经理（主持工作）、投资银行管理部总经理、并购及资本市场部总经理、战略规划部总经理、衍生产品部总经理，海通开元投资有限公司董事长，海通创意资本管理有限公司董事长。现任上海双创投资管理有限公司创始合伙人，上海双创投资中心总经理。

2、基金管理人监事会成员

王忠道先生，监事会主席，本科学历。历任上海财经大学金融理论教研室助教，安徽省财政厅副主任科员，安徽信托投资公司部门经理、安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省皖煤投资有限公司总经理。现任安徽省信用担保集团有限责任公司总经济师。

梅鹏军先生，监事，金融学博士，高级经济师。先后在安徽省国际经济技术合作公司，安徽省物资局（后更名为安徽省徽商集团）工作，历任合肥兴泰控股集团有限公司投资发展部业务经理，合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所副所长。现任合肥兴泰金融控股（集团）有限公司金融研究所所长，安徽大学经济学院金融硕士研究生兼职导师。

李宏升先生，监事，本科学历，经济师。历任国元证券斜土路营业部交易部经理，交通银行托管部基金会计、基金清算。现任华富基金管理有限公司综合管理部总监。

陈启明先生，监事，本科学历，会计学硕士。历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理。曾任华富基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、研究发展部副总监。现任华富基金管理有限公司公募投资决策委员会成员、基金投资部总监、基金经理。

3、高级管理人员

章宏韬先生，董事长，简历同上。

曹华玮先生，总经理，简历同上。

满志弘女士，督察长，管理学硕士，CPA。曾任道勤控股股份有限公司财务部总经理，华富基金管理有限公司监察稽核部副总监兼董事会秘书、监察稽核部总监，上海华富利得资产管理有限公司监事，现任华富基金管理有限公司督察长。

龚炜先生，副总经理，硕士学位，先后供职于湘财证券有限责任公司、中国证监会安徽监管局、天治基金管理有限公司。曾任华富基金管理有限公司金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理。现任华富基金管理有限公司副总经理、公司公募投资决策委员会主席、基金经理。

4、本基金基金经理简介

张娅女士，美国肯特州立大学金融工程硕士，硕士研究生学历，十三年证券从业经验。曾先后担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理。2017年4月加入华富基金管理有限公司，现任公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、创新业务部总监、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理。

郜哲先生，北京大学理学博士，研究生学历，四年证券从业经验。曾先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员。2017年4月加入华富基金管理有限公司，现任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华富中证100指数型证券投资基金基金经理、华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理。

5、公募投资决策委员会成员

公募投资决策委员会是负责公募基金投资决策的最高权力机构，由公司分管公募投资业务的领导、涉及公募投资和研究的部门的业务负责人以及公募投资决策委员会认可的其他人员组成。公募投资决策委员会主席由公司分管公募投资业务的最高业务领导担任，负责投决会的召集和主持。

公募投资决策委员会成员姓名和职务如下：

龚 炜先生	公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理、基金经理
曹华玮先生	公司公募投资决策委员会成员、公司总经理
张 娅女士	公司公募投资决策委员会成员、公司总经理助理、创新业务部总监、基金经理
陈启明先生	公司公募投资决策委员会成员、基金投资部总监、基金经理
郦 彬先生	公司公募投资决策委员会成员、研究发展部总监

尹培俊先生

公司公募投资决策委员会成员、固定收益部总监、
基金经理

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，

并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

二、主要人员情况

高国富，男，1956年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发(控股)公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险(集团)股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务工作党委委员，资产托管部总经理。

三、基金托管业务经营情况

截止2019年9月30日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为4532.46亿元，比去年末增加7.58%。托管证券投资基金共一百六十七只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金(LOF)、博时安丰18个月基金(LOF)、易方达裕丰回报基金、

鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型

证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金、永

赢众利债券型证券投资基金、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、汇添富汇鑫浮动净值货币市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金等。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构:

名称: 华富基金管理有限公司直销中心和网上交易系统

住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层

法定代表人: 章宏韬

联系人: 方萍

咨询电话: 021-50619688, 400-700-8001

传真: 021-68415680

网址: www.hffund.com

2、其他销售机构:

