

# 富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)

## (摘要)(二〇一六年第二号)

富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2013 年 1 月 22 日证监许可[2013]54 号文核准募集。本基金的基金合同于 2013 年 4 月 12 日生效。

### 【重要提示】

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。投资有风险，投资人认购（或申购）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，对认购基金的意愿、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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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 10 月 12 日，基金投资组合报告截止至 2016 年 9 月 30 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：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：范伟隽

注册资本：3 亿元人民币

股权结构（截止于 2016 年 10 月 12 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；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、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 9 月 30 日，公司有员工 357 人，其中 64.99%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 月任富国天益价值混合型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。历任职于邾县政府办公室职员，邾县国营一厂厂长，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权益投资部总经理兼基金经理。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

袁宜先生，博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师、首席策略分析师；2011年3月加入富国基金管理有限公司，任首席经济学家兼基金经理助理；2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年9月起就任富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；兼任权益投资副总监。具有基金从业资格。

#### 6、投资决策委员会成员

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。

### 三、基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、按法律法规规定的年限保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律法规和中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他职责。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
  - (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
  - (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
- 3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
  - (1) 越权或违规经营；
  - (2) 违反《基金合同》或托管协议；
  - (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
  - (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
  
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

#### 六、基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。



## 七、基金管理人的风险管理和内部控制制度

### 1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

(2) 识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在的原因。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低的风险，则承担它，但需加以监控。而对较为严重的风险，则实施一定的管理计划，对于一些后果极其严重的风险，则准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

### 2、内部控制制度

#### (1) 内部控制的原则

①全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

②独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

③相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

④重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

## （2）内部控制的主要内容

### ①控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立有独立董事参加的风险委员会，负责评价与完善公司的内部控制体系；公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告，确保公司财务报告的真实性、可靠性，督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了总经理办公会、投资决策委员会、风险控制委员会等委员会，分别负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### ②风险评估

公司内部稽核人员定期评估公司及基金的风险状况，包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素，对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度，并将评估报告报总经理办公会和风险控制委员会。

### ③操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

### ④信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

### ⑤监督与内部稽核

基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行内部稽核职能，检查、

评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员具有相对的独立性，监察稽核报告提交全体董事审阅并报送中国证监会。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财

务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 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

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：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：021-20361544

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

## 2. 基金代销机构

### (1) 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](http://www.ccb.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：易会满

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](http://www.icbc.com.cn)

### (3) 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：周慕冰

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](http://www.abchina.com)

### (4) 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](http://www.boc.cn)

（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](http://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](http://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：李庆萍

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](http://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](http://www.spdb.com.cn)

（9）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

联系电话：（010）58351666

传真电话：（010）57092611

联系人员：杨成茜

客服电话：95568

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

（10）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](http://www.psbc.com)

（11）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](http://www.hxb.com.cn)

( 12 )上海银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

法人代表: 范一飞

联系电话: (021) 68475888

传真电话: (021) 68476111

联系人员: 龚厚红

客服电话: (021) 962888

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

( 13 )宁波银行股份有限公司

注册地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法人代表: 陆华裕

联系电话: 0574-89068340

传真电话: 0574-87050024

联系人员: 胡技勋

客服电话: 96528 (上海、北京地区 962528)

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

( 14 )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

联系电话: 0532-85709787

传真电话: 0532-85709799

联系人员: 滕克

客服电话: 96588 (青岛)、40066-96588 (全国)

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

( 15 )渤海银行股份有限公司

注册地址: 天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址: 天津市河西区马场道 201-205 号

法人代表: 刘宝凤

联系电话: 022-58316666

传真电话： 022-58316259

联系人员： 王宏

客服电话： 4008888811

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

( 16 )大连银行股份有限公司

注册地址： 辽宁省大连市中山区中山路 88 号

办公地址： 辽宁省大连市中山区中山路 88 号

法人代表： 陈占维

联系电话： (0411) 82356627

传真电话： (0411) 82356590

联系人员： 李格格

客服电话： 4006640099

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

( 17 )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.drccbank.com](http://www.drccbank.com)

( 18 )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

联系电话： 020-28019593

传真电话： 020-22389014

联系人员： 黎超雄

客服电话： 020-961111

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

( 19 )天相投资顾问有限公司

注册地址： 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法人代表：林义相

联系电话：010-66045529

传真电话：010-66045518

联系人员：尹伶

客服电话：010-66045678

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

( 20 ) 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)

( 21 ) 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)

( 22 ) 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](http://www.guosen.com.cn)

( 23 )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](http://www.newone.com.cn)

( 24 )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)

( 25 )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](http://www.cs.ecitic.com)

( 26 )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](http://www.chinastock.com.cn)

（27）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](http://www.htsec.com)

（28）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)

（29）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)

（30）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：杨泽柱

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

（31）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

（32）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

（33）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)

