

# 富国沪深 300 增强证券投资基金招募说明书（更新）

（二〇二〇年第三号）

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会 2009 年 10 月 21 日证监许可【2009】1106 号文核准。本基金的基金合同于 2009 年 12 月 16 日正式生效。

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

投资有风险，投资人拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

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 2020 年 4 月 20 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

本次招募说明书更新内容为：

- 1、“第三部分 基金管理人”，更新基金管理人信息。
- 2、“第四部分 基金托管人”，更新基金托管人信息。
- 3、“第九部分 基金的投资”，投资范围增加存托凭证，并相应增加存托凭证的投资策略、投资比例限制。
- 4、“第十二部分 基金资产的估值”，增加存托凭证估值的相关内容。
- 5、“第十六部分 基金的信息披露”，增加存托凭证信息披露的相关内容。
- 6、“第十七部分 风险揭示”，增加存托凭证特别风险。
- 7、“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”中，增加存托凭证投资监督等

相关内容。

## 目录

第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 基金管理人 .....	7
第四部分 基金托管人 .....	20
第五部分 相关服务机构 .....	25
第六部分 基金的募集 .....	61
第七部分 基金合同的生效 .....	62
第八部分 基金份额的申购与赎回 .....	63
第九部分 基金的投资 .....	79
第十部分 基金的业绩 .....	92
第十一部分 基金的财产 .....	94
第十二部分 基金资产的估值 .....	96
第十三部分 基金的收益与分配 .....	101
第十四部分 基金费用与税收 .....	103
第十五部分 基金的会计与审计 .....	106
第十六部分 基金的信息披露 .....	107
第十七部分 风险揭示 .....	113
第十八部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算 .....	120
第十九部分 基金合同的内容摘要 .....	122
第二十部分 基金托管协议的内容摘要 .....	137
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....	155
第二十二部分 其他应披露事项 .....	157

---

第二十三部分 招募说明书存放及其查阅方式 .....	159
第二十四部分 备查文件 .....	160

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）和其他有关法律法规的规定，以及《富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了富国沪深 300 增强证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由富国基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：依据《基金合同》所募集的富国沪深 300 增强证券投资基金
- 2、《基金合同》、本合同：《富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
- 3、中国：中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
- 4、法律法规：中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件及其制定机构所作出的修订、补充和有权解释
- 5、《证券法》：《中华人民共和国证券法》
- 6、《基金法》：《中华人民共和国证券投资基金法》
- 7、《销售办法》：《证券投资基金销售管理办法》
- 8、《运作办法》：《证券投资基金运作管理办法》
- 9、《信息披露办法》：《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
- 10、《流动性风险管理规定》：《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》
- 11、元：中国法定货币人民币元
- 12、招募说明书：《富国沪深 300 增强证券投资基金招募说明书》及其更新
- 13、托管协议：基金管理人与基金托管人签订的《富国沪深 300 增强证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
- 14、发售公告：《富国沪深 300 增强证券投资基金基金份额发售公告》
- 15、《业务规则》：《富国基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 16、中国证监会：中国证券监督管理委员会
- 17、银行监管机构：中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的银行业监管机构
- 18、基金管理人：富国基金管理有限公司

- 19、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
- 20、基金份额持有人：根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
  - 21、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
  - 22、基金直销机构：指富国基金管理有限公司
  - 23、基金代销机构：符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
  - 24、销售机构：基金管理人及基金代销机构
  - 25、基金销售网点：基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
  - 26、注册登记业务：基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
  - 27、基金注册登记机构：富国基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构
  - 28、《基金合同》当事人：受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
  - 29、个人投资者：符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
  - 30、机构投资者：符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
  - 31、合格境外机构投资者：符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
  - 32、投资者：个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
  - 33、基金合同生效日：基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，



基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日

34、募集期：自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限

35、基金存续期：《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间

36、日/天：公历日

37、月：公历月

38、工作日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

39、开放日：销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日

40、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

41、T 日：申购、赎回或办理其他基金业务的申请日

42、T+n 日：自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

43、认购：在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为

44、发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为

45、申购：基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为

46、赎回：基金份额持有人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为

47、巨额赎回：在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形

48、基金账户：基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户

49、交易账户：各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金申购、赎回、转换及转托管等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

50、转托管：投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务

51、基金转换：投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的

且由同一基金注册登记机构办理注册登记的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为

52、定期定额投资计划：投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

53、基金利润：基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

54、基金资产总值：基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

55、基金资产净值：基金资产总值扣除负债后的净资产值

56、基金份额净值：估值日基金资产净值除以估值日发行在外的基金份额总数的数值

57、基金资产估值：计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程

58、货币市场工具：现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

59、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

60、摆动定价机制：当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

61、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露

网站）等媒介

62、不可抗力：本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

63、基金产品资料概要：指《富国沪深 300 增强证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本招募说明书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）

## 第三部分 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 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27-30 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 2020 年 04 月 20 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2020年3月31日，公司有员工491人，其中69%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，研究生学历。现任富国基金管理有限公司总经理。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，高级会计师。现任申万宏源证券有限公司副总经理、首席风险官、财务总监、董事会秘书。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任，厦门大学工商管理教育中心副教授，中国人民银行深圳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监管处处长，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、海通国际证券非执行董事、海通银行非执行董事。历任海通证券有限公司计划财务部员工、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。

吴惠明先生，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。历任上海申银证券公司浦西管理总部交易部员工，申银万国证券股份有限公司经纪管理总部员工、办公室秘书、固定收益总部财务经理、党委办公室主任兼任党委组织部副部长、人力资源总部副总经理，申万宏源证券有限公司党建工作部/党委办公室主任。

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。

王平先生，董事，硕士，高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司财务总监。历任山东鲁信实业集团公司计划财务部副经理、经理，山东鲁信投资集团股份有限公司、山东鲁信房地产投资开发有限公司财务部经理，鲁信创业投资集团股份有限公司财务总监，鲁信资本管理有限公司财务总监。

李彧先生，独立董事，研究生学历，高级经济师。现任上海紫江（集团）有限公司副董事长、执行副总裁，上海威尔泰工业自动化股份有限公司董事长，上海紫竹高新区（集团）有限公司副董事长。历任上海紫江（集团）有限公司研究

室科长、总裁室经理、总裁特别助理、董事、副总裁，上海紫江企业集团股份有限公司董事长。

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。

李启安先生，独立董事，本科学历。现已退休。历任加拿大花旗银行副总裁，加拿大皇家地产服务有限公司亚洲业务发展部总监，MKI 集团有限公司（香港上市公司）执行董事，获多利金融服务有限公司（香港汇丰银行子公司）中国部高级副总裁，上海万都房产发展有限公司高级副总裁，香港大昌行集团有限公司（中信泰富集团子公司）集团财务总经理及曾派驻为上海总经理，香港汇丰银行私人银行部高级副总裁并派驻上海分行任财富管理总经理，香港万都集团有限公司执行董事及首席财务官。

刘江宁女士，独立董事，博士，副教授。现任对外经贸大学全球化与中国现代问题研究所研究员。历任山东财经大学教师。

## （二） 监事会成员

付吉广先生，监事长，硕士，高级经济师。现任山东省国际信托股份有限公司风控总监。历任济宁市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、稽核法律部副经理、经理、风险管理部经理，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。

