# 富国短债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(二〇二〇年第二号)

重要提示

富国短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)已于 2018 年 12 月 6 日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2018】2035 号)。本基金的基金合同于 2019 年 1 月 18 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景等做出实质性判断或者保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金为债券型基金,在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券、期货投资具有一定的风险,因此既不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

本招募说明书所载内容截止至 2020 年 7 月 22 日,基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2020 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。

## 第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:富国基金管理有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 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 07 月 22 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。

公司目前下设二十九个部门、三个分公司和二个子公司,分别是:权益投资部、固定收益投资部、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、固定收益交易部、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:负责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;固定收益交易部:在公司投委会、分管领导授权范围内,负责审核并执行各固定收益投资组合指令,实现对投资交易一线风险控制的前提下,高效、公平地完成投资指令,并结合执行情况完成交易反馈;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:负责除固定收益之外的各类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 6 月 30 日,公司有员工 507 人,其中 71%具有硕士以上学位。

二、主要人员情况

(一)董事会成员

裴长江先生,董事长,研究生学历。现任海通证券股份有限公司副总经理。历任上海万国证券公司研究部研究员、闸北营业部总经理助理、总经理,申银万国证券公司闸北营业部总经理、浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理,华宝信托投资有限责任公司投资总监,华宝兴业基金管理有限公司董事兼总经理。

陈戈先生,董事,总经理,研究生学历。历任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员,富国基金管理有限公司研究员、基金经理、研究部总经理、总经理助理、副总经理,2005 年 4 月至 2014 年 4 月任富国天益价值证券投资基金基金经理。

麦陈婉芬女士(Constance Mak),董事,文学及商学学士,加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团亚洲业务总经理(General Manager, Asia, International, BMO Financial Group),中加贸易理事会董事和加拿大中文电视台顾问团的成员。历任 St. Margaret's College 教师,加拿大毕马威(KPMG)会计事务所的合伙人。

方荣义先生,董事,博士,研究生学历,高级会计师。现任申万宏源证券有限公司副总经理、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,中国人民银行深圳经济特区分行(深圳市中心支行)会计处副处长,中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构处处长,中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长,申银万国证券股份有限公司财务总监。

张信军先生,董事,研究生学历。现任海通证券股份有限公司财务总监、海通国际控股有限公司副总经理兼财务总监、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。

Edgar Normund Legzdins 先生,董事,本科学历,加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团国际业务全球总裁(SVP&Managing Director, International, BMO Financial Group)。1980 年至 1984 年在 Coopers&Lybrand 担任审计工作;1984 年加入加拿大 BMO 银行金融集团蒙特利尔银行。

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

何宗豪先生,董事,硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务管理总部总经理。历任人民银行上海市徐汇区办事处计划信贷科、组织科科员;工商银行徐汇区办事处建国西路分理处党支部代书记、党支部书记兼分理处副主任(主持工作);上海申银证券公司财会部员工;上海申银证券公司浦东公司财会部筹备负责人;上海申银证券公司浦东公司财会部副经理、经理;申银万国证券股份有限公司浦东分公司财会部经理、申银万国证券股份有限公司财会管理总部部门经理、总经理助理、申银万国证券股份有限公司计划财会管理总部副总经理、总经理。

黄平先生,独立董事,研究生学历。现任上海盛源实业(集团)有限公司董事局主席。历任上海市劳改局政治处主任;上海华夏立向实业有限公司副总经理;上海盛源实业(集团)有限公司总经理、总裁。

季文冠先生,独立董事,研究生学历。现任上海金融业联合会常务副理事长。历任上海仪器仪表研究所计划科副科长、办公室副主任、办公室主任、副所长;上海市浦东新区综合规划土地局办公室副主任、办公室主任、局长助理、副局长、党组副书记;上海市浦东新区政府办公室主任、外事办公室主任、区政府党组成员;上海市松江区区委常委、副区长;上海市金融服务办公室副主任、中共上海市金融工作委员会书记;上海市政协常委、上海市政协民族和宗教委员会主任。