(1) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人: 章宏韬

联系人: 范超

联系电话: 0551-65161821

传真: 0551-65161672

客服电话: 95318

公司网址: www.hazq.com

(2) 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦26楼

法定代表人: 其实

联系人: 唐湘怡

电话: 021-54509977

传真: 021-64385308

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(3) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

电话：(021)61618888

传真：(021)63604199

联系人：于慧、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(4) 奕丰基金销售有限公司

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

传真号码：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

(5) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：张慧

电话：025-66996699

客服电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

(6) 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：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：费超超

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008773772

公司网址：www.5ifund.com

(7) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com>

(8) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：郭丹妮

电话：021-50583533

传真：021-61101630

客服电话：400-921-7755

公司网址：a.leadfund.com.cn

(9) 上海联泰基金销售有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户服务电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

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销售基金，并及时在基金管理人网站上公示。基金管理人有权根据实际情况按照相关程序变更或增减销售机构，并在基金管理人网站上公示。

二、登记机构

名称：华富基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1000 号 31 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

法定代表人：章宏韬

联系人：潘伟

电话：021-68886996

传真：021-68887997

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：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层

执行事务合伙人：胡少先

电话：021-62281910

传真：021-62286290

联系人：曹小勤

经办注册会计师：曹小勤、林晶

第四部分 基金的名称

华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金

第五部分 基金的类型

债券型证券投资基金

第六部分 基金的运作方式

契约型、开放式

第七部分 基金的投资目标

本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本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的绝对值不超过 0.25%，年跟踪误差不超过 3%。

第八部分 基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产(包括国债、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)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以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:

本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%;本基金持有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、存出保证金及应收申购款等。

第九部分 基金的投资策略

1、本基金的标的指数为中证5年恒定久期国开债指数

本基金为指数基金，将采用代表性分层抽样复制法对标的指数进行跟踪。

分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券及备选成份券中抽取若干成份券，或必要时选择非成份券作为替代，构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，有效减少组合维护及再平衡的所需的费用。

本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的剩余期限、久期、历史流动性及收益率等进行分析，初步选择流动性较好的成份券作为备选，在以基金组合久期与标的指数久期基本一致为基本目标的基础上，将通过对标的指数按照久期、剩余期限、到期收益率等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上分布特征上尽可能相似，从而达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重和债券品种与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理比如参与风险低且可控的债券回购等投资获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度：

2、债券投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，基金管理人将采取适当方法对债券投资组合进行整体优化调整，如“久期匹配、“期限匹配”等。

(1) 久期匹配

“久期匹配”策略是指以投资组合久期与标的指数久期一致为目标，从而使在收益率曲线平行移动的情况下，债券投资组合和标的指数走势一致。

(2) 期限匹配

“期限匹配”是指衡量各个期限的债券权重，力争基金组合各个期限段权重与标的指数分布相匹配，减少期限利差变动造成的跟踪误差。

3、类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。

第十部分 基金的标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为中证 5 年恒定久期国开债指数，业绩比较基准为中证 5 年恒定久期国开债指数收益率。

中证 5 年恒定久期国开债指数是由剩余期限在 1 到 10 年，且固定利率付息和一次还本付息的国开债品种组成样本。

如果中证指数有限公司变更或停止中证 5 年恒定久期国开债指数的编制及发布，或者中证 5 年恒定久期国开债指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致中证 5 年恒定久期国开债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时变更本基金的基金名称和业绩比较基准。

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。

第十一部分 基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金属于指数基金，采用代表性分层抽样复制策略跟踪中证 5 年恒定久期国开债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

第十二部分 基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金投资组合报告的期间为2019年7月1日至2019年9月30日，报告中所列财务数据未经审计。

1.1 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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	995,031,000.00	92.61
	其中: 债券	995,031,000.00	92.61
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	63,555,540.24	5.91
8	其他资产	15,901,931.05	1.48
9	合计	1,074,488,471.29	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注: 本基金本报告期末未持有股票。

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: 本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

1.3 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

注: 本基金本报告期末未持有股票。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例
---	------	---------	-----------

号			(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	995,031,000.00	92.67
	其中：政策性金融债	995,031,000.00	92.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	995,031,000.00	92.67