曹志刚先生，监事，硕士。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风险控制总部（稽核部）二级部经理、稽核部总经理助理。

孙兆军先生，监事，研究生学历。现任申万宏源证券有限公司法律合规总部副总经理（主持工作）。历任上海市经济工作党委副书记科员，上海市经济和信息化工作党委副书记科员、主任科员，上海证监局主任科员，兴业银行上海分行



金融市场部业务经理，申银万国证券股份有限公司资产管理事业部产品评审总部副总经理，申万宏源证券有限公司资产管理事业部业务管理总部、业务拓展总部总经理、合规与风险管理中心副主任兼风险管理总部副总经理。

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。

夏志辉先生，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司集中交易部投研中台总监兼高级金融平台研究经理。历任北京江河幕墙工程有限公司 ERP 部门系统管理员，上海霸才软件有限公司系统信息部系统管理员，上海绘梦视信息技术有限公司技术部数据库管理员，富国基金管理有限公司信息部高级系统管理员，光大保德信基金管理有限公司信息部主管，富国基金管理有限公司集中交易部风控总监助理兼高级风险管理经理、集中交易部风控副总监兼高级风险管理经理。

孙玉礼先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司权益投资部资深基金专员。历任美世咨询数据中心数据分析师，韬睿惠悦管理咨询（深圳）有限公司福利部精算顾问，上海泽奔商务咨询有限公司咨询顾问，富国基金管理有限公司高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理兼资深项目经理、基金专员。

程铨女士，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司机构服务部机构副总监兼资深项目经理。历任富国基金管理有限公司机构客户经理、高级机构客户经理、高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理。

黄奥博先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司战略与产品部产品总监兼资深产品经理。历任国联安基金管理有限公司产品部产品经理助理，齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司产品部产品高级经理，富国基金管理有限公司产品经理、高级产品开发经理、资深产品开发经理。

### （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：

1) 方旻，硕士，自2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015年5月至2019年11月任

富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金（已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金）的基金经理，2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 7 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 7 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理，2020 年 2 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。

2) 李笑薇，博士，曾任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 (BarclaysGlobal 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，2011 年 1 月至 2012 年 5 月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，2009 年 12 月至今任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 10 月至今任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；兼任副总经理；具有中国基金从业资格。

(2) 历任基金经理：

常松自 2009 年 12 月至 2011 年 5 月担任本基金基金经理

#### (六) 投资决策委员会成员

公司投委会成员：总经理陈戈，分管副总经理朱少醒，分管副总经理李笑薇

#### (七) 其他

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，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、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《中华人民共和国证券法》、《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）利用基金财产或者职务之便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）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和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，不按照规定履行职责；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 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；
- (9) 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；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；
- (14) 其他法律法规禁止的行为。

## 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、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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职能部门，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职能部门，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。



## 第四部分 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 35,640,625.71 万元  
联系电话：010-66105799  
联系人：郭明

### 二、主要人员情况

截至 2020 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 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 2020 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1094 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十七年获得香港《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 73 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。

#### 四、 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

##### 1、 内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、 内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、 内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，

并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务

营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随

着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### **五、 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第五部分 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 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

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：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

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：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法人代表：周慕冰

联系人员：贺倩

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

（3）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

（4）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

（5）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：任德奇

联系人员：王菁

客服电话：95559

公司网站：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： 高国富

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 ）兴业银行股份有限公司

注册地址： 福建省福州市湖东路 154 号

办公地址： 上海市银城路 167 号兴业银行大厦

法人代表： 陶以平

联系人员： 孙琪虹

客服电话： 95561

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

（ 10 ）中国光大银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

办公地址： 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法人代表： 唐双宁



联系人员： 朱红

客服电话： 95595

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

（ 11 ）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](http://www.cmbc.com.cn)

（ 12 ）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

联系人员： 王硕

客服电话： 95580

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

（ 13 ）北京银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址： 北京市西城区金融大街丙 17 号

法人代表： 闫冰竹

联系人员： 谢小华

客服电话： 95526

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

（ 14 ）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

联系人员： 郑鹏

客服电话： 95577

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

（ 15 ）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

联系人员： 龚厚红

客服电话： 021-962888

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

（ 16 ）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](http://www.bank.pingan.com)

（ 17 ）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)

（ 18 ）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](http://www.qdccb.com)

（ 19 ）东莞银行股份有限公司

注册地址： 东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址： 东莞市莞城区体育路 21 号

法人代表： 廖玉林

联系人员： 巫渝峰

客服电话： 0769-96228

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

（ 20 ）温州银行股份有限公司

注册地址： 温州市车站大道 196 号

办公地址： 温州市车站大道 196 号

法人代表： 邢增福

联系人员： 姜晟

客服电话： 96699 浙江省内-， 962699 上海地区-， 0577-9669

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

（ 21 ）江苏银行股份有限公司

注册地址： 江苏省南京市洪武北路 55 号

办公地址： 江苏省南京市洪武北路 55 号

法人代表： 黄志伟

联系人员： 田春慧

客服电话： 95319

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

（ 22 ）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： 李伏安

联系人员： 王宏

客服电话： 4008-888-811

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

（ 23 ）洛阳银行股份有限公司

注册地址： 河南省洛阳市洛龙区开元大道 256 号洛阳银行

办公地址： 河南省洛阳市洛龙区开元大道 256 号洛阳银行

法人代表： 王建甫

联系人员： 李亚洁

客服电话： 96699

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

（ 24 ）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：

联系人员： 李格格

客服电话： 4006640099

公司网站： [www.bankofd1.com](http://www.bankofd1.com)

（ 25 ）浙江民泰商业银行股份有限公司

注册地址： 浙江省温岭市太平街道三星大道 168 号

办公地址： 浙江省杭州市江干区丹桂街 10 号

法人代表： 江建法

联系人员： 沈斯诺

客服电话： 95343

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

（ 26 ）江苏昆山农村商业银行股份有限公司

注册地址： 江苏省昆山市前进中路 219 号

办公地址： 江苏省昆山市前进中路 219 号

法人代表： 刘斌

联系人员： 丁丽丽

客服电话： 96079

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

（ 27 ）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：020-9611111

公司网站：www.grcbank.com

（28）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

（29）南洋商业银行（中国）有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 800 号三层、六层至九层（不含六层 A 座）

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 800 号三层、六层至九层（不含六层 A 座）

法人代表：陈孝周

联系人员：陆贇

客服电话：400-830-2066

公司网站：www.ncbchina.cn

（30）浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

注册地址：浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号

办公地址：浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号

法人代表：俞俊海

联系人员：孟建潮

客服电话：400-8896-596

公司网站：www.borf.cn

（ 31 ）深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址： 深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法人代表： 顾敏

联系人员： 邹榆

客服电话： 95384

公司网站： <https://www.webank.com/>

（ 32 ）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)

（ 33 ）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

联系人员： 权唐

客服电话： 400-8888-108

公司网站： [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（ 34 ）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)

（ 35 ）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

( 36 ) 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  
联系人员：黄岚  
客服电话：95575  
公司网站：www.gf.com.cn

