

# 富国中证军工指数分级证券投资基金 招募说明书（更新）

（摘要）

（二〇一四年第一号）

富国中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2014 年 2 月 28 日【2014】236 文核准募集。本基金的基金合同于 2014 年 4 月 4 日生效。

## 重要提示

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

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。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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

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

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

本招募说明书所载内容截止至 2014 年 10 月 4 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2014 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

本基金基金管理人为富国基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

法定代表人：陈敏

总经理：陈戈

成立日期：1999年4月13日

电话：(021) 20361818

传真：(021) 20361616

联系人：范伟隽

注册资本：1.8亿元人民币

股权结构（截止于2014年10月4日）：

股东名称	出资比例（%）
海通证券股份有限公司	27.775%
申银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	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的工作，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。

公司目前下设十九个部门、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、量化与海外投资部、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、行政管理部、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;量化与海外投资部:负责量化权益投资、量化衍生品投资及境外权益等各类投资的研究与投资管理;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、华南营销中心(广州分公司)、北方营销中心(北京分公司)、西部营销中心(成都分公司)、华北营销中心,负责共同基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒体关系管理,为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持;客户服务部:拟定客户服务策略,制定客户服务规范,建设客户服务团队,提高客户满意度,收集客户信息,分析客户需求,支持公司决策;电子商务部:负责基金电子商务发展趋势分析,拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则,有效推进公司电子商务业务;战略与产品部:负责开发、维护公募和非公募产品,协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略,建立数据搜集、分析平台,为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持;监察稽核部:负责监察、风控、法务和信息披露;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;行政管理部:负责文秘、行政后勤;富国资产管理(香港)有限公司: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2014年10月4日,公司有员工265人,其中62%以上具有硕士以上学历。

## (二) 主要人员情况

### 1、董事会成员

陈敏女士，董事长。中共党员，工商管理硕士，经济师。历任上海市信托投资公司副处长、处长；上海市外经贸委处长；上海万国证券公司党委书记；申银万国证券股份有限公司副总裁、党委委员。2004 年开始担任富国基金管理有限公司董事长。

陈戈先生，董事，总经理。中共党员，硕士，1996 年起开始从事证券行业工作。曾任国泰君安证券研究所研究员。2000 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任研究策划部研究员、研究策划部经理、总经理助理、权益投资部总经理、富国基金管理有限公司副总经理。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，2014 年 1 月开始担任富国基金管理有限公司总经理。

麦陈婉芬女士 (Constance Mak)，副董事长。文学及商学学士，加拿大注册会计师。1977 年加入加拿大毕马威会计事务所的前身 Thorne Riddell 公司，并于 1989 年成为加拿大毕马威的合伙人之一。现任 BMO 金融集团亚洲业务总经理 (General Manager, Asia, International, BMO Financial Group)。

裴长江先生，董事。中共党员，硕士。历任石油部第四石油机械厂工会主席；上海万国证券公司研究员、营业部总经理助理、营业部总经理；申银万国证券公司浙江管理总部副总经理、申银万国证券公司经纪总部副总经理；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、总经理。现任海通证券股份有限公司副总经理。

方荣义先生，董事。中共党员，博士，高级会计师。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。现任申银万国证券股份有限公司财务总监。

Edgar Normund Legzdins 先生，董事。学士，加拿大注册会计师。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。现任 BMO 金融集团国际业务全球总裁 (SVP & Managing Director, International, BMO Financial Group)。

岳增光先生，董事。中共党员，本科硕士，高级会计师。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。现任山东省国际信托有限公司财务部经理。

戴国强先生，独立董事。博士学位。历任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授，金融学院副院长、常务副院长、院长；上海财经大学教授、博士生导师，金融学院党委书记，教授委员会主任。现任上海财经大学 MBA 学院院长、党委书记。

伍时焯 (Cary S. Ng) 先生，独立董事。工商管理硕士，加拿大特许会计师。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。现任圣力嘉学院 (Seneca College) 工商系会计及财务金融科教授。

