富国中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭A基与煤炭B基基金份额上市交易公告书

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2015年6月30日
公告日期:2015年6月25日

一、重要声明与提示

《富国中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭A基与煤炭B基基金份额上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,富国中证煤炭指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人国泰君安证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对富国中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭A基与煤炭B基基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2015年6月4日《中国证券报》和《证券时报》以及本公司网站(www.fullgoal.com.cn)上的《富国中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》以及同日发布在本公司网站(www.fullgoal.com.cn)上的《富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)。

二、基金概览

1、基金名称:富国中证煤炭指数分级证券投资基金
2、基金类别:股票型证券投资基金
3、基运作方式:契约型开放式
4、本基金的基金份额包括富国中证煤炭指数分级证券投资基金之基础份额(即“富国煤炭份额”,场内简称“煤炭基金”,基金代码:161032)、富国中证煤炭指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“富国煤炭A份额”,场内简称“煤炭A基”,基金代码:150321)与富国中证煤炭指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“富国煤炭B份额”,场内简称“煤炭B基”,基金代码:150322)。
5、基金存续期限:不定期。
6、富国煤炭A份额、富国煤炭B份额与富国煤炭份额的资产合并运作。
7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额,将被确认为富国煤炭份额。投资者场内认购所得的份额,将按1∶1的基金份额配比自动分离为富国煤炭A份额和富国煤炭B份额。基金合同生效后,投资者认购所得的富国煤炭份额场内份额的自动分离,由基金管理人委托注册登记机构进行,无需基金份额持有人申请。
8、基金合同生效后,富国煤炭份额(场内简称:煤炭基金,基金代码:161032)设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,不上市交易。富国煤炭A份额(场内简称:煤炭A基;交易代码:150321)与富国煤炭B份额(场内简称:煤炭B基;交易代码:150322)只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
9、富国煤炭份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式,申购或赎回富国煤炭份额(场内简称:煤炭基金,基金代码:161032)。办理富国煤炭份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理富国煤炭份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对富国煤炭A份额或富国煤炭B份额单独开放场内申购、赎回。
10、场内份额配对转换:场内份额配对转换是指本基金场内的富国煤炭份额与分级份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并。分拆指场内的富国煤炭份额按照1∶1的基金份额配比分拆成富国煤炭A份额和富国煤炭B份额的行为。合并指富国煤炭A份额和富国煤炭B份额按照1∶1的基金份额配比合并成富国煤炭份额场内份额的行为。
11、基金份额折算:基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是富国煤炭份额的基金份额净值高至1.500元或以上,或富国煤炭B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下。有关基金份额折算的约定,参见基金合同“二十一、基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。
12、基金份额总额:截至2015年6月23日,本基金的份额总额为1,374,939,470.73份;其中,富国煤炭份额为110,155,700.73份;富国煤炭A份额为632,391,885份;富国煤炭B份额为632,391,885份。
13、基金份额净值:截至2015年6月23日,富国煤炭份额的基金份额净值为1.000元,富国煤炭A份额的基金份额净值为1.001元,富国煤炭B份额的基金份额净值为0.999元。
14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:份额简称:煤炭A基,交易代码:150321;份额简称:煤炭B基,交易代码:150322。
15、本次上市交易份额:煤炭A基:632,391,885份;煤炭B基:632,391,885份
16、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
17、上市交易日期:2015年6月30日
18、基金管理人:富国基金管理有限公司
19、基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、富国中证煤炭指数分级证券投资基金的募集与上市交易

