

富国中证医药主题指数增强型证券投资基金
（LOF）招募说明书（更新）
（摘要）

（二〇一八年第二号）

重要提示

富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）已于 2016 年 5 月 4 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2016】975 号）。本基金的基金合同于 2016 年 11 月 11 日生效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，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。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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

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

本招募说明书所载内容截止至 2018 年 11 月 11 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2018 年 9 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 8 号上海国金中心二期
16-17 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：赵瑛

注册资本：5.2 亿元人民币

股权结构（截止于 2018 年 11 月 11 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。

公司目前下设二十五个部门、三个分公司和二个子分公司，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、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：负责年金、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作；零售业务部：管理华东营销中心、华中营销中心、广东营销中心、深圳营销中心、北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心，负责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 2018 年 10 月 31 日，公司有员工 439 人，其中 68.8%以上具有硕士以上学历。

二、 主要人员情况

（一） 董事会成员

薛爱东先生，董事长，研究生学历，高级经济师。历任交通银行扬州分行监察室副主任、办公室主任、会计部经理、证券部经理，海通证券股份有限公司扬州营业部总经理，兴安证券有限责任公司托管组组长，海通证券股份有限公司黑龙江管理总部总经理兼党委书记、上海分公司总经理兼党委书记、公司机关党委书记兼总经理办公室主任。

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

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

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

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、固有业务管理部副总经理。

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、组织科科长；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合规与风险管理中心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副总经理，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运营总监。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。

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人力资源部人力资源总监助理。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。

（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。

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权益投资部总经理兼基金经理。

（五）本基金基金经理

（1）现任基金经理：

1) 牛志冬，硕士，自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员；自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理；自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司投资经理；自2015年5月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理，自2016年11月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年3月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年7月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金；兼任量化投资部量化投资副总监。具有基金从业资格。

2) 蔡卡尔，硕士，自2013年8月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员；自2017年1月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；2017年5月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

3) 徐幼华，硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006年

7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年6月至2017年12月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金，2016年11月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年6月至2017年11月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2017年3月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年4月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、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；兼任量化投资部副总经理。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、基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：彭纯

住 所：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

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2017 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，较上年上升 2 位；根据 2017 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 171 位。

截至 2018 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 93915.37 亿元。2018 年 1-9 月，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币 573.04 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

二、 主要人员情况

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生 2018 年 2 月起任交通银行董事长、执行董事。2013 年 11 月起任交通银行执行董事。2013 年 11 月至 2018 年 2 月任交通银行副董事长、执行董事，2013 年 10 月至 2018 年 1 月任交通银行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任交通银行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任交通银行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任交通银行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任交通银行行长助理；1994 年至 2001 年历任交通银行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任交通银行副董事长、执行董事、行长。2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任交通银行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任交通银行资产托管部总经理助理、副总经理，交通银行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任交通银行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

三、 基金托管业务经营情况

截至 2018 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 384 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

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8号上海国金中心二期16-17楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼

法定代表人：薛爱东

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：上海市杨浦区大连路588号宝地广场A座23楼

客户服务统一咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

传真：021-20513177

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

（二）场外代销机构

（1）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：陈四清

联系人员：陈洪源

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法人代表: 田国立

联系人员: 张静

客服电话: 95533

公司网站: www.ccb.com

(3)交通银行股份有限公司

注册地址: 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: 彭纯

联系人员: 王菁

客服电话: 95559

公司网站: www.bankcomm.com

(4)招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法人代表: 李建红

联系人员: 曾里南

客服电话: 95555

公司网站: www.cmbchina.com

(5)中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 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

(6)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市北京东路 689 号

法人代表: 吉晓辉

联系人员: 唐小姐

客服电话: 95528

公司网站: www.spdb.com.cn

(7) 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

(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) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场二期北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法人代表: 张佑君

联系人员: 顾凌

客服电话: 95548 或 4008895548

公司网站: www.cs.ecitic.com

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 中信证券山东有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法人代表: 杨宝林

联系人员: 吴忠超

客服电话: 95548 或 400-889-5548

公司网站: www.zxzqsd.com.cn

(14) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法人代表: 薛峰

联系人员: 刘晨、李芳芳

客服电话: 95525

公司网站: www.ebscn.com

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

（ 19 ）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

（ 20 ）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

（ 21 ）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

（ 22 ）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

（ 23 ）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>

（ 24 ）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/>

（ 25 ）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： 4000-618-518

公司网站： danjuanapp.com

（三）场内销售机构

本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。

（四）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，并及时公告。

二、 基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
电话：（010）59378839
传真：（010）59378907
联系人：朱立元

三、 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人：俞卫锋
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：孙睿
经办律师：黎明、孙睿

四、 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（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
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

第四部分 基金名称

富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）

第五部分 基金类型

股票型证券投资基金

第六部分 投资目标

本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证医药主题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。

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，包括中证医药主题指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、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）等）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于中证医药主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

第八部分 基金投资策略

1、股票投资策略

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。

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 8%。

（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。

2、固定收益资产投资策略

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

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

3、金融衍生工具投资策略

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

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

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

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益

率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

第九部分 标的指数与基金业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中证医药主题指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的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标的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，经与基金托管人协商一致，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，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