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

## 2、监事会成员

金同水先生，监事长。大学专科。历任山东省国际信托有限公司科员、项目经理、业务经理；鲁信投资有限公司财务经理；山东省国际信托有限公司高级业务经理。现任山东省国际信托有限公司风险管理部经理。

沈寅先生，监事。法学学士。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。现任申银万国证券股份有限公司合规稽核总部高级法律顾问。

夏瑾璐女士，监事。工商管理硕士。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。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。

仇夏萍女士，监事。中共党员，研究生。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所主任；华夏证券有限公司上海分公司财务主管。现任海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。

李燕女士，监事。硕士。历任国信证券有限公司、富国基金管理有限公司基金会计、基金会计主管。现任富国基金管理有限公司运营总监助理。

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

唐洁女士，CFA，监事。中共党员，硕士。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。现任富国基金管理有限公司策略研究员。

### 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，副总经理。中共党员，硕士研究生。曾在中国建设银行上海市分行历任分支行职员、经理。曾在华安基金管理有限公司历任市场业务一部投资顾问、上海机构业务部总监助理、市场部总监助理、上海业务部总经理、市场部总经理、公司副营销总裁。2014 年 6 月 19 日开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

### 5、本基金基金经理

王保合先生，博士。自 2006 年 7 月开始从事证券行业工作。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

资基金基金经理。现任富国基金管理有限公司量化投资副总监。

章榭元先生，硕士。自 2008 年 7 月至 2011 年 5 月在建信基金管理有限责任公司任研究员助理、初级研究员、研究员；自 2011 年 5 月至 2013 年 12 月在富国基金管理有限公司任基金经理助理，自 2013 年 12 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，2014 年 9 月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理。

#### 6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下：公司总经理陈戈先生，权益投资部总经理朱少醒先生，固定收益投资部总经理饶刚先生等人员。

列席人员包括：督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。本基金采取集体投资决策制度。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基金托管人基本情况

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



中国建设银行拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年12月31日，中国建设银行资产总额153,632.10亿元，较上年增长9.95%；客户贷款和垫款总额85,900.57亿元，增长14.35%；客户存款总额122,230.37亿元，增长7.76%。营业收入5,086.08亿元，较上年增长10.39%，其中，利息净收入增长10.29%，净利息收益率(NIM)为2.74%；手续费及佣金净收入1,042.83亿元，增长11.52%，占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制，成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元，较上年增长11.28%；净利润2,151.22亿元，增长11.12%。资产质量保持稳定，不良贷款率0.99%，拨备覆盖率268.22%；资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%，保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个，服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户，与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系；在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年，本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可，先后荣获国内外102项奖项，多项综合排名进一步提高，在英国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5，较上年上升2位；在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中，位列第2，较上年上升13位。此外，

本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，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、监督稽核处等 9 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

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资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。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资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 2013 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 349 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 2012 年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

1、直销机构：富国基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

法定代表人：陈敏

总经理：陈戈

直销网点：上海投资理财中心

上海投资理财中心地址：上海市杨浦区大连路 588 号宝地广场 A 座 23 楼

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：林燕珺

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

2、场外代销机构

（1）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法人代表：蒋超良

联系电话：（010）85108227

传真电话：（010）85109219

联系人员：曾艳

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

（2）中国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

（3）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：胡怀邦

联系电话：（021）58781234

传真电话：（021）58408483

联系人员：曹榕

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

（4）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)

( 5) 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 8 号富华大厦 C 座

法人代表： 常振明

联系电话： (010) 65550827

传真电话： (010) 65550827

联系人员： 丰靖

客服电话： 95558

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

( 6) 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) 61616150

传真电话： (021) 63604199

联系人员： 唐苑

客服电话： 95528

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

( 7) 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)

(8) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 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

法人代表：万建华

联系电话： (021) 38670666

传真电话： (021) 38670666

联系人员： 芮敏琪

客服电话： 400-8888-666

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

(9) 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)

(10) 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： 齐晓燕

客服电话： 95536

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

(11) 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)

(12) 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 (43

办公地址: 广东省广州天河区大都会广场 5、18、19、36、38

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)

(13) 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

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: 王东明

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)