( 34 ) 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](http://www.citicssd.com)

( 35 ) 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)

( 36 ) 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)

( 37 ) 长城证券股份有限公司

注册地址： 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址： 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法人代表： 黄耀华

联系电话：（0755）83516289

传真电话：（0755）83515567

联系人员：刘阳

客服电话：（0755）33680000（深圳）、400-6666-888（非深

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

（38）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](http://www.ebscn.com)

（39）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号

办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法人代表：李俊杰

联系电话：（021）53519888

传真电话：（021）53519888

联系人员：张瑾

客服电话：（021）962518

公司网站：[www.962518.com](http://www.962518.com)

（40）大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层

法人代表：董祥

联系电话：0351-4130322

传真电话：0351-4130322

联系人员：薛津

客服电话：4007121212

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

（41）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](http://stock.pingan.com)

( 42 ) 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)

( 43 ) 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](http://www.guodu.com)

( 44 ) 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](http://www.hx168.com.cn)

( 45 )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](http://www.hysec.com)

( 46 )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)

( 47 )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

联系电话：0755-23838751

传真电话： 0755-25838701

联系人员： 吴军

客服电话： 95358

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

( 48 )金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法人代表：陆涛

联系电话：0755-83025022

传真电话：0755-83025625

联系人员：马贤清

客服电话：400-8888-228

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

( 49 ) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法人代表：姚文平

联系电话：021-68761616

传真电话：021-68767880

联系人员：朱磊

客服电话：400 8888 128

公司网站：<http://www.tebon.com.cn>

( 50 ) 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.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

( 51 ) 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)

( 52 )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>

( 53 )上海华信证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法人代表: 杨锐敏

联系电话: 021-38784818

传真电话: 021-68775878

联系人员: 倪丹

客服电话: 68777877

公司网站: [www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

( 54 )瑞银证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法人代表: 程宜荪

联系电话: (010) 58328888

传真电话: (010)58328112

联系人员: 牟冲

客服电话: 4008878827

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

( 55 )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

（56）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

（57）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
法人代表：陈林

联系电话：021-68777222

传真电话：021-68777822

联系人员：刘闻川

客服电话：4008209898

公司网站：www.cnhbstock.com

（58）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

（59）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](http://www.tfzq.com)

(60)和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼

法人代表：王莉

联系电话：400-920-0022

传真电话：021-20835879

联系人员：于杨

客服电话：400-920-0022

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

(61)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](http://www.noah-fund.com)

(62)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](http://www.zlfund.cn)

( 63 )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](http://www.1234567.com.cn)

( 64 )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](http://www.ehowbuy.com)

( 65 )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

联系电话： 021- 60897840

传真电话： 0571-26697013

联系人员： 张裕

客服电话： 4000766123

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

( 66 )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

联系电话：010-56282140

传真电话：010-62680827

联系人员：丁向坤

客服电话：400-619-9059

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

( 67 )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](http://www.5ifund.com)

( 68 )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>

( 69 )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

联系电话：021-20289890

传真电话：021-20280110

联系人员：张倩

客服电话：400-021-8850

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

( 70 )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](http://www.5irich.com)

（71）宜信普泽投资顾问（北京）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

联系电话：010-52855713

传真电话：010-85894285

联系人员：程刚

客服电话：400-609-9200

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

（72）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

联系电话：010-62675369

传真电话：010-62675979

联系人员：付文红

客服电话：010-62675369

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

（73）北京君德汇富投资咨询有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室

办公地址：北京市东城区建国门内大街 18 号恒基中心办公楼一座 2202 室

法人代表：李振

联系电话：010-65181028

传真电话：010-65174782/65231189

联系人员： 魏尧

客服电话： 400-057-8855

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

( 74 )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](http://www.66zichan.com)

( 75 )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](http://www.lingxianfund.com)

( 76 )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](http://www.lufunds.com)

( 77 )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](http://www.yingmi.cn)

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、基金注册登记机构

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：雷青松

## 三、律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

经办律师：刘佳、张兰

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

## 四、会计师事务所和经办注册会计师

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

富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金类型

混合型

#### 六、基金的投资目标

本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择，实现基金资产较高的长期回报。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（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、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，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的其他品种，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 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，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%。

#### 八、基金的投资策略

本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。

##### 1、大类资产配置策略

本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境，主要包括国内生产总值、经济增长率、失业率、通货膨胀率、财政收支、国际收支、固定资产投资规模、货币政策和利率走势等指标，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。

#### （1）战略资产配置策略

在长期范围内，基金管理人将在理性预期的基础上获得战略资产配置的最优比例，并以此作为资产配置调整的可参照基准。主要考虑因素包括大类资产的历史回报、历史波动率、各类资产之间的相关性、行情驱动因素、类别风格轮动、行业强弱等，从其变动及趋势中得出未来资产回报、风险及相关性的可能变化。