( 37 ) 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

( 38 ) 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

（ 39 ）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)

（ 40 ）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)

（ 41 ）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： 杨华辉

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)

（ 42 ）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： 李新华

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)

（ 43 ）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：王连志

联系人员：陈剑虹

客服电话：400-800-1001

公司网站：www.essence.com.cn

（44）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

联系人员：张煜

客服电话：4008-096-096

公司网站：www.swsc.com.cn

（45）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法人代表：孙永祥

联系人员：江恩前

客服电话：95351

公司网站：www.xcsc.com

（46）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

法人代表：余政

联系人员：赵明

客服电话：400-6198-888

公司网站：www.msyzq.com

（47）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

联系人员：蔡霆

客服电话：400-651-5988

公司网站：www.bhzq.com

（48）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：张伟

联系人员：庞晓芸

客服电话：95597

公司网站：www.htsc.com.cn

（49）山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法人代表：侯巍

联系人员：郭熠

客服电话：400-666-1618、95573

公司网站：www.i618.com.cn

（50）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：姜晓林

联系人员：吴忠超

客服电话：95548 或 400-889-5548

公司网站：www.zxzqsd.com.cn

（ 51 ）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

联系人员： 唐静

客服电话： 95321

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

（ 52 ）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

联系人员： 胡月茹

客服电话： 95503

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

（ 53 ）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

联系人员： 徐锦福

客服电话： 95571

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

（ 54 ）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： 曹宏

联系人员： 刘阳

客服电话： 95514

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

（ 55 ）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：周健男

联系人员：姚巍

客服电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

（56）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

（57）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

联系人员：张瑾

客服电话：400-819-8198

公司网站：www.shzq.com

（58）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

联系人员：薛津

客服电话：4007121212

公司网站：www.dtsbc.com.cn

（59）国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法人代表：姚志勇

联系人员：沈刚

客服电话：95570

公司网站：www.glsc.com.cn

（60）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法人代表：杨宇翔

联系人员：吴琼

客服电话：95511-8

公司网站：stock.pingan.com

（61）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座 0327

法人代表：李工

联系人员：甘霖

客服电话：95318, 4008096518

公司网站：www.hazq.com

（62）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

联系人员：牛孟宇

客服电话：95563

公司网站：www.ghzq.com.cn

（63）中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法人代表： 菅明军

联系人员： 程月艳

客服电话： 95377

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

（ 64 ）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： 王少华

联系人员： 黄静

客服电话： 400-818-8118

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

（ 65 ）东海证券股份有限公司

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

办公地址： 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法人代表： 钱文俊

联系人员： 王一彦

客服电话： 95531；400-8888-588

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

（ 66 ）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)

（ 67 ）恒泰证券股份有限公司

注册地址： 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址： 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法人代表： 庞介民

联系人员: 王旭华

客服电话: 0471-4972343

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

( 68 )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

联系人员: 李巍

客服电话: 4008-000-562

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

( 69 )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)

( 70 )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)

( 71 )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

联系人员： 马贤清

客服电话： 400-8888-228

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

（ 72 ）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

联系人员： 朱磊

客服电话： 400-8888-128

公司网站： <http://www.tebon.com.cn>

（ 73 ）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)

（ 74 ）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

联系人员： 李昕田

客服电话： 0931-96668、4006898888

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

（ 75 ）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



联系人员：陶亭

客服电话：010-65051166

公司网站：<http://www.cicc.com.cn>

( 76 )财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 16、17 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 16、17 楼

法人代表：沈继宁

联系人员：章力彬

客服电话：95336 浙江省-，4008696336 全国-

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

( 77 )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：陈灿辉

联系人员：倪丹

客服电话：68777877

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

( 78 )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/>

( 79 )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

联系人员：牟冲

客服电话: 4008878827

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

( 80 ) 中国中金财富证券有限公司

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

联系人员: 张鹏

客服电话: 95532、400-600-8008

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

( 81 ) 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>

( 82 ) 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: 黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法人代表: 赵洪波

联系人员: 姜志伟

客服电话: 956007

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

( 83 ) 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

联系人员： 李慧灵

客服电话： 400-898-9999

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

（ 84 ）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

联系人员： 杨晨

客服电话： 4008-005-000

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

（ 85 ）大通证券股份有限公司

注册地址： 大连市中山区人民路 24 号

办公地址： 大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层

法人代表： 张智河

联系人员： 谢立军

客服电话： 4008-169-169

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

（ 86 ）太平洋证券股份有限公司

注册地址： 云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址： 北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元

法人代表： 李长伟

联系人员： 王璇

客服电话： 95397

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

（ 87 ）开源证券股份有限公司

注册地址： 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址： 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法人代表： 李刚

联系人员： 邵丹

客服电话： 95325

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

( 88 ) 联储证券有限责任公司

注册地址： 深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址： 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层联储证券

法人代表： 吕春卫

联系人员： 丁倩云

客服电话： 400-620-6868

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

( 89 ) 中信期货有限公司

注册地址： 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址： 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法人代表： 张皓

联系人员： 韩钰

客服电话： 400-990-8826

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

( 90 ) 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

联系人员： 尹伶

客服电话： 010-66045678

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

( 91 ) 江苏金百临投资咨询有限公司

注册地址： 无锡市太湖新城锦溪道楝泽路 9 号楼

办公地址：无锡市太湖新城锦溪道棟泽路 9 号楼

法人代表：费晓燕

联系人员：袁丽萍

客服电话：0510-9688988

公司网站：www.jsjbl.com

（92）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>

（93）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 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

联系人员：于杨

客服电话：400-920-0022

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

（94）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法人代表：吴言林

联系人员：林伊灵

客服电话：025-66046166-810

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

（95）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/>

（ 96 ）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)

（ 97 ）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)

（ 98 ）诺亚正行基金销售有限公司

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)

（ 99 ）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

(100) 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

(101) 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

(102) 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

(103) 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)

(104) 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)

(105) 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

联系人员: 宋丽冉

客服电话: 4008-886-661

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

(106) 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>

(107) 中期资产管理有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层

办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层

法人代表: 路瑶

联系人员: 侯英建



客服电话： 95162， 4008888160

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

(108) 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)

(109) 北京创金启富基金销售有限公司

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

联系人员： 张旭

客服电话： 400-6262-818

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

(110) 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)

(111) 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)

(112) 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/>

(113) 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)

(114) 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.hcjjin.com](http://www.hcjjin.com)

(115) 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)

(116) 上海大智慧基金销售有限公司

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/>

(117) 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)

(118) 北京辉腾汇富基金销售有限公司

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： 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室

法人代表： 李振

联系人员： 魏尧

客服电话： 400-057-8855

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

(119) 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)

(120) 上海万得基金销售有限公司

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)

(121) 上海联泰基金销售有限公司

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

联系人员: 凌秋艳

客服电话: 400-046-6788

公司网站: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(122) 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)

(123) 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

联系人员: 李晓明

客服电话: 4000-178-000

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

(124) 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)

(125) 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)

(126) 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>

(127) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 北京市宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法人代表: 彭运年