(14) 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）66568430

传真电话：（010）66568990

联系人员：田薇

客服电话：4008-888-888

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

(15) 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)

(16) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址：上海市常熟路 171 号

法人代表：储晓明

联系电话：（021）54033888

传真电话：（021）54038844

联系人员：王序微

客服电话：（021）962505

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

(17) 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](http://www.95579.com)

(18) 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

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

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)

(19) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法人代表：沈强

联系电话：0571-85776114

传真电话：0571-85783771

联系人员：李珊

客服电话：95548

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

(20) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法人代表：吴万善

联系电话：0755-82569143

传真电话：0755-82492962

联系人员：孔晓君

客服电话：95597

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

(21) 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 2

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 2

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)

(22) 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：400-800-8899

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

(23) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16

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（非深圳）

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

(24) 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：021-22169999

联系人员：刘晨

客服电话：95525

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

(25) 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：龚德雄

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)

(26) 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：郑舒丽

客服电话：95511-8

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

(27) 国都证券有限责任公司

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

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

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)

(28) 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：张曼

客服电话：95584

公司网站：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(29) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法人代表：冯戎

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)

(30) 齐鲁证券有限公司

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)

(31) 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)

(32) 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

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、

法人代表： 龙增来

联系电话： （0755） 82023442

传真电话： （0755） 82026539

联系人员： 刘毅

客服电话： 95532、400-600-8008

公司网站： [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(33) 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)

(34) 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)

(35) 杭州数米基金销售有限公司

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)

(36) 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)

(37) 渤海证券股份有限公司

注册地址： 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址： 天津市南开区宾水西道 8 号

法人代表： 杜庆平

联系电话： 022-28451709

传真电话： 022-28451892

联系人员： 胡天彤

客服电话： 400-651-5988

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

(38) 方正证券股份有限公司

注册地址： 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址： 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法人代表： 雷杰

联系电话： (010) 57398062

传真电话： (010) 57398058

联系人员： 徐锦福

客服电话： 95571

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

(39) 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)

(40) 中航证券有限公司

注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A

办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A

法人代表: 王宜四

联系电话: 0791-86768681

传真电话: 0791-86770178

联系人员: 戴蕾

客服电话: 400-8866-567

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

(41) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法人代表: 闫振杰

联系电话: (010) 62020088

传真电话: (010) 62020088

联系人员: 宋丽冉

客服电话: 4008886661

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



(42) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 2

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 2

法人代表：蔡一兵

联系电话：（0731）4403319

传真电话：（0731）4403439

联系人员：郭磊

客服电话：（0731）4403319

公司网站：www.cfzq.com

(43) 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

其他代销机构详见基金份额发售公告或其他变更代销机构的公告。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

3、场内代销机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员。

**（二）登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

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：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

## 四、基金的名称

富国中证军工指数分级证券投资基金

## 五、基金的类型

股票型

## 六、基金份额的分级

本基金的基金份额包括富国中证军工指数分级证券投资基金之基础份额（即“富国军工份额”）、富国中证军工指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“富国军工 A 份额”）与富国中证军工指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“富国军工 B 份额”）。其中，富国军工 A 份额、富国军工 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

## 七、基金份额的配对转换

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

（一）配对转换是指本基金的富国军工份额与富国军工 A 份额、富国军工 B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

### 1. 分拆

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

### 2. 合并

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

## 八、基金的投资目标

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

## 九、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证军工指数的成份股、备选成份股、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监

会的相关规定)。

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

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

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

## 十、基金的投资策略

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

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

### 1. 资产配置策略

本基金管理人主要按照中证军工指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,其中投资于中证军工指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 2. 股票投资组合构建

### （1）组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证军工指数的收益表现。

### （2）组合调整

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

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

#### ① 定期调整

根据中证军工指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### ② 不定期调整

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

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪中证军工指数；

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

### 3. 债券投资策略

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

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

#### 4. 金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

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

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

#### （四）投资决策与交易机制

##### 1、本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员，负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

##### 2、投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

（1）基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

（2）投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

(3) 基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

(4) 对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

## 十一、业绩比较基准

95%×中证军工价格指数收益率 + 5%×银行人民币活期存款利率（税后）

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

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。若业绩比较基准和标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒体上公告。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，并在指定媒体上公告。

