

富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 便新)镝要)

富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称 "本基金")已于2017年7月10日获得中国证监会准予注册的批复(证 监许可【2017】1199号《关于准予宫国中证10年期国债交易型开放式 指数证券投资基金注册的批复》)。本基金的基金合同于2018年3月19 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

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;基金所投资的债券、衍生品等各种投 资工具的相关风险:由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动 性风险;本基金的特定风险等。本基金是债券基金,风险与收益高于货币 市场基金,低于股票基金和混合基金。本基金主要投资于标的指数成份 券及备选成份券,具有与标的指数相似的风险收益特征,在债券基金中 属于较低风险、较低收益的产品。

书、基金合同等信息披露文件。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。

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

基金的讨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9月19日,基金投资组合报告 和基金业绩表现截止至2018年6月30日(财务数据未经审计)。 第一部分 基金管理人

、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

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09月19日):

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

公司目前下设二十五个部门、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、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-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、OFII、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, 由子商务部, 负责基金由子商务发展趋势 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 结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8月31日,公司有员工438人,其中69%以上具有硕士

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 方由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 裴长汀先生,董事,研究生学历。现任海诵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 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Thome 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,

(一) 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

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。

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。

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 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

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

(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

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

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

王保合,博士,曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深300增 层 强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起任上证综指交易型开放式 指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接 基金基金经理,2013年9月起任宫国创业板指数分级证券投资基金基金 经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理, 2015年4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 国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起任富国中 证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投 资基金基金经理,2017年9月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资 基金基金经理,2018年3月起任富国中证10年期国债交易型开放式指数 证券投资基金基金经理:兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。

陈斯扬,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理 有限公司研究员、投资经理:2016年10月加入富国基金管理有限公司、 自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增 强债券型发起式证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基 金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2018年5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。具 有其全从业资格

投资 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

上述人员之间不存在近亲属关系。 第二部分 基金托管人

、基金托管人基本情况 名称: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

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:易会满 注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年

、主要人员情况

龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生 以上学历或高级技术职称 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内 首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密 科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和 专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融 资产管理机构企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市 场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有 包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、 企业年金基金、OFII资产、ODII资产、股权投资基金、证券公司集合资产 管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金 公司特定客户资产管理、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管 产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为 各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托 管证券投资基金874只。自2003年以来,中国工商银行连续十五年获得 香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金 融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务 品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

第三部分 相关服务机构 (一) 直销机构

场外直销机构: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

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

法定代表人:薛爱东 总经理:陈戈

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 传真:021-80126257、80126253

联系人:孙迪 公司网站:www.fullgoal.com.cn

(二) 场外代销机构 (1)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 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

(2)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

(3)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

联系人员: 林生迎

客服由话·95565.400-8888-111

注册地址: 广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼

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

办公地址:北京市朝阳区亭马桥路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 (6)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

联系人员: 邓颜

公司网站: www.chinastock.com.cn

办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

法人代表: 李梅

(8)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号

联系人员, 夏中苏 客服电话: 95562 公司网站: www.xyzq.com.cn

办公地址: 武汉新华路特8号长江证券大厦 法人代表: 尤习贵

联系人员:李良

公司网站: www.95579.com (10)安信证券股份有限公司

办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02

联系人员: 陈剑虹

公司网站: www.essence.com.cn (11)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

客服电话: 400-651-5988

(12)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

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

法人代表: 杨宝林 联系人员: 吴史紹

客服电话: 95548或400-889-5548

注册批批、湖南长沙芙蓉中路一段化侨国际大厦22_24层

客服电话: 95571

注册地址:上海市静安区新闸路1508号 办公地址: 上海市静安区新闸路1508号

客服由话: 95525

(15)华西证券股份有限公司

注册地址,四川省成都市陕西街239号 办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

公司网站: www.hx168.com.cn (16) 申万宏源西部证券有限公司

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

法人代表: 许建平 联系人员:李巍

客服电话: 4008-000-562

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)

法人代表: 俞洋 联系人员:杨莉娟

公司网站:http://www.cfsc.com.cn/

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

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

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人: 俞卫锋

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

联系电话:021-22288888 传真:021-22280000 联系人: 蔣燕生 经办注册会计师: 蒋燕华、石静筠

债券型证券投资基金 第六部分 投资目标

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

公司网站: www.newone.com.cn (4)广发证券股份有限公司

4301-4316房

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

(5)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

法人代表: 陈有安 客服电话: 4008-888-888

(7)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

客服电话: 95523或4008895523 公司网站: www.swhysc.com

办公地址: 浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层 法人代表: 兰荣

9)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

客服电话: 95579或4008-888-999

注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02

法人代表: 牛冠兴 客服电话: 400-800-1001

联系人员: 蔡霆 公司网站: www.bhzq.com

公司网站: www.zxzgsd.com.cn (13)方正证券股份有限公司

办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 法人代表:雷杰 联系人员: 徐锦福

公司网站: www.foundersc.com (14)光大证券股份有限公司

法人代表: 薛峰 联系人员:刘晨,李

公司网站:www.ebscn.com

联系人员:谢国梅 客服电话: 95584

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

国际大厦20楼2005室

公司网站: www.hvsec.com (17)华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)

