# 富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(二〇二〇年第二号)

重要提示

富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")已于 2017 年 9 月 1 日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2017】1612 号)。本基金的基金合同于 2018 年 3 月 26 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的注册,并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景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 1 月 20 日,基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2019 年 12 月 31 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 01 月 20 日):

| 股东名称 | 出资比例 |
|---|---|
| 海通证券股份有限公司 | 27.775% |
| 申万宏源证券有限公司 | 27.775% |
| 加拿大蒙特利尔银行 | 27.775% |
| 山东省国际信托股份有限公司 | 16.675% |

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设二十八个部门、三个分公司和二个子公司,分别是:权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、多元资产投资部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、机构业务部、养老金业务部、银行业务部、机构服务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部(董事会办公室)、信息技术部、运营部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理(香港)有限公司、富国资产管理(上海)有限公司。

权益投资部:负责权益类基金产品的投资管理;固定收益投资部:负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分(包括公司自有资金等)的投资管理;固定收益专户投资部:负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理;固定收益信用研究部:建立和完善债券信用评级体系,开展信用研究等,为公司固定收益类投资决策提供研究支持;固定收益策略研究部:开展固定收益投资策略研究,统一固定收益投资中台管理,为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制;多元资产投资部:根据法律法规、公司规章制度、契约要求,在授权范围内,负责 FOF 基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理;量化投资部:负责公司有关量化投资管理业务;海外权益投资部:负责公司在中国境外(含香港)的权益投资管理;权益专户投资部:负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理;养老金投资部:负责养老金(企业年金、职业年金、基本养老金、社保等)及类养老金专户等产品的投资管理;权益研究部:负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等;集中交易部:负责投资交易和风险控制;机构业务部:负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金 FOF、海外客户等客群的销售与服务;养老金业务部:负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务;银行业务部:负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务;机构服务部:负责协调三个机构销售部门对接公司资源,实现项目落地,提供专业支持和项目管理,对公司已有机构客户进行持续专业服务;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、广东营销中心、深圳营销中心、北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心,负责公募基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理,为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持;客户服务部:拟定客户服务策略,制定客户服务规范,建设客户服务团队,提高客户满意度,收集客户信息,分析客户需求,支持公司决策;电子商务部:负责基金电子商务发展趋势分析,拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则,有效推进公司电子商务业务;战略与产品部:负责开发、维护公募和非公募产品,协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略,建立数据搜集、分析平台,为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持;合规稽核部:履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责,开展内部审计,管理信息披露、法律事务等;风险管理部:执行公司整体风险管理策略,牵头拟定公司风险管理制度与流程,组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对,负责公司旗下各投资组合合规监控等;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;综合管理部(董事会办公室):负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司(内部)宣传、信息调研、行政后勤管理等工作;富国资产管理(香港)有限公司:证券交易、就证券提供意见和提供资产管理;富国资产管理(上海)有限公司:经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

截止到 2020 年 1 月 31 日,公司有员工 481 人,其中 70%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、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。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分公司财会部筹备负责人;上海申银证券公司浦东分公司财会部副经理、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、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

吴畏, 硕士,2008 年 7 月至 2010 年 5 月任招商银行总行授信审批部秘书,2010 年 5 月至 2018 年 1 月任兴业证券股份有限公司首席分析师; 自 2018 年 1 月加入富国基金管理有限公司,2018 年 10 月起任富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018 年 12 月起任富国金融地产行业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

1)李晓铭自 2018 年 3 月至 2019 年 4 月任本基金基金经理;
2)于鹏自 2018 年 3 月至 2019 年 4 月任本基金基金经理;
3)王海军自 2018 年 4 月至 2019 年 4 月任本基金基金经理。

(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、基金托管人概况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")
设立日期:1987 年 4 月 8 日
注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
注册资本:252.20 亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83 号
电话:0755—83199084
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股,4 月 9 日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股,9 月 22 日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10 月 5 日行使 H 股超额配售,共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2019 年 9 月 30 日,招商银行总资产 73,059.25 亿元人民币,高级法下资本充足率 15.44%,权重法下资本充足率 12.86%。