联系人员： 陈珍珍

客服电话： 400-8909-998

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

(128 )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/>

(129 )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)

(130 )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)

(131 )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： 400-159-9288

公司网站： danjuanapp.com

(132 )钱滚滚财富投资管理上海有限公司

注册地址： 中国上海-自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 729S

办公地址： 上海市浦东新区商城路 618 号良友大厦 B301-305 室

法人代表： 许欣

联系人员： 屠帅颖

客服电话： 400-700-9700

公司网站： www.qiangungun.com

(133 )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

(134 )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

(135 )玄元保险代理有限公司

注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址： 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法人代表： 马永谕

联系人员： 卢亚博

客服电话： 400-080-8208

公司网站： www.licaimofang.cn

(136 )中国人寿保险股份有限公司

注册地址： 中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址： 中国北京市西城区金融大街 16 号

法人代表： 杨明生

联系人员： 陈慧

客服电话： 010-63631519

公司网站： www.e-chinalife.com

### （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，并在基金管理人网站公示。

## 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 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 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

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：安冬

经办律师：秦悦民、安冬

#### **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

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：蒋燕华

经办注册会计师：蒋燕华、费泽旭

## 第六部分 基金的募集

本基金为契约型开放式基金，基金存续期限为不定期。本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定募集，募集申请经中国证监会 2009 年 10 月 21 日证监许可【2009】1106 号文核准。

### 一、 基金类型

股票型

### 二、 基金运作方式

契约型开放式

### 三、 基金存续期限

不定期

### 四、 募集情况

经安永华明会计师事务所验资，本次募集的有效认购户数为 29,848 户，有效认购申请金额为 3,508,964,363.04 元人民币，扣除认购费后，净销售金额为人民币 3,489,423,164.75 元，折合基金份额 3,489,423,164.75 份；募集资金在基金合同生效前产生的利息共计 486,138.27 人民币元，折合 486,138.27 份基金份额归基金份额持有人所有。上述资金已于 2009 年 12 月 15 日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的富国沪深 300 增强证券投资基金托管专户。按照每份基金份额初始面值 1.00 元计算，本次募集期的有效认购份额 3,489,423,164.75 份，利息结转的基金份额 486,138.27 份，两项合计共 3,489,909,303.02 份基金份额。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、 基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购户数不少于200户的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

《基金合同》生效时,认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。

### 二、 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

### 三、 基金合同生效

根据有关规定,本基金满足《基金合同》生效条件,《基金合同》于2009年12月16日正式生效。自《基金合同》生效日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、 申购和赎回场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。

投资人可通过按照规定的方式进行申购或赎回。本基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### 二、 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对开放日和开放日的具体业务办理时间进行调整，但此项调整应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### 2、 申购的开始时间及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。本基金从2010年3月8日起开始办理申购业务。

#### 3、 赎回的开始时间及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。本基金从2010年3月8日起开始办理赎回业务。

4、 基金管理人应在开始办理申购赎回的3个工作日前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

### 三、 申购和赎回的原则

- 1、未知价原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、金额申购、份额赎回原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、先进先出原则，即基金份额持有人在赎回基金份额，基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；
- 4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。
- 5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

### 四、 申购和赎回的数额限定

#### 1、 申购金额的限制

基金管理人规定，本基金单笔最低申购金额为人民币 1 元（含申购费），投资者通过代理销售机构申购本基金时，除需满足基金管理人最低申购金额限制外，当代理销售机构设定的最低金额高于上述金额限制时，投资者还应遵循相关代理销售机构的业务规定。

直销网点每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元（含申购费），追加申购的最低金额为单笔 20,000 元（含申购费）；已在直销网点有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。通过本公司网上交易系统办理基金申购业务的不受直销网点单笔申购最低金额的限制，申购最低金额为单笔 1 元（含申购费）。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 0.01 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 0.01 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 五、 申购和赎回的程序

### 1、 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

### 2、 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金管理人或其委托的注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在T+2日后（包括该日）及时向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### 3、 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

#### 4、申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述注册登记办理时间进行调整，并应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

### 六、基金的申购费和赎回费

#### 1、申购费用

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。

##### （1）前端收费模式

前端收费模式，即在申购时支付申购费用。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。因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。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。具体如下：

##### A、前端申购费率：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100 万元以下	1.2%
100 万元（含）□ 500 万元	0.8%
500 万元（含）以上	1000 元/笔

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以外的其他选择前端收费模式申购本基金基金份额的投资者。

##### B、特定申购费率：

申购金额（M）	特定申购费率
M < 100 万元	0.12%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.08%

M ≥ 500 万元	1000 元/笔
------------	----------

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基金的养老金客户，包括基本养老保险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：

- 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。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

## （2）后端收费模式

后端收费模式，即在赎回时才支付相应的申购费用，费率按基金份额的持有时间递减。具体如下：

持有时间	后端申购费率
1 年以内（含）	1.6%
1 年-3 年（含）	1.0%
3 年-5 年（含）	0.5%
5 年以上	0

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

各销售机构适用的收费模式以其业务规定为准。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。

## 2、赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费用的 25%



归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

（1）前端收费模式

投资者赎回以前端收费模式申购的本基金份额时，赎回费率按基金份额的持有时间递减。具体如下：

持有时间	赎回费率
7日以内	1.5%
7日以上（含）	0.5%

（2）后端收费模式

投资者赎回以后端收费模式申购的本基金份额时，赎回费率按基金份额的持有时间递减。具体如下：

持有时间	赎回费率
7日以内	1.5%
7日以上(含)-2年以内(含)	0.6%
2年-3年（含）	0.3%
3年以上	0

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

4、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。

**七、 申购和赎回的数额和价格**

1、申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（2）赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后2

位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 2、申购份额的计算

### （1）前端收费模式：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

例一：某投资人投资 4 万元申购本基金，申购费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 40,000 / (1 + 1.2\%) = 39,525.69 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 40,000 - 39,525.69 = 474.31 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (40,000 - 474.31) / 1.040 = 38,005.47 \text{ 份}$$

### （2）后端收费模式：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

基金份额的后端申购费在投资者申购基金份额时不收取，在投资者赎回或转换该部分基金份额时收取。

## 3、赎回金额的计算

### （1）前端收费模式

采用□份额赎回□方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例二：某投资人赎回 1 万份基金份额，持有期限不少于 7 日，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.016 \times 0.5\% = 50.8 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.016 - 50.8 = 10,109.2 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，持有期限不少于 7 日，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.2 元。

## （2）后端收费模式

投资者赎回以后端收费模式申购的基金份额时，收取后端赎回费和后端申购费。后端赎回费率及后端申购费率按照本招募说明书规定的费率标准执行。赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

后端赎回费用=赎回总金额×后端赎回费率

后端申购费用=赎回份额×申购（或转换入）当日基金份额净值×后端申购费率

赎回金额=赎回总金额-后端赎回费用-后端申购费用

## 4、本基金基金份额净值的计算：

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 八、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

出现如下情形时，基金管理人可以暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （4）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- （5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- （6）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时；
- （7）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；

（8）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将相应退还投资者。发生上述（1）到（4）项、（7）到（8）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。