(一)富国中证煤炭指数分级证券投资基金上市前募集情况
1、本基金注册申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可【2015】931号
2、发售日期:2015年6月8日至2015年6月12日
3、发售面值:1.00元人民币
4、发售方式:场内、场外认购
5、发售机构:
(1)场内发售机构
场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。
(2)场外发售机构
本基金的场外销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构是指富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”),包括上海投资理财中心,代销机构包括国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司(排名不分先后)。
6、验资机构名称:安永华明会计师事务所
7、认购资金总额及入账情况:
本次富国中证煤炭指数分级证券投资基金募集的有效认购户数为8,800户,净销售金额为人民币1,374,872,869.03元,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币66,601.70元。
上述资金中,场内首次发行募集资金及其利息为人民币1,264,783,770.00元,场外首次发行募集资金及其利息为人民币110,155,700.73元,分别于2015年6月17日全额划入本基金通过基金托管人国泰君安证券股份有限公司开立的富国中证煤炭指数分级证券投资基金托管专户。
按照每份基金份额初始面值1.00元计算,本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计1,374,939,470.73份,已全部计入基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有。其中,募集期间基金管理人的从业人员认购本基金5100.22份(含利息转份额),占基金总份额比例为0.0004%;基金管理人未运用固有资金认购本基金;基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未认购本基金。本基金的基金经理未认购本基金。
8、基金备案情况
本基金于2015年6月17日验资完毕,2015年6月17日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2015年6月19日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。
9、基金合同生效日:2015年6月19日。
10、本基金总份额:1,374,939,470.73份。
(二)富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2015]302号
2、上市交易日期:2015年6月30日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、份额简称:煤炭A基,交易代码:150321;份额简称:煤炭B基,交易代码:150322
5、本次上市交易份额:煤炭A基:632,391,885份;煤炭B基:632,391,885份(截至2015年6月23日)
6、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布富国煤炭份额的基金份额净值、煤炭A基和煤炭B基的基金份额参考净值,并在深交所行情发布系统揭示。
7、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的富国煤炭份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其外拆为煤炭A基和煤炭B基即可上市流通;对于托管在场外的份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为煤炭A基和煤炭B基即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2015年6月23日,富国中证煤炭指数分级证券投资基金之富国煤炭份额的持有人总户数为8,800户,其中场外持有人总户数为6,281户;富国煤炭A份额持有人总户数为2,519户,全部为场内持有人;富国煤炭B份额持有人总户数为2,519户,全部为场内持有人;富国煤炭份额平均每户持有的场外基金份额为17,537.92份,煤炭A基平均每户持有的场内基金份额为251,048.78份,煤炭B基平均每户持有的场内基金份额为251,048.78份。
(二)持有人结构
1、截至2015年6月23日,场内基金份额持有人结构如下:
煤炭A基:场内机构投资者持有的基金份额170,314,350份,占比26.93%;场内个人投资者持有的基金份额462,077,535份,占比73.07%。
煤炭B基:场内机构投资者持有的基金份额170,314,350份,占比26.93%;场内个人投资者持有的基金份额462,077,535份,占比73.07%。
2、截至2015年6月23日,基金管理人的从业人员持有本基金的情况如下:

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国煤炭份额	5,100.22	0.0004
	煤炭A基	0	0
	煤炭B基	0	0
	合计	5,100.22	0.0004

截至2015年6月23日,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;本基金的基金经理未持有本基金。
(三)截至2015年6月23日,场内煤炭A基基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例(%)
1	华能贵诚信托有限公司	25,000,486	3.95
2	严船平	15,001,021	2.37
3	郑志国	15,001,021	2.37
4	长江证券股份有限公司	15,000,875	2.37
5	王毅	15,000,292	2.37
6	国信证券股份有限公司	15,000,292	2.37
7	西南证券股份有限公司	15,000,291	2.37
8	融通资本财富-光大银行-融通资本西南证券量化对冲1号资产管理计划	15,000,291	2.37
9	天津易鑫安资产管理有限公司-易鑫安资管鑫安6期	14,000,272	2.21
10	李治国	13,500,845	2.13

截至2015年6月23日,场内煤炭B基基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例(%)
1	华能贵诚信托有限公司	25,000,486	3.95
2	严船平	15,001,020	2.37
3	郑志国	15,001,020	2.37
4	长江证券股份有限公司	15,000,874	2.37
5	西南证券股份有限公司	15,000,292	2.37
6	融通资本财富-光大银行-融通资本西南证券量化对冲1号资产管理计划	15,000,292	2.37
7	王毅	15,000,291	2.37
8	国信证券股份有限公司	15,000,291	2.37
9	天津易鑫安资产管理有限公司-易鑫安资管鑫安6期	14,000,272	2.21
10	李治国	13,500,846	2.13

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、基本情况
名称:富国基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼
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
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:范伟隽
注册资本:1.8亿元人民币
股权结构(截止于2015年5月30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%
山东省国际信托有限公司	16.675%