伍时焯(Cary S. Ng)先生,独立董事,研究生学历,加拿大特许会计师。现已退休。1976 年加入加拿大毕马威会计事务所的前身 Thorne Riddell 公司担任审计工作,有 30 余年财务管理及信息系统项目管理经验,曾任职在 Neo Materials Technologies Inc. 前身 AMR Technologies Inc.、MLJ Global Business Developments Inc.、UniLink Tele.com Inc. 等国际性公司为首席财务总监(CFO)及财务副总裁,圣力嘉学院(Seneca College)工商系会计及财务金融科教授。

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

(二)监事会成员

付吉广先生,监事长,研究生学历。现任山东省国际信托股份有限公司风控总监。历任济宁信托投资公司投资部科员,济宁市留庄港运输总公司董事、副总经理,山东省国际信托投资有限公司投行业务部业务经理、副经理;山东省国际信托投资有限公司稽核法律部经理,山东省中鲁远洋渔业股份有限公司财务总监,山东省国际信托有限公司信托业务四部经理。

沈寅先生,监事,本科学历。现任申万宏源证券有限公司法律合规总部副总经理,风险管理办公室副主任,公司律师。历任上海市高级人民法院助理研究员,上海市中级人民法院、上海市第二中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长,办公室综合科科长,以及上海仲裁委员会仲裁员。

张晓燕女士,监事,博士。现任蒙特利尔银行亚洲区和蒙特利尔银行(中国)有限公司首席风险官。历任美国加州理工学院化学系研究员,加拿大多伦多大学化学系助理教授,蒙特利尔银行市场风险管理部模型发展和风险审查高级经理,蒙特利尔银行操作风险资本管理总监,道明证券交易风险管理部副总裁兼总监,华侨银行集团市场风险控制主管,新加坡交易所高级副总裁和风险管理部主管。

侍旭先生,监事,研究生学历。现任海通证券股份有限公司稽核部总经理,职工监事,海通开元投资有限公司董事、海通新创投资管理有限公司监事。历任海通证券股份有限公司稽核部二级部副经理、二级部经理、稽核部总经理助理、副总经理,辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司董事等。

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

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

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

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

(三)督察长

赵瑛女士,研究生学历,硕士学位。曾任职于海通证券有限公司国际业务部、上海国盛(集团)有限公司资产管理部/风险管理部、海通证券股份有限公司合规与风险管理总部、上海海通证券资产管理有限公司合规与风控部;2015 年 7 月加入富国基金管理有限公司,历任监察稽核部总经理,现任富国基金管理有限公司督察长。

(四)经营管理层人员

陈戈先生,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

林志松先生,本科学历,工商管理硕士学位。曾任漳州进出口商品检验局秘书、晋江进出口商品检验局办事处负责人、厦门证券公司业务经理;1998 年 10 月参与富国基金管理有限公司筹备,历任富国基金管理有限公司监察稽核部稽察员、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

张波,硕士,2012 年 7 月至 2013 年 9 月任上海耀之资产管理中心(有限合伙)交易员;2013 年 9 月至 2017 年 10 月历任鑫元基金管理有限公司交易员、交易副总监(主持工作);2017 年 10 月加入富国基金管理有限公司,2018 年 1 月起任富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理,2018 年 6 月起任富国富钱包货币市场基金基金经理,2018 年 8 月起任富国安益货币市场基金基金经理,2019 年 1 月起任富国短债债券型证券投资基金基金经理,2019 年 5 月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理,2019 年 12 月起任富国汇远纯债三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

(六)投资决策委员会成员

公司投委会成员:总经理陈戈,分管副总经理朱少醒,分管副总经理李笑薇

(七)其他

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间:1984 年 1 月 1 日

法定代表人:陈四清

注册资本:人民币 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。

## 第三部分 相关服务机构

一、基金销售机构

(一)直销机构

名称:富国基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 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)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼
法人代表:刘连舸
联系人员:陈洪源
客服电话:95566
公司网站:www.boc.cn