发生上述第（5）、（6）项暂停申购情形之一的，为保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人有权采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，也可以采取上述措施对基金规模予以控制。

### 九、 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

（2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

（4）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

（5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

（6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应

的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在指定媒介公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 10%的赎回申请（□大额赎回申请人□）情形下，基金管理人可以对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（□小额赎回申请人□）利

益的原则，基金管理人可以优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在指定媒介上进行公告。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒介刊登公告。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

### 十一、重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

### 十二、基金转换

为满足广大投资者的理财需求，本公司开通富国沪深 300 增强证券投资基金

（代码：前端为 100038，后端为 000154）与本公司旗下其他开放式基金的基金转换业务。

#### 1、适用范围

本基金转换业务适用于本基金与本公司已发行和管理的开放式证券投资基金，具体以基金管理人发布的相关公告为准。

#### 2、业务规则

（1）基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额；

（2）基金转换只能在同一销售机构进行，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售；

（3）基金转换只能转换为同一基金账户下的基金份额；

（4）基金转换只能在同一收费模式的基金份额之间进行，即前端收费模式的基金只能与前端收费模式的基金转换，后端收费模式的基金只能与后端收费模式的基金转换；前端收费模式的基金份额和后端收费模式的基金份额之间不能相互转换；在公司直销系统中，两种收费模式的基金份额均可以与富国天时货币基金 A/B 进行基金转换；

（5）不同注册登记机构登记的基金之间不能相互转换；

（6）基金转换采用“份额转换、未知价”原则，转出、转入均以 T 日的基金份额净值为基础计算转出金额与转入份额；

（7）投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态；

（8）基金转换过程中，对于前端转前端的情况，按照需转出份额对应的转出基金赎回费率计算赎回费用，按照需转入金额对应的转出与转入基金的申购费率计算并确定申购补差费用；对于后端转后端的情况，按照需转出基金份额持有时间对应的转出基金赎回费率计算赎回费，按照需转出基金份额持有时间对应的转出与转入基金后端申购费率计算后端申购补差费，转入基金后端申购费在该部分基金赎回时收取；

（9）本公司旗下的基金转换后，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算；

（10）当日的基金转换申请可以在基金管理人规定的时间内撤销；

（11）注册登记机构以收到有效转换申请的当天作为转换申请日（T 日）。投资者转换基金成功的，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理权益转换的注册登记手续，投资者通常可自 T+2 日（含该日）起向业务办理网点查询转换业务的确认情况，并有权转换或赎回该部分基金份额；

（12）基金份额持有人在向销售机构申请基金转换时，每次转换申请不得低于 10 份基金份额。若某笔转换导致基金份额持有人在销售机构托管的单只基金余额不足 10 份基金份额时，剩余基金份额仍保留在基金持有人的基金账户内；

（13）基金净赎回申请份额（该基金赎回申请总份额加上基金转换中转出申请总份额后扣除申购申请总份额及基金转换中转入申请总份额后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延；

（14）投资者在全部转出富国天时余额时，将自动结转当前累计收益；投资者部分转出富国天时份额时，剩余的基金份额需足以弥补其当前累计收益为负值时的损失；

（15）转换费用计算采用单笔计算法。投资者在 T 日多次转换的，单笔计算转换费用，不按照转换的总份额计算其转换费用；

（16）对于养老金客户基金转换，如在实施特定申购费率的基金间转换，则按特定申购费率之间的价差进行补差，如转换的两只基金中至少有一支为非实施特定申购费率的基金，则按照原申购费率之间的价差进行补差；

（17）基金管理人在不损害基金份额持有人合法权益的情况下可更改上述原则，基金管理人最迟于新规则开始实施日前 3 个工作日在指定媒介上公告。

### 3、基金转换费及转换份额的计算

#### 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。

#### 4、转换业务办理时间

投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

由于各销售机构的系统差异以及业务安排等原因，开展该业务的时间可能有所不同，投资者应以各销售机构公告的时间为准。

#### 5、暂停基金转换的情形及处理

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此暂停基金转换适用有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、暂停赎回和巨额赎回的有关规定。

#### 6、重要提示

（1）目前，可以进行本业务的销售机构包括本公司的直销网点以及同时代销富国沪深 300 指数增强和拟转换基金的机构，具体开通转换的机构可向本公司客户服务中心咨询。

（2）由于各代销机构系统及业务安排等原因，可能开展该业务的时间有所不同，投资者可以向本公司客户服务中心咨询。

（3）投资者可通过本公司直销系统办理后端收费模式的基金转换业务，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收费模式基金转换业务的情况，具体以实际网上交易页面相关说明为准。

（4）投资者欲了解本基金管理人旗下基金的详细情况，请仔细阅读本基金管理人旗下基金的招募说明书(或更新招募说明书)、基金合同等相关法律文件；亦可登陆本基金管理人网站（[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)）或拨打本基金管理人客服电话（95105686、400-888-0688（全国统一，免长途话费））查询。

（5）上述业务的解释权归本基金管理人。

### 十三、 基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的可持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

### 十四、 基金的转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

### 十五、 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

### 十六、 基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配。

## 第九部分 基金的投资

### 一、 投资目标

本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

### 二、 投资范围

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、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票及存托凭证资产的 80%；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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

### 三、 投资理念

指数化投资分享中国经济长期增长之成果，增强型策略提高指数化投资之效率，量化增强方式实现增强型策略之目标。

### 四、 投资策略

本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。

#### 1、 标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代（单

纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在中国证监会指定的媒体上公告。

## 2、指数化投资为主，主动性投资为辅：

本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。

富国研发的定量投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。

### （1）多因子 alpha 模型——股票超额回报预测

富国多因子 alpha 模型以对中国股票市场的长期研究为基础，一定程度上结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)。

这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方面信息。富国多因子 alpha 模型利用富国长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

### （2）风险估测模型——有效控制风险预算

指数化投资力求跟踪误差最小，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

#### （3）交易成本模型——控制成本并保护业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，在控制成本最低的基础上减少交易造成的负业绩影响。

#### （4）投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以成分股为主，并包括非成分股中与成分股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。

### 3、对目标指数的跟踪调整：

#### （1）定期调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数公司原则上每半年审核一次沪深 300 指数成份股。本基金将按照沪深 300 指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

#### （2）不定期调整

根据指数编制规则，当沪深 300 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

调整期间原则上定为：中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。由于受到各项投资禁止行为以及持股比例等限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时也需要寻求替代。

### 4、存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。

## 5、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，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

## 6、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。

## 五、投资决策与交易机制

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等重大投资决策，并对投资组合的跟踪误差和跟踪偏离度做出定期的评估和检讨。

基金经理组在公司权益投资部、固定收益部、另类投资部和研究部的协助与支持下，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，构建和调整投资组合，并通过指数化交易系统下达投资指令。

集中交易部设立交易员，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。集中交易部同时负责各项投资限制的实时监控以及本基金资产与公司其他基金之间的公平交易控制。

## 六、投资程序

1、另类投资部定期检验和更新股票超额收益预测模型，并利用该预测模型，预测下一阶段各成份股的超额收益率；研究部提供成份股和部分重点推荐的非成份股（包括拟发行新股企业与增发企业）基本面的研究报告。