2002 年 8 月,招商银行成立基金托管部;2005 年 8 月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队 7 个职能团队,现有员工 87 人。2002 年 11 月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格, 成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003 年 4 月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S 托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6 心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,推出国内首个托管大数据平台,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖",成为国内唯一获得该奖项的托管银行;"托管通"获得国内《银行家》2016 中国金融创新"十佳金融产品创新奖";7 月荣膺 2016 年中国资产管理"金贝奖""最佳资产托管银行"。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖";"全功能网上托管银行 2.0"荣获《银行家》2017 中国金融创新"十佳金融产品创新奖";8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖"。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司"2017 年度优秀资产托管机构"奖项;同月,招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统"金点子"方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖;3 月荣膺公募基金 20 年"最佳基金托管银行"奖;5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖";12 月荣膺 2018 东方财富风云榜"2018 年度最佳托管银行"、"20 年最值得信赖托管银行"奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》"2018 年度最佳基金托管银行"奖;6 月荣获《财资》"中国最佳托管机构""中国最佳养老金托管机构""中国最佳零售基金行政外包"三项大奖。

二、主要人员情况

李建红先生,招商银行董事长、非执行董事,2014 年 7 月起担任招商银行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,招商银行行长、执行董事,2013 年 5 月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生,招商银行副行长。1991 年加入招商银行;2002 年 10 月至 2013 年 12 月历任招商银行长沙分行行长,总行公司银行部副总经理,佛山分行筹备组组长,佛山分行行长,武汉分行行长;2013 年 12 月至 2016 年 10 月任招商银行业务总监兼公司金融总部总裁,期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理;2016 年 10 月至 2017 年 4 月任招商银行业务总监兼北京分行行长;2017 年 4 月起任招商银行党委委员兼北京分行行长。2019 年 4 月起任招商银行副行长。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日,招商银行股份有限公司累计托管 510 只证券投资基金。

### 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

(2)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

(3)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

(4)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址: 上海市北京东路 689 号
法人代表: 高国富
联系人员: 唐小姐
客服电话: 95528
公司网站: www.spdb.com.cn

(5)中国民生银行股份有限公司
注册地址: 北京市东城区正义路 4 号
办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号
法人代表: 董文标
联系人员: 杨成茜
客服电话: 95568
公司网站: www.cmbc.com.cn

(6)江苏银行股份有限公司
注册地址: 江苏省南京市洪武北路 55 号
办公地址: 江苏省南京市洪武北路 55 号
法人代表: 黄志伟
联系人员: 田春慧
客服电话: 95319
公司网站: www.jsbchina.cn

(7)苏州银行股份有限公司
注册地址: 江苏省苏州工业园区钟园路 728 号
办公地址: 江苏省苏州工业园区钟园路 728 号
法人代表: 王兰凤
联系人员: 葛晓亮
客服电话: 96067
公司网站: www.suzhoubank.com

(8)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

(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 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

(10)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

(11)西藏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

(12)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

(13)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

(14)上海挖财基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 5 层 01、02、03 室
办公地址: 上海浦东陆家嘴金融世纪广场 3 号楼 5F
法人代表: 冷飞
联系人员: 李娟
客服电话: 021-50810673
公司网站: http://www.wacaijijin.com/

(15)北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101
办公地址: 北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦
法人代表: 张旭阳
联系人员: 孙博超
客服电话: 95055-4
公司网站: www.baiyingfund.com

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)嘉实财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元
法人代表: 赵学军
联系人员: 张倩
客服电话: 400-021-8850
公司网站: www.harvestwm.cn

(21)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

(22)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

(23)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

(24)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

(25)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/

(26)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

(27)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

(28)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

富国价值驱动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

本基金注重估值,分红和业绩增速等主动价值投资因素,以研究驱动个股优选,追求资产的长期、稳定增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

### 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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、中小企业私募债券等)、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(股指期货、国债期货、权证等)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:股票资产占基金资产的比例为 0-95%,其中港股通标的股票资产占股票资产的比例为 0-50%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 保持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。

如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制,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

本基金遵循主动价值投资核心驱动逻辑优选个股,充分发挥基金管理人的研究优势。在投资过程中体现低估值、稳增长、高分红等主动价值投资理念,切实贯彻自上而下的大类资产配置和自下而上的个股精选的投资策略。在控制风险的前提下实现收益最大化。

(一)大类资产配置策略

本基金通过定量与定性相结合的方法,采用"自上而下"的资产配置方法确定各类资产的配置比例。本基金对宏观经济政策及证券市场整体走势进行前瞻性研究,同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素,兼顾宏观经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动, 在对证券市场当期的系统性风险及各类资产的预期风险收益进行充分分析的基础上,合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的投资权重,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。