1.5 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	170210	17 国开 10	2,500,000	254,425,000.00	23.70
2	180208	18 国开 08	1,300,000	132,249,000.00	12.32
3	180211	18 国开 11	1,200,000	121,824,000.00	11.35
4	190203	19 国开 03	1,200,000	119,556,000.00	11.13
5	180212	18 国开 12	1,000,000	101,340,000.00	9.44

1.6 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。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十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。

1.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,901,931.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,901,931.05

1.10.4 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。

1.10.5 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不存在流通受限的情况。

1.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十三部分 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 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

华富中证5年恒定久期国开债指数 A

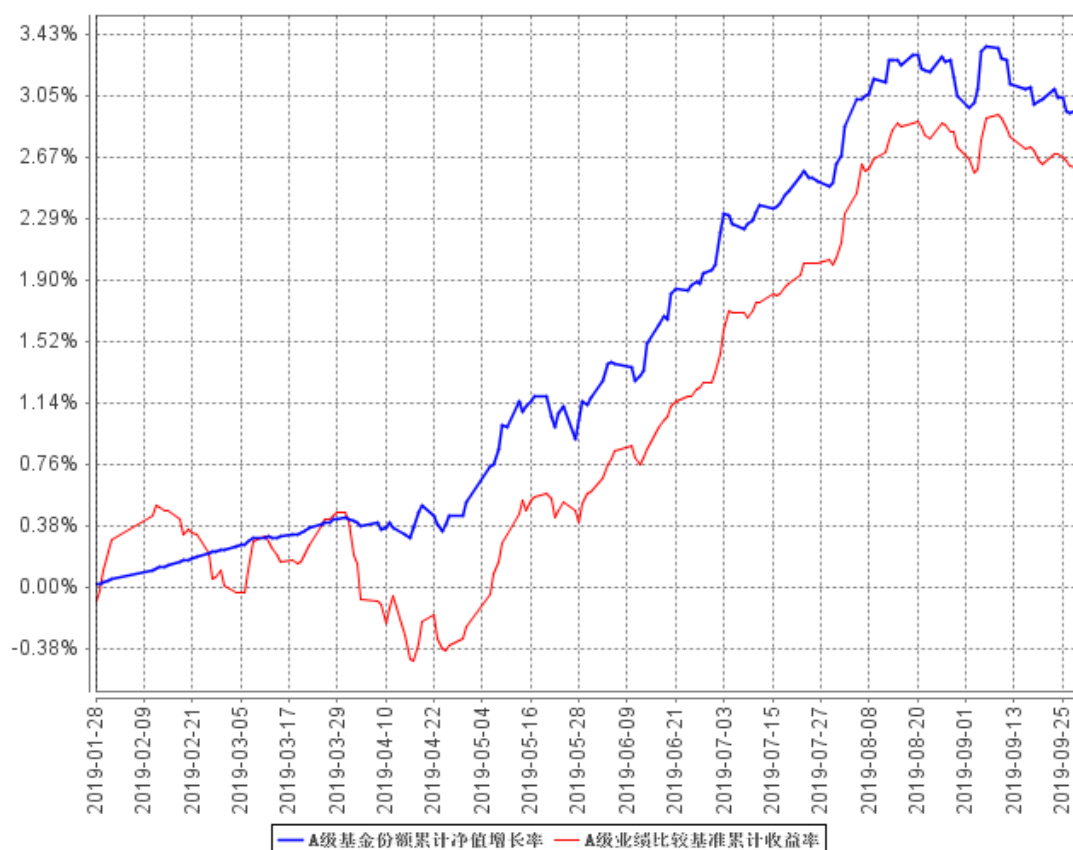
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.1.28 -2019.9.30	2.97%	0.06%	2.59%	0.08%	0.38%	-0.02%