2、基金经理组基于对上述因素的综合分析以及对未来市场走势的研究判断，

拟定投资策略报告。

3、投资策略报告提交投资决策委员会进行审核。

4、基金经理组根据投资决策委员会批准后的投资策略构建指数增强型投资组合，并密切跟踪目标指数；同时结合成份股情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况等对投资组合进行监控和动态调整，以实现跟踪误差和跟踪偏离度的有效控制。

5、集中交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

6、另类投资部等部门根据市场变化，定期和不定期地对基金投资绩效进行评估，并提供相关绩效评估报告。

7、风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制。

8、基金经理须每月提交工作报告及工作计划。

## 七、投资限制

### 1、禁止行为

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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人

发行的股票或债券；

（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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序



后可不受上述规定的限制。

## 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- （2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- （3）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- （4）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （5）本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- （6）基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- （7）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- （8）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；
- （9）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除第（6）、（7）条外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

## 八、 标的指数与业绩比较基准

本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。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股票指数时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会核准，并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

## 九、 风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 十、 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 十一、 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十二、投资组合报告

### （一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,420,238,256.19	92.36
	其中：股票	8,420,238,256.19	92.36
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	675,957,559.09	7.41
7	其他资产	20,132,958.61	0.22
8	合计	9,116,328,773.89	100.00

### （二）报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,553,425.00	0.21
B	采矿业	25,292,784.00	0.28
C	制造业	798,993,012.35	8.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,462,102.00	0.58
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	69,539,252.61	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	53,231,241.32	0.59
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,999,104.40	0.22
J	金融业	33,372,863.11	0.37

K	房地产业	36,982,188.00	0.41
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	9,031,640.98	0.10
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	25,364,262.00	0.28
S	综合	—	—
	合计	1,142,821,875.77	12.67

（三）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	275,355,897.91	3.05
B	采矿业	208,188,691.71	2.31
C	制造业	2,908,072,664.20	32.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,924,367.00	1.48
E	建筑业	195,720,860.17	2.17
F	批发和零售业	150,840,379.53	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	109,915,501.38	1.22
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	289,848,861.58	3.21
J	金融业	2,574,657,873.69	28.54
K	房地产业	245,012,558.91	2.72
L	租赁和商务服务业	17,458,672.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	15,406,917.89	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	12,526,800.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	54,712,666.80	0.61
Q	卫生和社会工作	61,533,667.65	0.68
R	文化、体育和娱乐业	24,240,000.00	0.27
S	综合	—	—
	合计	7,277,416,380.42	80.67

**（四）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明**

**细**

**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	601318	中国平安	6,036,628.00	417,553,558.76	4.63
2	000333	美的集团	5,562,705.00	269,346,176.10	2.99
3	600036	招商银行	8,170,195.00	263,733,894.60	2.92
4	600519	贵州茅台	231,579.00	257,284,269.00	2.85
5	600276	恒瑞医药	2,765,097.00	254,471,876.91	2.82
6	601166	兴业银行	14,316,992.00	227,783,342.72	2.52
7	603288	海天味业	1,379,688.00	172,695,546.96	1.91
8	601688	华泰证券	9,642,400.00	166,138,552.00	1.84
9	601211	国泰君安	10,054,702.00	163,690,548.56	1.81
10	600999	招商证券	8,757,785.00	149,933,279.20	1.66

**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**

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	000672	上峰水泥	5,590,165.00	109,679,037.30	1.22
2	600720	祁连山	5,809,520.00	75,756,140.80	0.84

			0		
3	600745	闻泰科技	543,251.00	55,139,976.50	0.61
4	601872	招商轮船	7,533,100.00	48,136,509.00	0.53
5	000807	云铝股份	11,903,200.00	46,065,384.00	0.51

**（五） 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**（六） 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**（七） 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

**（十） 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**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**

在法律规许可时，本基金于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关 在法律规许可时，本基金于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关 在法律规许可时，本基金于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关 金融衍生工具对基投资

组合进行管理，以控制并降低风险、提高金融衍生工具对基投资组合进行管理，以控制并降低风险、提高金融衍生工具对基投资组合进行管理，以控制并降低风险、提高效率，降低跟踪误差从而更好地实现本基金的投资目标。

### （十一）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。

### （十二）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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“华泰证券”的发行主体华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）未按规定履行客户身份识别义务；（2）未按规定报送可疑交易报告；（3）与身份不明的客户进行交易等违法事实，中国人民银行于2020年2月10日对公司做出罚款1010万元的行政处罚（银罚字【2020】23号）。华泰证券为本基金跟踪标的指数的成份股。

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。

#### 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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,412,400.87
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	155,588.27
5	应收申购款	18,564,969.47
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,132,958.61