(二)股票投资策略

本基金主要通过主动投资方法,选取并持有预期收益较好股票构成投资组合,在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金重点关注的价值型股票主要包括:

1、估值水平合理

根据上市公司所处行业,基于动态静态指标相结合的原则,以相对估值为主,绝对估值为辅。相对估值方法包括市盈率(PE)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市净率(PB)、企业价值倍数(EV/EBITDA)、市销率(PS)、每用户平均收入(ARUP)等,绝对估值方法主要采用股利贴现模型(DDM)和自由现金流贴现模型(DCF),衡量该公司的股价是否处于合理的估值区间。

2、拥有成长能力

公司的历史成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力,因此,本基金采用营业收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率等指标来考量公司的历史成长性,作为判断公司未来成长性的依据。在关注上市公司历史成长性的同时,本基金尤其关注未来盈利的增长潜力。

3、具备盈利质量

本基金采用分红率、毛利率、营业利润率、净利率、总资产收益率、净资产收益率等指标来考量公司的盈利能力和质量。

(三)债券投资策略

1、普通债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

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。

(四)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者谋求较高的投资组合回报率。

(五)权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究, 同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。

(六)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(七)国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的国债期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 第九部分 基金业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 × 60%+恒生指数收益率 × 15%+中债综合指数收益率 × 25%

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数, 具有良好的市场代表性。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制, 以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

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。

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的指数时,本基金可以在基金托管人同意、报中国证监会备案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, 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和债券型基金,低于股票型基金。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 | 111,170,978.28 | 87.96 |
|  | 其中:股票 | 111,170,978.28 | 87.96 |
| 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 | 12,423,537.50 | 9.83 |
| 7 | 其他资产 | 2,797,457.60 | 2.21 |
| 8 | 合计 | 126,391,973.38 | 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 6,969,650.00 元,占资产净值比例为 5.77%;通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 2,449.76 元,占资产净值比例为 0.00%。

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 | 46,435,735.76 | 38.45 |
| 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 | – | – |
| 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 | 21,215,910.70 | 17.57 |
| J | 金融业 | 16,824,830.06 | 13.93 |
| K | 房地产业 | 11,790,870.00 | 9.76 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,931,532.00 | 6.57 |
| 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 | 104,198,878.52 | 86.27 |

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 | 2,449.76 | 0.00 |
| 房地产 | 6,969,650.00 | 5.77 |
| 合计 | 6,972,099.76 | 5.77 |

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 | 8,333.00 | 9,857,939.00 | 8.16 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 268,490.00 | 9,799,885.00 | 8.11 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 72,000.00 | 9,576,720.00 | 7.93 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 111,511.00 | 9,529,730.06 | 7.89 |
| 5 | 600845 | 宝信软件 | 280,260.00 | 9,220,554.00 | 7.63 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 86,100.00 | 7,931,532.00 | 6.57 |
| 7 | 688111 | 金山办公 | 39,818.00 | 6,526,170.20 | 5.40 |
| 8 | 000977 | 浪潮信息 | 187,700.00 | 5,649,770.00 | 4.68 |
| 9 | 600570 | 恒生电子 | 68,895.00 | 5,355,208.35 | 4.43 |
| 10 | 000002 | 万 科 A | 165,800.00 | 5,335,444.00 | 4.42 |

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

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的国债期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

(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。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"万科 A"的发行主体万科企业股份有限公司(以下简称"公司"), 由于存在违反外汇登记管理规定的违法事实, 国家外汇管理局深圳市分局于 2019 年 6 月 26 日对公司作出罚款 5 万元的行政处罚(深外管检[2019]27 号)。

基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余 9 名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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 | 349,955.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,395,544.06 |
| 3 | 应收股利 | 1,730.17 |
| 4 | 应收利息 | 2,636.44 |
| 5 | 应收申购款 | 47,591.64 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 2,797,457.60 |

