富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

（二〇二〇年第三号）

重要提示

富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)已于2018年2月9日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2018】305号)。本基金的基金合同于2018年8月15日生效。

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申请的注册,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。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券,该券种具有较高的流动性风险和信用风险。中小企业私募债的信用风险是指中小企业私募债券发行人可能由于规模小、经营历史短、业绩不稳定、内部治理规范性不够、信息透明度低等因素导致其不能履行还本付息的责任而使预期收益与实际收益发生偏离的可能性,从而使基金投资收益下降。基金可通过多样化投资来分散这种非系统风险,但不能完全规避。流动性风险是指中小企业私募债券由于其转让方式及其投资持有人数的限制,存在变现困难或无法在适当或期望时变现引起损失的可能性。

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

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。

本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)的,将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

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: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;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7月31日,公司有员工518人,其中72%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部长、富国基金管理有限公司人事经理、总监助理。

(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)易智泉,学士,自2006年7月至2009年3月任易方达基金管理有限公司研究员;自2009年3月至2011年4月任建信基金管理有限责任公司研究组长;自2011年6月至2015年6月任中信证券股份有限公司高级副总裁、权益投资主办人;自2015年10月至2017年7月任天弘基金管理有限公司资深投资经理;自2017年8月加入富国基金管理有限公司;自2017年10月至2019年8月任富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金基金经理;自2018年8月起任富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理;自2019年2月起任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

(2)历任基金经理

俞晓斌自2018年8月至2020年4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。

第二部分 基金托管人

一、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096

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

2018年末,集团资产规模23.22万亿元,较上年增长4.96%。2018年度,集团实现净利润2,556.26亿元,较上年增长4.93%;平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%;不良贷款率1.46%,保持稳中有降;资本充足率17.19%,保持领先同业。

2018年,中国建设银行先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”;美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号,并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工300余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

二、主要人员情况

蔡亚蓉,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职,并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

三、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末,中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

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

(4)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:陈旭
客服电话:95559
公司网站:www.bankcomm.com

(5)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

(6)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

(7)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

(8)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

(9)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街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

(10)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法人代表:黄炎勋
联系人员:周杨
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn

(11)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
办公地址:深圳市福田区福华一路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

(12)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼 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

(13)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期北座
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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)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

(21)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

(22)新时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法人代表:叶顺德
联系人员:田芳芳
客服电话:95399
公司网站:www.xsdzq.cn

(23)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

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)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

(32)腾安基金销售(深圳)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(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区科技中一路腾讯大厦
法人代表:刘明军
联系人员:刘鸣
客服电话:95017
公司网站:www.tenganxinxi.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)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

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

(44)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

(45)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

(46)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

(47)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/

(48)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

(49)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,选择其它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

富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金类型

混合型证券投资基金

第六部分 投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

第七部分 基金投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:

股票投资占基金资产的比例为0-95%。其中,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%。

权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

第八部分 基金投资策略

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

(一)大类资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

本基金主要考虑的因素为:

(1)宏观经济指标,包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、货币供应量、固定资产投资、进出口贸易数据等,以判断当前所处的经济周期阶段;

(2)市场方面指标,包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化;

(3)政策因素,包括货币政策、财政政策、资本市场相关政策等;

(4)行业因素,包括相关行业所处的周期阶段、行业政策扶持情况等。

通过对以上各种因素的分析,结合全球宏观经济形势,研判内地及香港经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,确定或调整投资组合中大类资产的比例。

(二)股票投资策略

1、GARP策略

本基金在股票投资策略方面将主要采用合理价格成长投资策略(GARP策略)。GARP(Growth at a Reasonable Price)策略是一种混合的股票投资策略,目标是寻找某种程度上被市场低估、同时又有较强的持续稳定增长潜力的股票。GARP策略同时兼顾价值策略和成长策略:一方面利用股票的成长属性分享高成长收益机会;另一方面,利用价值型投资标准筛选低估值股票,有效控制市场波动时的风险。

本基金管理人遵循GARP策略,主要考察上市公司的成长性、估值水平、市盈率相对盈利增长比率、净资产收益率等,以此综合判断上市公司的股票是否具有投资价值。

2、港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循前文提到的GARP策略,优先选择估值较低、成长性较强的公司纳入本基金的股票投资组合。

(三)固定收益投资策略

1、普通债券投资策略

本基金固定收益资产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。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固定收益资产的影响,进行合理的利率预期,判断市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券资产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。

2、中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债券具有流动性较差、信用风险较高、资产规模较小等特点,本基金主要采取审慎投资的态度,深入分析发债主体的经营情况、偿债能力等,从而评估信用债的风险程度,严格控制信用风险和流动性风险,选择发行主体资质状况优良,估值合理且流通较好的品种进行投资。

3、资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法,结合信用管理和流动性管理,重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等,采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估,精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。

(四)金融衍生工具投资策略

1、权证投资策略

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。

2、股指期货投资策略

本基金投资股指期货根据风险管理原则,以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以获取相应股票组合的超额收益。

3、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。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,基金可在履行适当程序后,相应调整和更新相关投资策略。

第九部分 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×40%+恒生中国企业指数收益率(经汇率调整后)×20%+中债综合全价指数收益率×40%

