

富国中证科技 50 策略交易型开放式指数  
证券投资基金招募说明书（更新）  
（摘要）

（二〇二〇年第一号）

## 重要提示

富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2019 年 9 月 16 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2019】1702 号《关于准予富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》）。

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申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景等做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资中的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，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、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式基金，特定风险还包括：基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险等等。本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

投资者投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用中证科技 50 策略指数成份股或备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证科技 50 策略指数成份股或备选成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同和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，自主做出投资决策，自行承担投资风险。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。

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。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 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

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

成立日期：1999 年 4 月 13 日

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

电话：（021）20361818

联系人：赵瑛

注册资本：5.2 亿元人民币

股权结构（截止于 2019 年 8 月 31 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 2019 年 8 月 31 日，公司有员工 466 人，其中 70%以上具有硕士以上学历。

## 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，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。

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。历任海通证券有限公司财务会计部员工、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

王乐乐，博士，自2010年6月至2011年11月在上海证券有限责任公司任研究员；自2011年11月至2012年6月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自2012年7月至2015年5月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自2015年5月加入富国基金管理有限公司，2015年8月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017年10月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月起任富国中证工业4.0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，2018年11月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国中证央

企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部 ETF 投资总监。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：中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”）

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2005]112 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 76.46 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2015】219 号

中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日，是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司。公司注册于北京，注册资本 76.46 亿元，在全国 30 个省、市、自治区设有 302 家营业网点，并设有中信建投期货有限公司、中信建投资本管理有限公司、中信建投（国际）金融控股有限公司、中信建投投资有限公司 4 家全资子公司，和中信建投基金管理有限公司 1 家控股子公司。自成立以来，中信建投证券各项业务快速发展，在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势，并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。凭借高度的敬业精神与突出的专业能力，中信建投证券主要业务指标及盈利能力目前均位居行业前列。

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中信建投证券托管部管理团队和业务骨干具有丰富的证券投资基金托管业务运作经验，业务人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，可为托管客户提供个性化产品处理能力。

### 三、证券投资基金托管情况

中信建投证券于 2015 年 2 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，

中信建投证券始终遵循“诚信、专注、成长、共赢”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，切实维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、 基金份额发售机构

#### 1、 发售协调人

发售主协调人详见基金份额发售公告。

#### 2、 网下现金认购和网下股票认购的直销机构

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

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](http://www.fullgoal.com.cn)

#### 3、 网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构和网上现金发售代理机构

具体名单详见本基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金发售代理机构，并在管理人网站公示。

### 二、 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话: (010) 50938782

传真: (010) 50938991

联系人: 赵亦清

### 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: 陈颖华

经办律师: 黎明、陈颖华

### 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

富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金



## 第五部分 基金类型

股票指数型证券投资基金

## 第六部分 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

## 第七部分 基金投资方向

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

## 第八部分 基金投资策略

本基金主要采用复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

### 1、资产配置策略

本基金管理人按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 2、债券投资策略

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

### 3、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。

#### 4、衍生品投资策略

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债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，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

#### 5、参与融资及转融通证券出借业务策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

## 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科技 50 策略指数收益率。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人调整业绩比较基准应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 第十一部分 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、期货等交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费及年费、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 10、基金合同生效后基金的证券、期货账户开户费用，银行账户维护费用；
- 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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 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。

#### 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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：



$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 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。

### 3、基金的指数许可使用费

本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数许可使用费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计，按季支付。指数许可使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于下一个季度开始后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

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、 申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、 申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日发售在外的基金份额总数，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

3、 投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

## 第十二部分 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，本次招募说明书更新内容为：

因沪市跨市场 ETF 交易结算模式的修改，更新重要提示、申购与赎回的清算交收与登记的相关内容。

富国基金管理有限公司

2020 年 01 月 15 日