2、业绩比较基准

$95\% \times \text{中证医药主题指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$

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

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

管理人应与基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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 | 117,248,494.87 | 91.65 |
| | 其中：股票 | 117,248,494.87 | 91.65 |
| 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 | 8,749,469.41 | 6.84 |
| 7 | 其他资产 | 1,936,187.80 | 1.51 |
| 8 | 合计 | 127,934,152.08 | 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 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 5,840,016.88 | 4.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 2,527,800.00 | 2.00 |
| 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 | — | — |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | — | — |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | — | — |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 8,367,816.88 | 6.62 |

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 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 87,592,417.33 | 69.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 7,063,649.51 | 5.59 |
| 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 | 1,606,651.20 | 1.27 |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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 | 12,617,959.95 | 9.98 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 108,880,677.99 | 86.16 |

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

（一）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 | 600276 | 恒瑞医药 | 164,503.00 | 10,445,940.50 | 8.27 |
| 2 | 000661 | 长春高新 | 20,300.00 | 4,811,100.00 | 3.81 |
| 3 | 300015 | 爱尔眼科 | 147,319.00 | 4,751,037.75 | 3.76 |
| 4 | 300003 | 乐普医疗 | 153,200.00 | 4,649,620.00 | 3.68 |
| 5 | 002422 | 科伦药业 | 152,000.00 | 4,053,840.00 | 3.21 |
| 6 | 600332 | 白云山 | 107,400.00 | 3,930,840.00 | 3.11 |
| 7 | 300347 | 泰格医药 | 66,300.00 | 3,561,636.00 | 2.82 |
| 8 | 600436 | 片仔癀 | 34,174.00 | 3,460,459.24 | 2.74 |
| 9 | 300142 | 沃森生物 | 158,600.00 | 3,457,480.00 | 2.74 |
| 10 | 600566 | 济川药业 | 78,800.00 | 3,103,932.00 | 2.46 |

（二）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 | 603939 | 益丰药房 | 44,000.00 | 2,527,800.00 | 2.00 |
| 2 | 002382 | 蓝帆医疗 | 121,800.00 | 2,417,730.00 | 1.91 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----------|--------------|------|
| 3 | 002614 | 奥佳华 | 76,300.00 | 1,310,071.00 | 1.04 |
| 4 | 300396 | 迪瑞医疗 | 58,720.00 | 1,133,296.00 | 0.90 |
| 5 | 603579 | 荣泰健康 | 11,200.00 | 502,208.00 | 0.40 |

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

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

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

（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 | 44,553.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 1,671.86 |
| 5 | 应收申购款 | 1,889,962.48 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 9 | 其他 | — |
| 10 | 合计 | 1,936,187.80 |

（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

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。

（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 |
|---------------------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 2016. 11. 11-2016. 12. 31 | -6. 60% | 0. 83% | -4. 72% | 0. 75% | -1. 88% | 0. 08% |
| 2017. 01. 01-2017. 12. 31 | 4. 50% | 0. 83% | 7. 82% | 0. 73% | -3. 32% | 0. 10% |
| 2018. 01. 01-2018. 09. 30 | -2. 46% | 1. 74% | -9. 23% | 1. 55% | 6. 77% | 0. 19% |
| 2016. 11. 11-2018. 09. 30 | -4. 80% | 1. 27% | -6. 75% | 1. 13% | 1. 95% | 0. 14% |

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2018年9月30日。

2、本基金于2016年11月11日成立，建仓期6个月，从2016年11月11日起至2017年5月10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、基金的标的指数许可使用费；
- 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、基金的相关账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费用和年费；
- 11、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 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的指数许可使用费

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

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

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

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 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项纳税主体，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，由基金份额持有人承担，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、 申购费用

本基金的申购费率由基金管理人决定，基金份额申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

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

（1） 场外申购费率

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

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，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。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 < 200 万元 | 0.06% | 0.60% |
| 200 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.04% | 0.40% |
| M ≥ 500 万元 | 每笔 1,000 元 | |

(2) 场内申购费率

本基金的场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

2、赎回费用

本基金场内场外赎回费率为持续持有期 7 日内 1.50%，持续持有期 7 日及以上 0.50%。

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持续持有期少于 7 日的投资者，赎回费全额归入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付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，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本基金的申购费率等。

5、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。

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“重要提示”部分，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、“第三部分 基金管理人”，对基金管理人信息进行了更新。
- 3、“第四部分 基金托管人”，对基金托管人信息进行了更新。
- 4、“第五部分 相关服务机构”，对相关服务机构的信息进行了更新。
- 5、“第九部分 基金份额的申购与赎回”，对申购和赎回的数量限制、养老金客户的范围及申购费率进行了更新。
- 6、“第十一部分 基金的投资”部分，基金投资组合报告内容更新至 2018 年 9 月 30 日。
- 7、“第十二部分 基金的业绩”，内容更新至 2018 年 9 月 30 日。
- 8、“第二十三部分 对基金份额持有人的服务”，对客户服务内容进行了更新。
- 9、“第二十四部分 其他应披露事项”，对本报告期内的其他事项进行披露。

富国基金管理有限公司

2018 年 12 月 12 日