## 十二、风险收益特征

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

## 十三、基金投资组合报告

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,699,479,231.33	87.35
	其中：股票	3,699,479,231.33	87.35
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	303,014,969.25	7.15
7	其他资产	232,720,129.59	5.49
8	合计	4,235,214,330.17	100.00

## 2、报告期末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。

## 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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	3,352,490,855.94	84.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	42,973,284.20	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	285,238,341.14	7.23
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	18,776,750.05	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,699,479,231.33	93.71

## 4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------



1	601989	中国重工	57,197,060	375,212,713.60	9.50
2	600150	中国船舶	5,590,472	203,493,180.80	5.15
3	000768	中航飞机	10,813,946	170,752,207.34	4.33
4	300024	机器人	4,161,267	148,973,358.60	3.77
5	600893	航空动力	4,587,544	136,341,807.68	3.45
6	600271	航天信息	4,521,078	113,885,954.82	2.88
7	600372	中航电子	4,232,429	113,259,800.04	2.87
8	600118	中国卫星	4,701,676	112,793,207.24	2.86
9	600879	航天电子	6,614,668	103,585,700.88	2.62
10	002465	海格通信	5,536,009	97,323,038.22	2.47

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

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

的交易成本。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

12、投资组合报告附注

(1) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	511,438.72
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	76,347.50
5	应收申购款	232,105,070.21
6	其他应收款	—
7	待摊费用	27,273.16
8	其他	—
9	合计	232,720,129.59

(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

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	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	---------	--------	----------

			公允价值(元)	值比例 (%)	
1	000768	中航飞机	170,752,207.34	4.33	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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十四、基金的业绩

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

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.4.4-2014.9.30	48.40%	1.44%	57.56%	1.50%	-9.16%	-0.06%
2014.7.1-2014.9.30	33.45%	1.58%	35.07%	1.63%	-1.62%	-0.05%

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2014年9月30日。

2、本基金于2014年4月4日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。本基金建仓期6个月，即从2014年4月4日起至2014年10月3日，截至本报告期

末，本基金尚处于建仓期。

## 十五、费用概览

### 一、基金费用

#### (一)基金费用的种类

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

在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

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

#### (三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致

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

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

## 2. 基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

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

## 3、基金的指数使用许可费

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

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

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

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

#### (四) 不列入基金费用的项目

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

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

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费

投资人申购本基金份额时，需交纳申购费用，费率按申购金额递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

#### (1) 场外申购费率

本基金对通过直销中心场外申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额M（含认购费）	申购费率
M<100万元	0.36%
100万元≤M<200万元	0.18%
200万元≤M<500万元	0.12%

M $\geq$ 500万元	每笔1000元
----------------	---------

除上述养老金客户外，其他投资者场外申购富国军工份额，申购费率如下：

申购金额M（含认购费）	申购费率
M<100万元	1.20%
100万元 $\leq$ M<200万元	0.60%
200万元 $\leq$ M<500万元	0.40%
M $\geq$ 500万元	每笔1000元

## （2）场内申购费率

本基金的场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

## 2、赎回费率

本基金场内场外赎回费率都为 0.50%。

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

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

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

## 三、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。



## 十六、基金份额折算

### （一）定期份额折算

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

#### 1. 基金份额折算基准日

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

#### 2. 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的富国军工 A 份额、富国军工份额。

#### 3. 基金份额折算频率

每年折算一次。

#### 4. 基金份额折算方式

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

有关计算公式如下：

#### （1）富国军工份额

$$NAV_{\text{军工}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前富国军工份额的资产净值} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_{\text{军工}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{军工}}^{\text{前}}}$$

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

富国军工份额持有人新增的富国军工份额=

其中：

$NAV_{\text{后}}^{\text{后}}$ ：折算后富国军工份额的基金份额净值，下同

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

$NUM^{\text{前}}$ ：折算前富国军工份额的份额数，下同

持有场外富国军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国军工份额的分配；持有场内富国军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国军工份额的分配。