公司目前下设二十二个部门、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、固定收益研究部、量化与海外投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、董事会办公室、综合管理部、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、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、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;固定收益研究部: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的研究管理等;量化与海外投资部:负责量化权益投资、量化衍生品投资及境外权益等各类投资的研究与投资管理;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;董事会办公室:履行公司章程规定的工作职责,暂与综合管理部合署办公;综合管理部: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;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、华南营销中心(广州分公司)、北方营销中心(北京分公司)、西部营销中心(成都分公司)、华北营销中心,负责共同基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒体关系管理,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;监察稽核部:负责监察、风控、法务和信息披露;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;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2015年5月30日,公司有员工279人,其中61%以上具有硕士以上学历。
3、本基金基金经理
徐幼华,复旦大学硕士研究生。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月起任富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金(自2012年4月18日起正式更名为“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15日起任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金基金经理,具有基金从业资格,中国籍。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:国泰君安证券股份有限公司
住所:上海浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号29层
法定代表人:杨德红
成立时间:1999年8月18日
组织形式:股份有限公司
注册资本:陆拾壹亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可[2014]511号
联系人:王健
联系电话:021-38676666
国泰君安证券前身为国泰证券和君安证券,1999年8月18日两公司合并新设为国泰君安证券股份有限公司。截至2013年12月31日,国泰君安证券注册资本为61亿元人民币,直接设有5家境内子公司和1家境外子公司,并在全国设有30家分公司和195家证券营业部,是国内最早开展各类创新业务的券商之一。2008-2013年,公司连续六年在中国证监会证券公司分类评级中被评为A类AA级,为目前证券公司获得的最高评级。
2、主要人员情况
杨德红先生,中国国籍,汉族,1966年10月出生,中共党员,工商管理硕士,经济师,现任国泰君安党委书记、总裁。1989年7月起任上海国际信托投资公司投资银行二部经理、投资银行总部总经理,2000年7月起兼任上海上投国际投资咨询有限公司总经理;2002年9月起历任国际集团资产经营公司总经理、国际集团办公室、董事会办公室、信息中心主任,2004年2月起兼任上海国际信托投资有限公司副总经理;2005年7月起任国际集团总裁助理、国际集团资产经营公司总经理;2006年3月起任国际集团总裁助理;2008年4月任国际集团副总裁、党委委员,2009年8月起兼任上海爱建股份有限公司总经理、党委副书记;2014年2月起任国际集团副总裁、党委副书记;2014年9月起任国泰君安党委副书记;2014年11月起任国泰君安总裁、党委副书记;2015年1月起任国泰君安党委书记、总裁。2015年5月起任国泰君安党委书记、董事长、总裁。
蒋忆明先生,中国国籍,无境外居留权,1963年11月出生,经济学硕士,会计师,现任国泰君安副总裁、财务总监。1990年7月参加工作,任深圳宇康太阳能有限公司财务部经理;1993年5月起历任君安财务顾问公司财务部副经理、经理,君安证券经纪业务部副总经理,资金计划部副总经理、总经理,财务总监;1999年8月起任国泰君安深圳分公司副总经理;2000年10月起任国泰君安总会计师;2004年3月起任国泰君安财务总监;2013年11月22日起任国泰君安副总裁,财务总监。
陈忠义先生,中国国籍,无境外居留权,1970年10月出生,经济学学士,中级经济师,现任国泰君安证券资产托管部总经理。1993年参加工作,曾任职于君安证券清算部总经理助理、国泰君安证券营运中心副总经理、光大证券营运管理总部总经理等职。“全国金融五一劳动奖章”、“金融服务能手”称号获得者,中国证券业协会托管结算专业委员会副主任委员,带领团队设计的“直通式证券清算质量管理国际化标准平台”,被评为上海市2011年度金融创新奖二等奖。2014年2月起任国泰君安证券资产托管部总经理。
国泰君安证券总部设资产托管部,现有员工全部具备基金从业资格及本科以上学历,管理人员及业务骨干均具有多年基金、证券和银行的从业经验,从业人员囊括了经济师、会计师、注册会计师、律师、国际注册内部审计师等中高级专业技术职称及专业资格,专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各领域,是一支城实勤勉、积极进取、专业分布合理、职业技能优良的资产托管业人员队伍。
3、基金托管业务经营情况
我司获得证券投资基金托管资格以来,广泛开展了公募基金、基金专户、券商资管计划、私募基金等基金托管业务,与华夏、天弘、富国、银华、鹏华、华安、西部利得、富兰克林等多家基金公司及其子公司建立了托管合作关系,截止2015年4月30日托管各类基金480只,专业的服务和可靠的运营获得了管理人的一致认可。
(三)基金验资机构
名称:安永华明会计师事务所
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