(3)中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

(4)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

(5)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

(6)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

(7)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:黄炎勋
联系人员:周杨
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn

(8)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

(9)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

(10)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

(11)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

(12)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

(13)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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)中信证券华南股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
办公地址:广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法人代表:胡伏云
联系人员:陈靖
客服电话:95396
公司网站:www.gzs.com.cn

(21)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路 1138 号
办公地址:长春市自由大路 1138 号
法人代表:杨树财
联系人员:安岩岩
客服电话:95360
公司网站:www.nesc.cn

(22)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

(23)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

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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

(29)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层
法人代表:陈林
联系人员:刘闻川
客服电话:4008-209-898
公司网站:www.cnhbstock.com

(30)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

(31)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

(32)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

(33)北京度小满基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室
办公地址:北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼
法人代表:葛新
联系人员:孙博超
客服电话:95055-4
公司网站:www.baiyingfund.com

(34)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

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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:北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层
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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

(44)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/

(45)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:马永谙
联系人员:卢亚博
客服电话:400-080-8208
公司网站:www.licaimofang.cn

(46)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

注册地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人:俞卫锋

经办律师:黎明、陈颖华

联系人:陈颖华

电话:(021)31358666

传真:(021)31358666

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、石静筠

## 第四部分 基金名称

富国短债债券型证券投资基金

## 第五部分 基金类型

债券型

## 第六部分 投资目标

本基金重点投资短期债券,在严格控制风险和保持较高流动性的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

## 第七部分 基金投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

本基金不投资于股票、权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%,投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过 397 天(含)的债券资产,主要包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。本基金管理人将基于审慎原则,根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法,并与基金托管人协商一致,计算其剩余期限。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

## 第八部分 基金投资策略

本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念,采用价值分析方法,在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上,自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置;同时,采用“自下而上”的投资理念,在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上,自下而上的精选个券,把握固定收益类金融工具投资机会。

1、资产配置策略

本基金在基金合同约定的范围内实施稳健的资产配置,通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征和变化情况,进而在最大限度地降低投资组合的风险前提下,提高投资组合的收益。

2、债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。

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

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

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

(4)跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性,构建和调整债券组合,提高投资收益,实现跨市场套利。

(5)相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的债券,减持相对高估、价格将下降的债券。

3、资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产,通过一定的结构化安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。

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

收益率曲线策略是指根据资产证券化产品的收益率曲线形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理安排不同期限品种的配置比例。通过合理期限安排,在不同期限的资产证券化产品间进行动态调整,在保持组合一定流动性的同时,可以从不同期限的资产证券化产品价格变化中获利。

信用利差曲线策略是指通过分析经济周期及相关市场的变化,判断资产证券化产品的信用利差曲线变化,同时结合市场容量、市场形势预期、流动性风险等因素对信用利差曲线的影响,综合确定资产证券化产品总的投资比例及分行业投资比例。

4、国债期货投资策略

本基金对国债期货的投资根据风险管理原则,以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

5、动态收益增强策略

在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,采取多种灵活的策略,获取超额收益。主要包括骑乘收益率曲线策略、息差策略等。

(1)骑乘收益率曲线策略

骑乘收益率曲线策略是指当收益率曲线相对陡峭时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着债券期限剩余期限缩短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下滑,获得资本利得收益。

(2)息差策略

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作,只要回购资金成本低于债券收益率,就可以达到杠杆放大的套利目标。

本基金将根据对市场回购利率走势的判断,适当地选择杠杆比率,谨慎地实施息差策略,提高投资组合的收益水平。

## 第九部分 基金业绩比较基准

中债综合财富(1 年以下)指数收益率 *80%+银行一年期定期存款利率(税后)*20%。

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金以短期债券为主要投资对象。中债综合财富(1 年以下)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者相关数据编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称,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时,本基金管理人经与基金托管人协商一致,在报中国证监会备案后,可以变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