#### （2）富国军工 A 份额

定期份额折算后富国军工 A 份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

定期份额折算后富国军工 A 份额的份额数 = 定期份额折算前富国军工 A 份额的份额数

富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数 =

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

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：折算前富国军工 A 份额的份额数，下同

#### （3）富国军工 B 份额

定期份额折算不改变富国中证军工板 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

#### （4）折算后的富国军工份额总份额数

折算后富国军工份额的总份额数 = 折算前富国军工份额的份额数 + 富国军工份额持有人新增的富国军工份额的份额数 + 富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数

### （二）不定期份额折算

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

1.当富国军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将按以下规则进行不定期份额折算：

(1) 基金份额折算基准日

富国军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，基金管理人将确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的富国军工 A 份额、富国军工 B 份额和富国军工份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

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

1) 富国军工份额

$$\text{富国军工份额持有人新增的富国军工份额数} = \frac{(\text{NAV}_{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{前}}}{1.000}$$

持有场外富国军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国军工份额的分配；持有场内富国军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国军工份额的分配。

## 2) 富国军工 A 份额

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

富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数

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

其中,

$NUM_A^{\text{后}}$ : 折算后富国军工 A 份额的份额数, 下同

## 3) 富国军工 B 份额

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

富国军工 B 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数

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

其中,

$NUM_B^{\text{后}}$ : 折算后富国军工 B 份额的份额数, 下同

$NUM_B^{\text{前}}$ : 折算前富国军工 B 份额的份额数, 下同

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

## 4) 折算后富国军工份额的总份额数

折算后富国军工份额的总份额数=折算前富国军工份额的份额数+富国军工份额持有人新增的富国军工份额数+富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额数+富国军工 B 份额持有人新增的场内富国军工份额数

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

(1) 基金份额折算基准日

富国军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，基金管理人将确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的富国军工 A 份额、富国军工 B 份额、富国军工份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

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

1) 富国军工 B 份额

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

2) 富国军工 A 份额

折算后富国军工 A 份额与富国军工 B 份额的份额配比保持 1: 1 不变，即

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数=

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

3) 富国军工份额

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

NUM<sub>折</sub>：

富国军工份额持有人持有的折算后的富国军工份额的份额数，下同

4) 折算后富国军工份额的总份额数

折算后富国军工份额的总份额数=富国军工份额持有人持有的折算后的富国军工份额的份额数+富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额数

### （三）折算份额数的处理方式

折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### （四）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停相关份额的上市交易和富国军工份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### （五）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

### （六）特殊情形的处理

1.基金合同生效不满三个月，基金管理人可以不进行定期份额折算；

2.若在定期份额折算基准日发生发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算；

3.在市场出现极端情况时，基金管理人可以在富国军工 B 份额未跌至 0.250 元以下时提前进行不定期份额折算，无须召开基金份额持有人大会，但须由基金管理人在指定媒体上公告。折算方式参照富国军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下时进行不定期份额折算的规则，具体以届时公告为准。

### （七）其他事项

基金管理人、深圳证券交易所、基金注册登记机构有权调整上述规则，本基

金《基金合同》将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## 十七、对招募说明书更新部分的说明

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

- 1、在“重要提示”部分，增加了基金合同生效日、招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
- 2、在“三、基金管理人”中，对基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况及基金托管业务经营情况进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”中，对直销机构、代销机构部分信息进行了更新。
- 5、在“七、基金的募集”部分，删除了募集期、发售对象、发售方式等已不适用信息，增加了本基金募集情况；
- 6、“八、基金备案与基金合同的生效”部分删除了部分不适用信息，增加了基金合同生效日。
- 7、“十、富国中证军工份额的申购与赎回”部分，增加了本基金开放申购、赎回的日期。
- 8、“十三、基金的投资”部分，增加了基金投资组合报告，内容截止至2014年9月30日。
- 9、增加了“十四、基金的业绩”，内容截止至2014年9月30日。
- 10、增加了“二十七、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  
二〇一四年十一月十八日