中证800指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证800指数的成份股由中证500指数和沪深300指数成份股一起构成。恒生中国企业指数是由香港恒生指数有限公司编制和发布的,追踪以H股形式在香港上市的中国内地企业表现,目前选取综合市值排名前40位的公司纳入指数。中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。本基金管理人认为,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,或者本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在按照监管部门要求履行适当程序后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

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	207,264,285.59	83.37
	其中:股票	207,264,285.59	83.37
2	固定收益投资	5,123,429.60	2.06
	其中:债券	5,123,429.60	2.06
	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	23,160,118.10	9.32
7	其他资产	13,063,621.77	5.25
8	合计	248,611,455.06	100.00

注:本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为27,910,104.39元,占资产净值比例为11.63%;通过深港通交易机制投资的港股公允价值为25,480,142.66元,占资产净值比例为10.62%。

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	139,301,082.08	58.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,811.47	0.00
J	金融业	4,478,016.00	1.87
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	7,783,322.67	3.24
R	文化、体育和娱乐业	2,295,040.00	0.96
S	综合	—	—
	合计	153,874,038.54	64.13

三、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
医疗保健	13,971,430.17	5.82
房地产	7,902,169.44	3.29
非日常生活消费品	8,607,147.49	3.59
日常消费品	3,299,678.69	1.38
通信服务	17,124,588.52	7.14
工业	2,485,232.74	1.04
合计	53,390,247.05	22.25

注:1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含沪港通深港通投资的股票。

四、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	12,097.00	17,696,459.36	7.38
2	00700	腾讯控股	37,600.00	17,124,588.52	7.14
3	300294	博雅生物	419,900.00	15,742,051.00	6.56
4	300529	健帆生物	178,700.00	12,419,650.00	5.18
5	603129	春风动力	149,000.00	10,163,290.00	4.24
6	600529	山东药玻	138,151.00	8,012,758.00	3.34
7	02669	中海物业	1,055,000.00	7,902,169.44	3.29
8	002409	雅克科技	150,500.00	7,851,585.00	3.27
9	600763	通策医疗	46,671.00	7,783,322.67	3.24
10	01177	中国生物制药	576,000.00	7,681,665.02	3.20

五、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	1,001,500.00	0.42
	其中:政策性金融债	1,001,500.00	0.42
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债(可交换债)	4,121,929.60	1.72
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,123,429.60	2.14

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

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	132018	G三峡EB1	35,760.00	3,967,929.60	1.65
2	018007	国开1801	10,000.00	1,001,500.00	0.42
3	113590	海容转债	1,540.00	154,000.00	0.06

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

(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

本基金投资股指期货根据风险管理原则,以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以获取相应股票组合的超额收益。

十一、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。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,基金可在履行适当程序后,相应调整和更新相关投资策略。

(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。

十二、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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

(三)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	364,693.18
2	应收证券清算款	11,532,244.27
3	应收股利	78,502.41
4	应收利息	41,929.46
5	应收申购款	1,046,252.45
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	13,063,621.77

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132018	G三峡EB1	3,967,929.60	1.65

(五)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

(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。

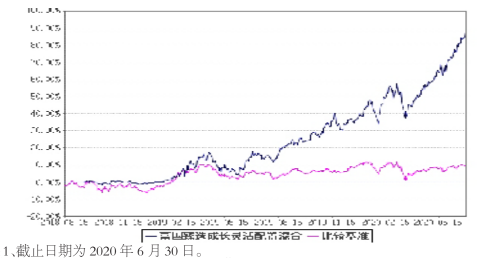
第十二部分 基金的业绩

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

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
2018.08.15-2018.12.31	-0.53%	0.27%	-5.29%	0.84%	4.76%	-0.57%
2019.01.01-2019.12.31	39.85%	1.12%	16.25%	0.65%	23.60%	0.47%
2020.01.01-2020.06.30	34.75%	1.52%	0.04%	0.93%	34.71%	0.59%
2018.08.15-2020.06.30	87.45%	1.13%	10.14%	0.77%	77.31%	0.36%

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6月30日。

2、本基金于2018年8月15日成立,建仓期6个月,从2018年8月15日起至2019年2月14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、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、诉讼费和仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货等交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金相关账户的开户和维护费用;
9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用;
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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、与基金运作有关的费用(一)基金费用的种类”中第3—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。

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。

本基金对通过直销中心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。

养老金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养老金客户范围。非养老金客户指除养老金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养老金客户)	申购费率(其他投资者)
M<100万元	0.12%	1.20%
100万元≤M<500万元	0.08%	0.80%
M≥500万元	0.01%	0.10%

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。

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,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。投资者认(申)购本基金所对应的赎回费率随持有时间递减。具体如下:

持有期限(N)	赎回费率
N<180日	1.50%
180日≤N<365日	0.50%
N≥365日	0

(注:赎回份额持有期限的计算,以该份额自登记机构确认之日开始计算。)

(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30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30日但少于90日的投资者收取的赎回费,将赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期不少于90日但少于180日的投资者收取的赎回费,将赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期不少于180日的投资者,将赎回费总额的25%归入基金财产,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、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且在不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响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》及其它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”部分中,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,对基金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09月01日