## 第十一部分 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 | — | — |
|  | 其中:股票 | — | — |
| 2 | 固定收益投资 | 746,497,000.00 | 98.21 |
|  | 其中:债券 | 746,497,000.00 | 98.21 |
|  | 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 | 2,837,119.80 | 0.37 |
| 7 | 其他资产 | 10,805,472.23 | 1.42 |
| 8 | 合计 | 760,139,592.03 | 100.00 |

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内股票资产。

三、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票资产。

四、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 70,020,000.00 | 12.17 |
|  | 其中:政策性金融债 | 59,916,000.00 | 10.41 |
| 4 | 企业债券 | 78,916,000.00 | 13.71 |
| 5 | 企业短期融资券 | 466,389,000.00 | 81.03 |
| 6 | 中期票据 | 131,172,000.00 | 22.79 |
| 7 | 可转债(可交换债) | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 746,497,000.00 | 129.70 |

五、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 012000336 | 20 国药控股 SCP003 | 300,000.00 | 30,054,000.00 | 5.22 |
| 2 | 200201 | 20 国开 01 | 300,000.00 | 30,042,000.00 | 5.22 |
| 3 | 012002148 | 20 北控集 SCP002 | 300,000.00 | 29,838,000.00 | 5.18 |
| 4 | 041900274 | 19 名城建设 CP002 | 200,000.00 | 20,142,000.00 | 3.50 |
| 5 | 041900288 | 19 云南水电 CP001 | 200,000.00 | 20,130,000.00 | 3.50 |

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

七、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

八、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

九、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(一)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

|  |  |
|---|---|
| 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。

(二)本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

十、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(一)本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资根据风险管理原则,以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

(二)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。

(三)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

十一、投资组合报告附注

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

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

(二)申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有股票资产。

(三)其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | — |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 10,793,433.85 |
| 5 | 应收申购款 | 12,038.38 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 10,805,472.23 |

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(五)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

(六)投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 第十二部分 基金的业绩

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

一、本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1)A 级

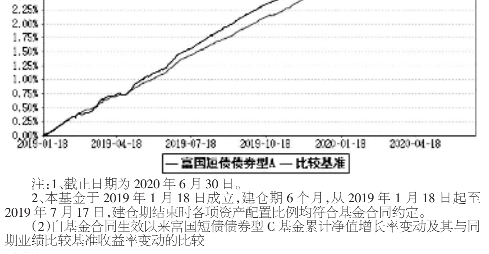
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2019.01.18-2019.12.31 | 2.97% | 0.01% | 2.75% | 0.01% | 0.22% | 0.00% |
| 2020.01.01-2020.06.30 | 1.67% | 0.03% | 1.14% | 0.02% | 0.53% | 0.01% |
| 2019.01.18-2020.06.30 | 4.69% | 0.02% | 3.92% | 0.01% | 0.77% | 0.01% |

(2)C 级

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2019.01.18-2019.12.31 | 2.58% | 0.01% | 2.75% | 0.01% | -0.17% | 0.00% |
| 2020.01.01-2020.06.30 | 1.46% | 0.03% | 1.14% | 0.02% | 0.32% | 0.01% |
| 2019.01.18-2020.06.30 | 4.08% | 0.02% | 3.92% | 0.01% | 0.16% | 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

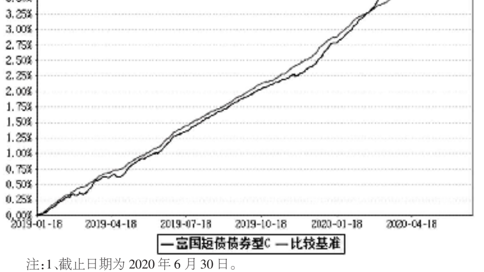
(1)自基金合同生效以来富国短债债券型 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为 2020 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 1 月 18 日成立,建仓期 6 个月,从 2019 年 1 月 18 日起至 2019 年 7 月 17 日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2)自基金合同生效以来富国短债债券型 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为 2020 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 1 月 18 日成立,建仓期 6 个月,从 2019 年 1 月 18 日起至 2019 年 7 月 17 日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 第十三部分 费用概览