华富中证5年恒定久期国开债指数 C

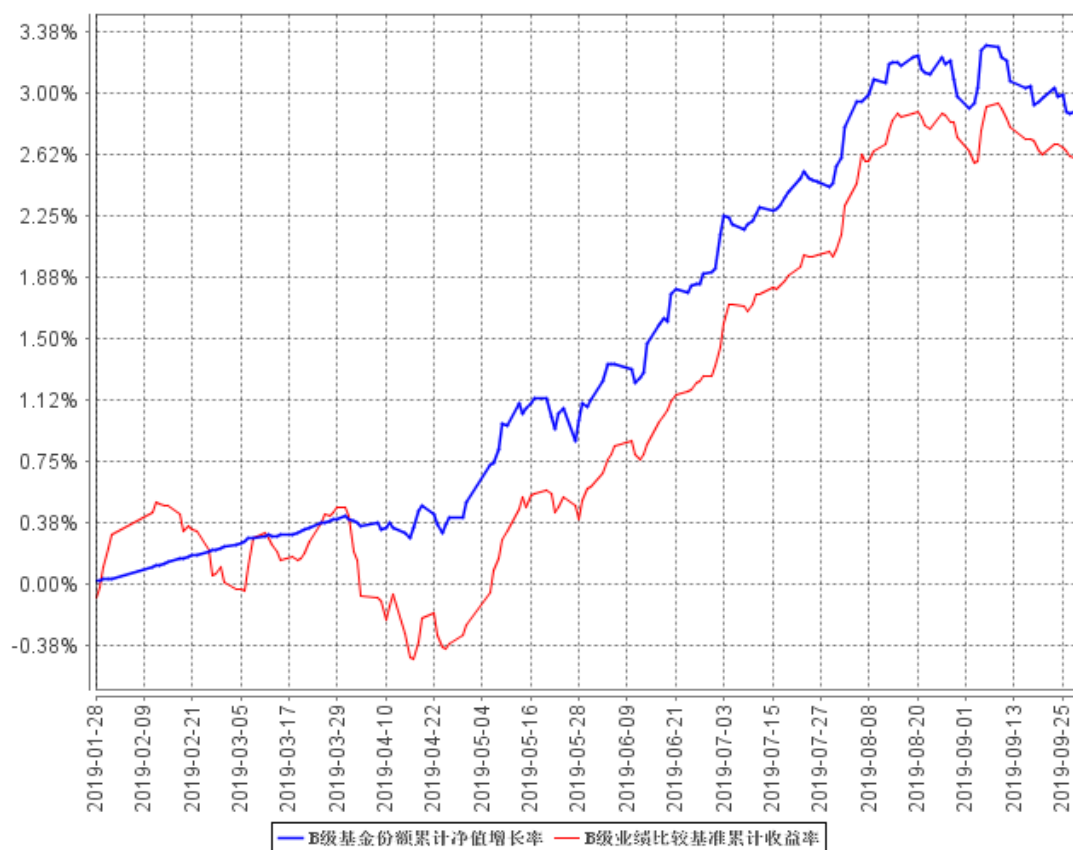
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.1.28 -2019.9.30	2.91%	0.06%	2.59%	0.08%	0.32%	-0.02%

(二) 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



第十四部分 基金费用与税收

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、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 10、指数许可使用费；
- 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。

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 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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 5 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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

销售服务费专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

4、指数许可使用费

本基金作为指数基金，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许可使用费。

许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之 1.5（壹点伍个基点）的年费率计提。许可使用基点费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

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

H 为每日应付的许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。

许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 2.5 万元（大写：贰万伍仟元），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应

在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第3—8、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，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

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纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十五部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《公开募集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》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对原《华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“重要提示”部分,更新了基金合同的生效日期,以及招募说明书更新和相关数据截止日期等内容。
- 2、在“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人的相关信息。
- 3、在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的相关信息。
- 4、在“五、相关服务机构”部分,更新了相关服务机构的内容。
- 5、在“六、基金的募集”部分,更新了基金募集的情况。
- 6、在“七、基金合同的生效”部分,更新了基金合同生效的情况,删除了基金备案条件、基金募集失败的处理方式等内容。
- 7、在“九、基金的投资”部分,增加了基金最近一期投资组合报告的内容。
- 8、新增“十、基金的业绩”部分,披露了基金最近一期的业绩说明。
- 9、新增“二十二、其他应披露事项”披露了本期基金的相关公告。
- 10、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》对相关章节做了修订。