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

（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未持有流通受限股票。

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。



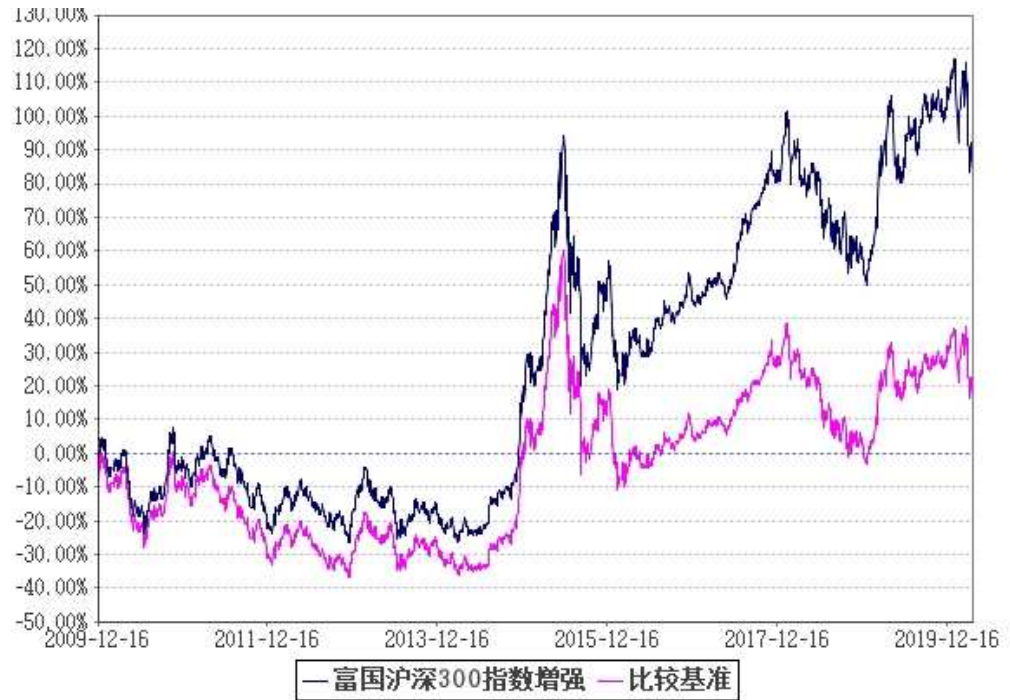
## 第十部分 基金的业绩

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

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

阶段	净值增长率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
2009.12.16-2009.12.31	4.50%	0.78%	-0.13%	1.71%	4.63%	-0.93%
2010.01.01-2010.12.31	-9.00%	1.54%	-10.47%	1.50%	1.47%	0.04%
2011.01.01-2011.12.31	-17.67%	1.25%	-22.70%	1.23%	5.03%	0.02%
2012.01.01-2012.12.31	12.64%	1.24%	8.89%	1.22%	3.75%	0.02%
2013.01.01-2013.12.31	-8.50%	1.30%	-5.77%	1.32%	-2.73%	-0.02%
2014.01.01-2014.12.31	55.39%	1.15%	50.90%	1.15%	4.49%	0.00%
2015.01.01-2015.12.31	20.89%	2.29%	7.28%	2.36%	13.61%	-0.07%
2016.01.01-2016.12.31	-5.01%	1.33%	-9.29%	1.33%	4.28%	0.00%
2017.01.01-2017.12.31	27.08%	0.61%	22.43%	0.61%	4.65%	0.00%
2018.01.01-2018.12.31	-16.84%	1.28%	-22.98%	1.27%	6.14%	0.01%
2019.01.01-2019.12.31	38.83%	1.17%	36.14%	1.18%	2.69%	-0.01%
2020.01.01-2020.03.31	-9.47%	1.84%	-9.15%	1.85%	-0.32%	-0.01%
2009.12.16-2020.03.31	91.26%	1.38%	21.45%	1.39%	69.81%	-0.01%

### 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2020年3月31日。

2、本基金于2009年12月16日成立，建仓期6个月，从2009年12月16日起至2010年6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。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，

归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有财产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、 估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 二、 估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 三、 估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### 四、 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、 估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、 证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、当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。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 六、 基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向责任方追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### 1、 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任方应当对由于该差错遭受损失的当事人（受损方）按下述差错处理原则给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、 差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（□受损方□），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确



定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

#### **七、 暂停估值的情形**

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

#### **八、 特殊情形的处理**

1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、 基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；
- 3、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 5、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### 五、 收益分配的时间和程序

- 1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，依照《信

息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### **六、 基金收益分配中发生的费用**

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的单位基金资产净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照基金管理人的《业务规则》的有关规定执行。

## 第十四部分 基金费用与税收

### 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、与基金使用相关指数有关的费用；
- 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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

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

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.18%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

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

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

### 3、基金指数使用费用

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

$$H=E \times 0.016\% / \text{当年天数} \quad (\text{H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值})$$

如果基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用基点费的下限，则该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用从基金财产中列支。

上述一、基金费用的种类中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项

目。

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”相应部分。

### 2、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”相应部分。

### 3、转换费用

基金转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”相应部分。

## 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、基金费用的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、 本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。



## 五、 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

1、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

2、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和基金管理人网站上。

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定报刊和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资

产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （十）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（十一）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

（十二）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要，在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

## 八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 风险揭示

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

### 一、投资于富国沪深 300 增强证券投资基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。因此基金投资收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### （5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

3、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

4、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率

#### 5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在本基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在本基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 9、基金估值风险

指每日基金估值可能发生错误的风险。

#### 10、本基金的特定风险

##### （1）目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标指数并不能完全代表整个股票市场。目标指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### （2）目标指数波动的风险

目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

##### （3）基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：

[1] 由于目标指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

[2] 由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

[3] 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差。

[4] 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪误差。

[5] 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差。

[6] 由于本基金为指数增强型基金，采用复制目标指数基础上的有限度个股调整策略，因此对指数跟踪进行修正与适度增强可能会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。

[7] 其他因素产生的跟踪误差。如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动。

##### （4）目标指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更目标指数的情形，本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，



基金的收益风险特征将与新的目标指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （5）基金投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不限于以下风险：

##### 1）与存托凭证相关的风险

①存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。

②本基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，本基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

③本基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；本基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

④存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对本基金生效。本基金可能无法对此行使表决权。

⑤存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，本基金可能存在失去应有权利的风险。

⑥存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

⑦存托凭证退市的，本基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，本基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为本基金提供相应服务等风险。

##### 2）与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高

于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格。

### 3) 与境外发行人相关的风险

①红筹公司在境外注册设立，其股权结构、公司治理、运行规范等事项适用境外注册地公司法等法律法规的规定；已经在境外上市的，还需要遵守境外上市地相关规则。投资者权利及其行使可能与境内市场存在一定差异。此外，境内股东和境内存托凭证持有人享有的权益还可能受境外法律变化影响。

②红筹公司可能仅在境内市场发行并上市较小规模的股票或者存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有，境内投资者可能无法实际参与公司重大事务的决策。

③红筹公司存托凭证的境内投资者可以依据境内《证券法》提起证券诉讼，但境内投资者无法直接作为红筹公司境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

### 4) 与交易机制相关的风险

①境内外市场证券停复牌制度存在差异，红筹公司境内外上市的股票或者存托凭证可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

②红筹公司在境外上市股票或存托凭证的价格可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，可能对境内证券价格产生影响。

③在境内法律及监管政策允许的情况下，红筹公司现在及将来境外发行的股票可能转移至境内市场上市交易，或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的股票或者存托凭证流通数量，可能引起交易价格波动。

④本基金持有的红筹公司境内发行的证券，暂不允许转换为公司在境外发行的相同类别的股票或者存托凭证；本基金持有境内发行的存托凭证，暂不允许转换为境外基础证券。

## 11、投资科创板的特别风险

本基金可根据投资目标、投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金并非必然投

投资于科创板股票。

基金投资科创板上市交易股票将承担科创板因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有风险，具体包括以下风险：

（1）公司治理风险。科创板股票发行实行注册制，上市条件与主板不同，科创板上市公司的股权激励制度更为灵活，可能存在表决权差异安排。

（2）流动性风险。由于参与科创板投资有一定的门槛要求，科创板的投资者可能以机构投资者为主。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性，将会造成市场的流动性风险。

（3）集中投资风险。科创板将集中以成长性的科技创新企业为主。由于投入规模大、技术迭代快、盈利周期长等行业特点，科创板企业的收入及盈利水平具有较大不确定性，可能存在公开发发行时和上市后仍无法盈利的情形。

（4）退市风险。科创板退市的标准、程序和执行较主板更为严格：

1）退市情形更多。当上市公司出现新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷的情形，将直接导致退市；

2）退市时间更短。因科创板取消了暂停上市和恢复上市程序，因此存在对应当退市的企业直接终止上市的情形；

3）执行标准更严。当上市公司明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入时，可能会直接导致退市。

（5）股价波动风险。科创板竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%。

（6）集中度风险。科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

（7）系统性风险。科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

（8）政策风险。国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板企业也会带来政策影响。

## 12、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

## 二、 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金销售机构销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- (1) 更换基金管理人；
- (2) 更换基金托管人；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- (9) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，基金管理人应在中国证监会核准后依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

## 二、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

## 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1) 遵守《基金合同》；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- 3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

- 4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- 5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- 6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1) 依法募集基金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会、银行监管部门和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- 11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12) 在符合有关法律规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- 13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；