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;
4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金相关账户的开户和维护费用;
10、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times0.3\%\div\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.1\%\div\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下,销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times0.4\%\div\text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中划出,经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-10 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、基金合同生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、与基金销售有关的费用

1、申购费率

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

本基金 A 类基金份额在投资者申购时收取申购费。C 类基金份额不收取申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费。各销售机构销售的份额类别以其业务规定为准,敬请投资者留意。

本基金对通过直销中心申购本基金 A 类基金份额的特定客户与普通客户实施差别的申购费率。

特定客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:

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特定客户范围。普通客户指除特定客户外的其他投资者。

| 申购金额 M(含申购费) | 申购费率(通过直销中心申购的特定客户) | 申购费率(普通客户) |
|---|---|---|
| M<100 万元 | 0.04% | 0.40% |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.02% | 0.20% |
| M≥500 万元 | 每笔 1,000 元 |  |

本基金 A 类基金份额基金申购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。C 类基金份额不收取申购费用。

2、赎回费率

(1)赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。投资者认(申)购本基金所对应的赎回费率随持有时间递减。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额适用相同费率,赎回费率见下表:

| 持有期限(N) | 赎回费率 |
|---|---|
| N<7 日 | 1.50% |
| 7 日≤N<30 日 | 0.10% |
| N≥30 日 | 0 |

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

对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费,将全额计入基金财产;对持续持有期不少于 7 日的投资者,将赎回费总额的 25%计入基金财产,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,经与基金托管人协商一致并履行适当程序后,基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低销售费率。

## 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,进行了更新,主要更新内容如下:

1、在“重要提示”中,对招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期进行了更新。

2、在“第三部分 基金管理人”中,对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

3、在“第四部分 基金托管人”中,对基金托管人信息进行了更新。

4、在“第五部分 相关服务机构”中,对销售机构信息进行了更新。

5、在“第九部分 基金的投资”中,对基金投资组合报告内容进行了更新,内容截止至 2020 年 6 月 30 日。

6、在“第十部分 基金的业绩”中,对基金业绩表现数据及走势图进行了更新,内容截止至 2020 年 6 月 30 日。

7、在“第二十二部分 其他应披露事项”中,对本报告期内的其他应披露事项进行了更新。

富国基金管理有限公司

2020 年 08 月 27 日

---

# 华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告

近期,华宝基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额(场内简称:1000B,代码:150264)二级市场交易价格连续大幅波动。2020 年 8 月 25 日,华宝中证 1000B 二级市场收盘价为 1.468 元,相对于当日 1.1307 元的基金份额参考净值,溢价幅度达到 29.83%。截至 2020 年 8 月 26 日,华宝中证 1000B 份额二级市场收盘价为 1.468 元,明显高于基金份额参考净值。投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失。

为了保护基金份额持有人的利益,1000B 将于 2020 年 8 月 27 日开市起至当日 10:30 停牌,自 2020 年 8 月 27 日 10:30 复牌。

为此,本基金管理人提示如下:

1、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》,本基金将在 2020 年底前完成规范整改,投资者如果高溢价买入 1000B,可能遭受重大损失,请理性投资。

2、华宝中证 1000B 份额表现为高风险、高预期收益的特征。由于华宝中证 1000B 份额内含杠杆机制的设计,华宝中证 1000B 基金份额参考净值的变动幅度将大于华宝中证 1000 份额(场内简称:1000 分级,代码:162413)基金份额净值和华宝中证 1000A 份额(场内简称:1000A,代码:150263)基金份额参考净值的变动幅度,即华宝中证 1000B 的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。华宝中证 1000B 份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

3、华宝中证 1000B 份额的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资者面临损失。

4、截至本公告披露日,华宝中证 1000 指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,华宝中证 1000 指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