(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

(1)A 级

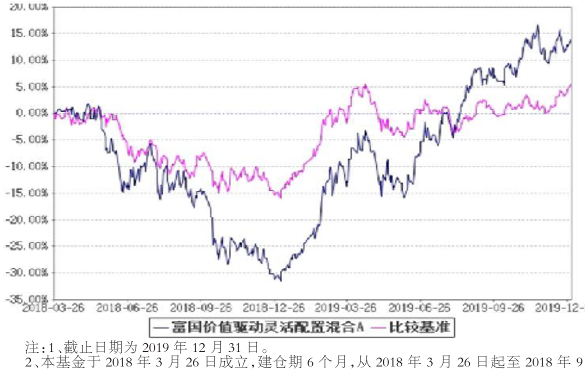
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2018.03.26-2018.12.31 | -30.48% | 1.59% | -14.82% | 0.97% | -15.66% | 0.62% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 64.11% | 1.48% | 23.81% | 0.84% | 40.30% | 0.64% |
| 2018.03.26-2019.12.31 | 14.09% | 1.54% | 5.46% | 0.90% | 8.63% | 0.64% |

(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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2018.03.26-2018.12.31 | -30.92% | 1.59% | -14.82% | 0.97% | -16.10% | 0.62% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 62.81% | 1.48% | 23.81% | 0.84% | 39.00% | 0.64% |
| 2018.03.26-2019.12.31 | 12.47% | 1.54% | 5.46% | 0.90% | 7.01% | 0.64% |

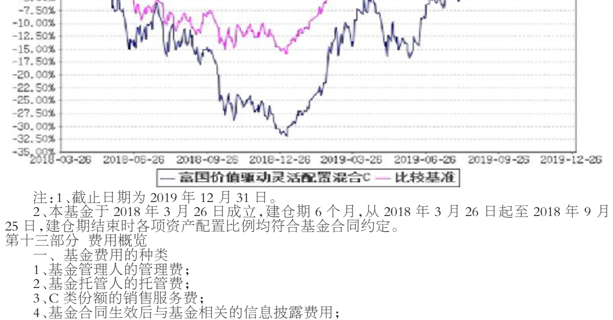
二、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1)自基金合同生效以来富国价值驱动灵活配置混合 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 2019 年 12 月 31 日。
2、本基金于 2018 年 3 月 26 日成立,建仓期 6 个月,从 2018 年 3 月 26 日起至 2018 年 9 月 25 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价值驱动灵活配置混合 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 2019 年 12 月 31 日。
2、本基金于 2018 年 3 月 26 日成立,建仓期 6 个月,从 2018 年 3 月 26 日起至 2018 年 9 月 25 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、C 类份额的销售服务费;
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、基金合同生效后基金的证券、期货结算等账户开户费用,银行账户维护费用;
10、因投资港股通标的股票而产生的各项费用;
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 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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后, 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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 0.25%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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后, 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

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年费率为 0.80%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.80%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.80%÷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

C 类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述"(一)基金费用的种类"中第 4-11 项费用,根据有关法律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,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。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中,可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人,就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此,本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负,仍由本基金财产承担,届时基金管理人与基金托管人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

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) | A 类基金申购费率(通过直销中心申购的养老金客户) | A 类基金申购费率(其他投资者) |
|---|---|---|
| M<100 万元 | 0.15% | 1.50% |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.12% | 1.20% |
| M≥500 万元 | 每笔 1,000 元 |  |

本基金 A 类基金份额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)赎回费用由基金赎回人承担。投资者认(申)购本基金所对应的赎回费率随持有时间递减。具体如下:

1)对于本基金 A 类基金份额,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 | 0.75% |
| 30 日≤N<180 日 | 0.50% |
| N≥180 日 | 0 |

2)对于本基金 C 类基金份额,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 | 0.50% |
| 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 30 日的投资者收取的赎回费,将全额计入基金财产;对持续持有期长于 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;对持续持有期长于 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;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》、《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、"重要提示"部分,更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
2、"第三部分 基金管理人"部分,对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。
3、"第五部分 相关服务机构"部分,对代销机构信息进行了更新。
4、"第九部分 基金的投资"部分,对基金投资组合报告进行了更新,内容截止至 2019 年 12 月 31 日。
5、"第十部分 基金的业绩"部分,对基金业绩表现数据及历史走势图进行了更新,内容截止至 2019 年 12 月 31 日。
6、"第十七部分 风险揭示"部分,补充基金投资科创板股票的特定风险。
7、"第二十二部分 其他应披露事项"部分,对本报告期内应披露的其他事项进行了更新。

富国基金管理有限公司
2020 年 02 月 21 日