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
富国中证煤炭指数分级证券投资基金2015年6月23日资产负债表如下:
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资产	本期末2015年6月23日
资产:	
银行存款	1,375,168,056.69
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	206,475.10
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产合计:	1,375,374,531.79
负债和所有者权益	
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	150,701.56
应付托管费	18,084.19
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	10,284.37
负债合计:	179,070.12
所有者权益:	
实收基金	1,374,939,470.73
未分配利润	255,990.94
所有者权益合计	1,375,195,461.67
负债与持有人权益总计:	1,375,374,531.79

八、基金投资组合

截至2015年6月23日,富国中证煤炭指数分级证券投资基金的投资组合如下:
(一)期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,375,168,056.69	99.98
6	其他资产	206,475.10	0.02
7	合计	1,375,374,531.79	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注:截至2015年6月23日,本基金未持有积极投资股票。
2、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
注:截至2015年6月23日,本基金未持有指数投资股票。
(三)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
1、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
注:截至2015年6月23日,本基金未持有指数投资股票。
2、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
注:截至2015年6月23日,本基金未持有积极投资股票。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:截至2015年6月23日,本基金本报告期末未持有债券。
(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
注:截至2015年6月23日,本基金未持有债券。
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注:截至2015年6月23日,本基金未持有资产支持证券。
(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:截至2015年6月23日,本基金未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1、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。
注:截至2015年6月23日,本基金未投资证券。
2、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。
注:截至2015年6月23日,本基金未投资证券。
3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	206,475.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,475.10

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:截至2015年6月23日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、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:截至2015年6月23日,本基金未持有指数投资股票。
(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:截至2015年6月23日,本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
(二)根据《基法法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会核准基金募集的文件
(二)《富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》
(三)《富国中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》
(四)《富国中证煤炭指数分级证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照
附件:基金合同内容摘要
一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利与义务
(一)基金份额持有人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让其持有的本基金上市交易份额,依法申请赎回富国煤炭份额,或在条件允许下以其他方式转让其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或召集基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:
(1)认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,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;
(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
(4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
(6)不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动;
(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(9)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
(二)基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
(1)依法募集资金;
(2)自基金合同生效之日起,根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产;
(3)依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;
(6)依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用;
(10)依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通;
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益进行法律诉讼程序或者实施其他法律行为;
(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等的业务规则;
(17)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、富国煤炭A份额和富国煤炭B份额的基金份额参考净值,确定富国煤炭份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;
(20)因过错给基金合同导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
(22)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由富国煤炭份额、富国煤炭A份额、富国煤炭B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。
本基金份额持有人大会不设日常机构。
2、召开事由
(1)当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有富国煤炭份额、富国煤炭A份额、富国煤炭B份额各自份额10%以上(含10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,应当召开基金份额持有人大会:
1)终止基金合同;
2)更换基金管理人;
3)更换基金托管人;
4)转换基金运作方式;
5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
6)变更基金类别;
7)本基金与其他基金的合并;
8)变更基金投资目标、范围或策略;
9)变更基金份额持有人大会程序;
10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
11)单独或合计持有富国煤炭份额、富国煤炭A份额、富国煤炭B份额各自份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
13)终止基金份额的上市,但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
14)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
(2)在不违背法律法规和基金合同约定,以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:
1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
2)法律法规要求增加的基金费用的收取;
3)在法律法规和基金合同规定的范围内调整富国煤炭份额的申购费率、调低赎回费率或不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式;
4)因拟的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改;
5)对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
6)经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;
7)按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
3、会议召集人及召集方式
(1)除法律法规规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。
(2)基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。
(3)基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。
(4)单独或合计持有富国煤炭份额、富国煤炭A份额、富国煤炭B份额各自份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定