6、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2020 年 8 月 27 日

---

# 英大基金管理有限公司
# 关于增加民商基金销售(上海)有限公司
# 为代销机构的公告

根据英大基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与民商基金销售(上海)有限公司(以下简称“民商基金”)签署的基金销售代理协议,自 2020 年 8 月 27 日起,增加民商基金为本公司旗下开放式证券投资基金的销售机构。

投资者可通过民商基金办理开户、申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务,同时参与民商基金开展的基金申购费率优惠活动,具体办理规则请遵循销售机构的相关规定。

一、销售机构主要信息

公司名称: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

法定代表人:贲慧琴

客户服务电话:021-50206003

网址:www.msftec.com

二、代理销售基金名称和代码

| 基金名称 | 基金简称 | 基金代码 |
|---|---|---|
| 英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金 | 英大安鑫 66 个月定期开放债券 | 009770 |
| 英大安惠纯债债券型证券投资基金 | 英大安惠纯债 A | 009298 |
|  | 英大安惠纯债 C | 009299 |
| 英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 | 英大睿鑫 A | 003446 |
|  | 英大睿鑫 C | 003447 |
| 英大纯债债券型证券投资基金 | 英大纯债债券 A | 650001 |
|  | 英大纯债债券 C | 650002 |
| 英大通盈纯债债券型证券投资基金 | 英大通盈纯债债券 A | 008242 |
|  | 英大通盈纯债债券 C | 008243 |
| 英大领先回报混合型发起式证券投资基金 | 英大领先回报(前端) | 000458 |
| 英大现金宝货币市场基金 | 英大现金宝 A | 000912 |
|  | 英大现金宝 B | 009744 |
| 英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 | 英大灵活配置 A | 001270 |
|  | 英大灵活配置 B | 001271 |
| 英大策略优选混合型证券投资基金 | 英大策略优选 A | 001607 |
|  | 英大策略优选 C | 001608 |
| 英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 | 英大睿盛 A | 003713 |
|  | 英大睿盛 C | 003714 |
| 英大国企改革主题股票型证券投资基金 | 英大国企改革 | 001678 |

三、定期定额投资业务提示

1、投资者通过民商基金办理基金定期定额投资业务,应遵循民商基金的具体规定。

2、投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是,定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资者获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

四、基金转换业务提示

1、自本公司新增民商基金为旗下基金的代销机构之日起,民商基金开通本公司旗下基金间的基金转换业务。投资者通过销售机构办理基金转换业务,申购补差费率优惠标准、优惠活动期限以销售机构公示信息为准。基金转换费用计算公式以及转换业务规则见基金管理人的相关公告。

2、截至公告日,本公司旗下英大安惠纯债、英大通盈纯债债券、英大纯债债券、英大领先回报(仅限前端收费模式)、英大现金宝、英大灵活配置、英大策略优选、英大睿鑫、英大睿盛、英大国企改革均已开通基金转换业务。

3、截至公告日,英大安惠纯债 A、C 类之间、英大纯债债券 A、C 类之间、英大通盈纯债债券 A、C 类之间、英大现金宝 A、B 类之间、英大灵活配置 A、B 类之间、英大策略优选 A、C 类之间、英大睿鑫 A、C 类之间、英大睿盛 A、C 类之间暂时不支持基金转换业务。

五、费率优惠活动

自本公司新增民商基金为旗下基金的代销机构之日起,投资者可以通过民商基金申购(含定期定额申购、转入)本公告“二、代理销售基金名称和代码”中所列的基金(仅限前端收费模式),均可参加民商基金开展的费率优惠活动,具体折扣费率以民商基金公示为准。各基金原费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限以本公司或民商基金官方网站所示公告为准。费率优惠期限内,如本公司新增通过民商基金代销的基金产品,则该基金产品认购期内及开放申购当日起,将同时开通该基金上述优惠活动。

六、基金管理人主要信息

公司名称:英大基金管理有限公司

客户服务电话:400-890-5288

网址:www.ydamc.com

七、风险提示

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

特此公告。

英大基金管理有限公司

2020 年 8 月 27 日