#### （2）战术资产配置策略

在短期范围内，基金管理人将对组合进行战术资产配置，即在战略资产配置长期维持均衡的基础上积极主动的实现对大类资产配置的动态优化调整。重点考虑以下因素：

- [1] 基本面(Fundamental Factors)：评估基本面因素，包括国内外宏观形势、工业企业利润、货币政策等；
- [2] 资金面(Liquidity Factors)：评估影响股市中短期资金流；
- [3] 估值(Valuation Factors)：评估股市历史绝对、相对估值及业绩调升调降；
- [4] 市场面(Market Factors)：评估市场情绪指标、动量、技术面等指标。

## 2、股票投资策略

本基金将运用“价值为本，成长为重”的合理价格成长投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。

同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。

#### （1）第一层：侧重量化筛选

本基金重点关注由以下量化筛选过程产生的股票样本：

本基金构建的量化筛选指标主要包括：市净率（PB）、市盈率（PE）、动态市盈率（PEG）、主营业务收入增长率、净利润增长率等：

- [1] 价值股票的量化筛选：选取 PB、PE 较低的上市公司股票；
- [2] 成长型股票的量化筛选：选取动态市盈率（PEG）较低，主营业务收入增长率、净利润增长率排名靠前的上市公司股票。

## （2）第二层：突出基本面分析

在量化筛选的基础上，本基金将基于“定性定量分析相结合、动态静态指标相结合”的原则，进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。

基金管理人将通过运用（定量的）财务分析模型和资产估值模型，重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价值等方面；通过运用（定性的）上市公司质量评估模型，重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。

## 3、“自上而下”的债券投资

本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在此框架下进行具有针对性的债券选择。

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以及结构调整因素（包括：资金面结构的调整、投资者结构的变化、制度建设和品种创新等）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，力争有效控制整体资产风险。

在确定组合整体框架后，基金管理人将对收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行进一步预测，相机而动、积极调整。

在债券投资组合构建和管理过程中，基金管理人将具体采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。

（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：在确定组合久期后，基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等，在长期、中期与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：基金管理人将针对债券子市场之间不同的运行规律，在充分研究风险—收益特征、流动性特性的基础上构建与调整组合（包括跨市场套利操作），以求提高投资收益。

（4）相对价值判断：基金管理人将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进行投资，并选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将会上升的品种，减持相对高估、价格将会下降的品种。

（5）信用风险评估：基金管理人将充分利用现有行业与公司的研究力量，根据

发债主体的经营状况与现金流等情况对其信用风险进行评定与估测，以此作为品种选择的基本依据。

债券投资策略制定与贯彻的过程，也是基金管理人对于风险进行动态评估与管理的过程。在系统化的风险控制体系下，通过对管理指标的设定与监控，结合对风险定价失效机会的把握，基金管理人不但可以有效控制整体资产的风险水平，而且可以在寻求风险结构优化的过程中不断提高组合的收益水平。

#### 4、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：

（1）运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能，构建权证与标的股票的组合，主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益；

（2）构建权证与债券的组合，利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性，形成保本投资组合；

（3）针对不同的市场环境，构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合，形成多元化的盈利模式；

（4）在严格风险监控的前提下，通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究，谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

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。

#### 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

#### 十、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。

#### 十一、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 159,773,245.16 78.39

其中：股票 159,773,245.16 78.39  
 2 固定收益投资 10,000,000.00 4.91  
 其中：债券 10,000,000.00 4.91  
 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 15,000,000.00 7.36  
 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 18,492,341.70 9.07  
 7 其他资产 542,083.09 0.27  
 8 合计 203,807,669.95 100.00

## 2、报告期末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	2,647,706.60	1.40
B	采矿业	—	—
C	制造业	107,868,423.30	56.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,113,316.00	1.64
E	建筑业	16,311,962.01	8.62
F	批发和零售业	6,917,458.11	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	396,440.00	0.21
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,617,630.17	4.02
J	金融业	3,110,512.58	1.64
K	房地产业	4,035,235.89	2.13
L	租赁和商务服务业	1,033,572.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	3,447,136.50	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	1,544,699.00	0.82
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	1,729,153.00	0.91
S	综合	—	—
	合计	159,773,245.16	84.41



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

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	000034	神州数码	240,955	6,903,360.75	3.65
2	002271	东方雨虹	252,000	6,468,840.00	3.42
3	600519	贵州茅台	14,320	4,266,071.20	2.25
4	000403	ST生化	125,100	4,252,149.00	2.25
5	002507	涪陵榨菜	309,800	4,163,712.00	2.20
6	002373	千方科技	241,000	4,094,590.00	2.16
7	000928	中钢国际	247,500	3,554,100.00	1.88
8	002738	中矿资源	141,450	3,447,136.50	1.82
9	002043	兔宝宝	250,200	3,415,230.00	1.80
10	600176	中国巨石	309,200	3,361,004.00	1.78