- 14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
  - 15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
  - 16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
  - 17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- (2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- 1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会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，如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
  - 2) 办理基金备案手续；
  - 3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
  - 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
  - 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
  - 6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
  - 7) 依法接受基金托管人的监督；
  - 8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
  - 9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
  - 10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
  - 11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报

告义务；

12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13) 按《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基金收益；

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

22) 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实施其他法律行为；

23) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生

效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

24) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

25) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

- 3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- 17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和

银行监管机构，并通知基金管理人；

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

1) 终止《基金合同》；

2) 更换基金管理人；

3) 更换基金托管人；

4) 转换基金运作方式；

5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

6) 变更基金类别；

7) 本基金与其他基金的合并；

8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

9) 变更基金份额持有人大会程序；

10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持

有人大会的事项。

（2）以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- 6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

（1）除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

（2）基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决

定之日起 60 日内召开。

（5）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

（2）采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见提交的截止时间和收取方式。

（3）如召集人为基金管理人，还应另行通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的书面方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1）会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在表决截止日前公布 2 次相关提示性公告；

2）召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3）本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4）上述第 3）项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交或经验证的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人



出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上了解释和说明。

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人

大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## （2）议事程序

### 1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### 2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### （1）现场开会

1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会

的，不影响计票的效力。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### 1、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （3）《基金合同》约定的其他情形；
- （4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 2、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进

行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（4）基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
  - 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
  - 3) 对基金财产进行估值和变现；
  - 4) 制作清算报告；
  - 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
  - 7) 对基金财产进行分配；
- （5）基金财产清算的期限为6个月。

#### 四、 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：富国基金基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

法定代表人：裴长江

成立时间：1999 年 4 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]11 号

注册资本：5.2 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

存续期间：持续经营

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：赵瑛

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职

能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

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、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例

为：

股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票及存托凭证资产的 80%；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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

沪深 300 指数的成份股和备选成份股（均含存托凭证）由基金管理人负责提供，并进行定期更新，以确保其真实、有效性。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

c、本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

d、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

e、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

f、基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

g、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；



h、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

i、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

3) 法规允许的基金投资比例调整期限

除第 f、g 条外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

5) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

6) 对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

(3)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

1) 承销证券；

2) 向他人贷款或提供担保；

3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；

4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

- 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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与上述关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(5) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交

易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

#### 2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的，基金托管人不承担责任。

3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司和交通银行股份有限公司，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

#### (6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司和交通银行股份有限公司，本基金投资除核心存款银行

以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

#### （7）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2）流通受限证券与上文提及的流动性受限资产的定义不一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占基金资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人已切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反相关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内

答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法律法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、 基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

## 四、基金财产保管

### 1、基金财产保管的原则

- (1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- (2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- (3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- (4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- (5) 对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

### 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的富国基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设

和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方书面同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

#### 5、债券托管账户的开立和管理

(1)《基金合同》生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本基金进行交易；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责本基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金管理人、基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管



基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表本基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表本基金签署与本基金有关的重大合同时，应保证本基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### 1、基金资产净值的计算

##### （1）基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值，并以电子或加密传真的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核无误后，将经电子签名确认后或书面盖章确认后的净值计算结果传送给基金管理人，由基金管理人将基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，

就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

## 2、基金资产估值方法

### （1）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产及负债。

### （2）估值方法

本基金的估值方法为：

#### 1）证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

②交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

①送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同

一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

②首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6) 本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

7) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8) 当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。

9) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 3、估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率与托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

#### 4、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### 5、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；

在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 六、 基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照国家目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：

《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、 争议的解决方式

双方同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、 托管协议的变更与终止

### 1、 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### 2、 基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基

金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金  
管理权；

（4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、 基金份额持有人交易资料服务

投资者在交易申请被受理的 2 个工作日后，可通过销售网点查询和打印交易确认单。基金管理人将根据持有人账单订制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司基金份额的基金份额持有人定期或不定期发送对账单。具体业务规则详见基金管理人网站公告或相关说明。

### 二、 网上交易、查询服务

投资者除可通过基金管理人的直销网点和代销机构的代销网点办理申购、赎回等交易以及账户查询外，还可通过基金管理人的网站（www.fullgoal.com.cn）、微信公众号（搜索“富国基金微管家”或“FullgoalWeFund”）或客户端“富国富钱包”APP 享受网上交易、查询服务。具体业务规则详见基金管理人网站公告或相关说明。

### 三、 信息定制及资讯服务

投资者可通过拨打客服热线、在线客服、发送邮件、短信或登陆基金管理人网站等多种渠道，定制对账单、基金交易确认信息、周刊等各类资讯服务。当投资者接收定制服务的手机号码、电子邮箱、邮寄地址等信息不详、填写有误或发生变更时，可通过以上渠道更新修改，以避免无法及时接收相关定制服务。

### 四、 网络在线服务

投资者可通过基金管理人网站、微信公众号或客户端获得投资咨询、业务咨询、信息查询、信息定制、服务投诉及建议等多项在线服务。

### 五、 客户服务中心电话服务

客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工坐席提供每周 5 天、每天不少于 8 小时的座席服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等



专项服务，节假日除外。

#### **六、 客户投诉受理服务**

投资者可以通过各销售机构网点柜台、基金公司网站投诉栏目、客户服务中心人工热线、在线客服、微客服、书信、电子邮件、短信、传真等多渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务以及公司的政策规定提出投诉或意见。

#### **七、 基金管理人客户服务联络方式**

客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费），工作时间内可转人工坐席。

客户服务传真：021-20513277

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

电子信箱：[public@fullgoal.com.cn](mailto:public@fullgoal.com.cn)

客服中心地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

**八、 如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务中心热线，或通过电子邮件、传真、信件等方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。**

## 第二十二部分 其他应披露事项

序号	公告事项	信息披露方式	公告日期
1	富国基金管理有限公司关于不法分子冒用我司名义的澄清公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2019年6月19日
2	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2019年6月21日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中科曙光”股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019年6月26日
4	富国基金管理有限公司旗下基金2019年6月30日基金资产净值和基金份额净值公告	公司官网	2019年7月1日
5	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2019年8月1日
6	关于富国沪深300增强证券投资基金暂停大额申购、定投及转换转入业务的公告	中国证券报	2019年9月16日
7	富国沪深300增强证券投资基金2019年第一次收益分配公告	中国证券报	2019年9月16日
8	富国基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2019年9月24日
9	关于防范不法分子冒用富国基金名义进行非法活动的重要提示	公司官网	2019年12月13日
10	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2020年1月11日
11	富国基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下公募基金基金合同的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2020年1月20日
12	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金	中国证券报、证券时报、	2020年2月3日

	2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	上海证券报、证券日报	
13	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报	2020 年 3 月 17 日

## 第二十三部分 招募说明书存放及其查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- 一、 中国证监会核准富国沪深 300 增强证券投资基金募集的文件
- 二、 《富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同》
- 三、 《富国沪深 300 增强证券投资基金托管协议》
- 四、 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 五、 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 六、 关于申请募集富国沪深 300 增强证券投资基金之法律意见书
- 七、 基金销售代理人业务资格批件和营业执照
- 八、 《富国基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 九、 中国证监会要求的其他文件

富国基金管理有限公司

2020 年 12 月 30 日