4、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	10,000,000.00	5.28
其中：政策性金融债 10,000,000.00 5.28			
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	10,000,000.00	5.28

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	160209	16国开09	100,000	10,000,000.00	5.28
---	--------	--------	---------	---------------	------

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。

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投资。

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。

9、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。

10、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。

11、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 248,084.30
- 2 应收证券清算款 —
- 3 应收股利 —
- 4 应收利息 132,309.81
- 5 应收申购款 161,688.98
- 6 其他应收款 —
- 7 待摊费用 —
- 8 其他 —
- 9 合计 542,083.09

(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。

(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。

## 十二、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、富国宏观策略灵活配置混合型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

2013.4.12-2013.12.31 7.20% 1.15% -4.35% 0.89% 11.55% 0.26%

2014.1.1-2014.12.31 17.15% 1.10% 36.24% 0.79% -19.09% 0.31%

2015.1.1-2015.12.31 38.21% 2.08% 8.35% 1.61% 29.86% 0.47%

2016.1.1-2016.9.30 -13.33% 1.79% -6.97% 1.02% -6.36% 0.77%

2013.4.12-2016.9.30 50.44% 1.60% 31.36% 1.15% 19.08% 0.45%

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 9 月 30 日。

2、本基金于 2013 年 4 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 4 月 12 日起至 2013 年 10 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 十三、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、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 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。由托管人根据与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，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，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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

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。由托管人根据与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，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，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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。

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。

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费用

投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

（1）本基金前端申购费率按申购金额递减。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。本基金前端收费模式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。具体费率如下：

#### A、前端申购费率：

申购金额（M） 前端申购费率

M < 100 万元 1.5%

100 万元 ≤ M < 500 万元 1.2%

M ≥ 500 万元 每笔 1000 元

注：上述前端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外的其他

选择前端收费模式的投资者。

B、特定申购费率：

申购金额（含申购费） 特定申购费率

M<100 万元 0.45%

100 万元≤M<500 万元 0.36%

M≥500 万元 每笔 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台选择前端收费模式申购本公司旗下开放式基金的养老金客户，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基金等，具体包括：

- 1、全国社会保障基金；
- 2、可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3、企业年金单一计划以及集合计划；
- 4、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- 5、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。

（2）投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间 后端申购费率

1 年以内（含） 1.8%

1 年-3 年（含） 1.2%

3 年-5 年（含） 0.6%

5 年以上 0

本基金的后端收费模式目前仅适用于本公司基金直销系统，如有变更，详见届时公告或更新的招募说明书。实际办理过程中根据支付渠道不同可能存在限制办理后端申购模式的情况，具体以实际网上交易页面相关说明为准。

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、赎回费用

（1）本基金根据投资者申购方式采用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端申购费用时，适用固定的赎回费率，为 0.5%。

投资者选择交纳后端申购费用时，适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递

减，具体费率如下：

持有时间 赎回费率

2 年以内（含） 0.6%

2 年-3 年（含） 0.3%

3 年以上 0

（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，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%。

### 3、转换费用

#### A 前端转前端

（1）基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

1) 转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

2) 转入基金申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式，转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

（2）基金转换的计算：

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入金额=转出金额-转出基金赎回费

净转入金额=转入金额÷（1+申购补差费率）

申购补差费=转入金额-净转入金额

转入份额=净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后 2 位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

#### B 后端转后端

后端收费模式基金发生转换时，其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成，其中申购补差费率按照转入基金与转出基金的后端申购费率的差额计算。当转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时，基金转换申购费补差费率为转出基金与转入基金申购费率之差；当转出基金的后端申购费率低于转入基金的后端申购费率，申购补差费率为零。

（1）对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金，其后端

收费模式下份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费用=(转出金额-转出基金赎回费用)×补差费率

净转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费用

转入份额=净转入金额/转换申请当日转入基金的基金份额净值

(2) 对于由本公司担任注册登记机构的基金，后端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费=(转出金额-转出基金赎回费用)×补差费率/(1+补差费率)

净转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费用

转入份额=净转入金额/转换申请当日转入基金的基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后 2 位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

### 三、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。

### 四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

### 十四、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》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”部分更新了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、“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。
- 3、对“四、基金托管人”部分进行了更新。
- 4、“五、相关服务机构”部分对销售机构、登记机构部分信息进行了更新。



- 5、“九、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 9 月 30 日。
- 6、更新了“十、基金的业绩”，内容截止至 2016 年 9 月 30 日，并更新了历史走势对比图。
- 7、对“二十一、基金份额持有人服务”部分内容进行了更新。
- 8、更新了“二十二、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

二〇一六年十一月二十六日