客服电话:95323 (三) 场内销售机构 具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加或调整本基金销售机 构,并及时公告。 二、基金登记机构

法定代表人:周明

名称:上海市通力律师事务所 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 电话:(021)31358666

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 办公地址:上海市长乐路989号世纪商贸广场23楼 法定代表人:毛鞍宁

第四部分 基金名称 富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金 第五部分 基金类型

到复制标的指数、降低交易成本的目的。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份国债被限制投 资等情况,导致本基金无法获得对个别成份国债足够数量的投资时,基

方式进行替代。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.20%,年跟踪误差不

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,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。

3、国债期货的投资策略 本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的国 债期货合约进行交易,以降低债券仓位调整的交易成本,提高投资效率,

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

第七部分 基金投资方向

债等。为更好地实现投资目标,基金还可投资于国内依法发行上市的其

他国债、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及中

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

履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。

2、替代性策略

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

基金的投资组合比例为:本基金投资干标的指数成份债券和备选成

本基金是指数基金,主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以

本基金通过对标的指数中各成份国债的历史数据和流动性分析,选

取流动性较好的国债构建组合,对标的指数的久期等指标进行跟踪,达

金管理人将通过投资其他成份国债、非成份国债、成份券个券衍生品等

份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%,且不低于非现金基金资

第八部分 其余投资策略

本基金主要投资于标的指数的成份国债、备选成份国债、替代性国

第九部分 标的指数与基金业绩比较基准

本基金的标的指数是中证10年期国债指数。 中证10年期国债指数由中证指数有限公司编制并发布,样本券由发

从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

行期限为10年期、日剩余期限位于8.5到10年之间的国债组成。 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 ,则无需召开基金份额持有人大会,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。

本基金属于债券基金,风险与收益低于股票基金、混合基金,高干货 币市场基金,属于较低预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金主

若基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更。

第十部分 基金的风险收益特征

要投资于标的指数成份券及备选成份券,具有与标的指数相似的风险收

本基金业绩比较基准为中证10年期国债指数。

2、业绩比较基准

第十一部分 投资组合报告 报告期末基金资产组合情况 占基金总资产的比例(%)

作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。 注:上表中的债券投资项的金额包含可退替代款估值增值,而5.5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 细不含可退替代款估值增值。

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

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

(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

注: 本基金本报告期末未持有股票资产

序的前十名股票投资明细

资产支持证券投资明细

(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组 五、报告期末按债券品种分类的债券投资组合 债券品种 公允价值(元) 中:政策性金融债

注,上述债券投资包括可退基代款估值偿值 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

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

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 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

) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

权证投资明细 注:本基金本报告期末未持有权证。 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券

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

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

十一、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 本期国债期货投资政策 本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的国 债期货合约进行交易,以降低债券仓位调整的交易成本,提高投资效率,

(二)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

(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 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

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

(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 本基金本报告期末未持有股票资产。 (三) 其他资产构成

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

(四)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

(六) 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五人原因,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。

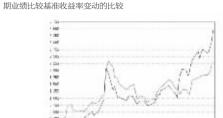
第十一部分 基金的业绩

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
	2018.03.19-2018.06. 30	3.38%	0.21%	2.34%	0.16%	1.04%	0.05%

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



注:1、截止日期为2018年6月30日。 2、本基金于2018年3月19日成立,自合同生效日起至本报告期末不

期末建仓期还未结束。 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;

足一年。本基金建仓期6个月,从2018年3月19日起至2018年9月18日,本

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 6. 基金份额持有人大会费用;

2、基金托管人的托管费;

3. 标的指数许可使用费:

8.基金的银行汇划费用: 9、基金合同生效后基金的证券、期货账户开户费用,银行账户维护

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 一、基金费用计提方法, 计提标准和支付方式

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。由基金管理人向基金托管人发送 基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后干次月首日起2个工作日内

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托 管费的计算方法如下: H=E×0.05% ÷ 当年天数

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送 基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从 基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可 抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工

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

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。

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 许可使用费的收取下限为每季度人民币25,000元,计费期间不足

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。

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

上述"(一)基金费用的种类"中第4-11项费用,根据有关法规及

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

1、本基金份额净值的计算,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。T日的基金份额净值 在当日收市后计算,并在T+1日公告。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。T日的申购赎回清单在当日上海证券交 易所开市前公告。 2、申购对价是指投资者申购基金份额时,应交付的现金替代、现金

3 投资老在由购戓赎回其全份额时 由购赎回代理券商可按照不紹 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。

未来,若市场情况发生变化,或相关业务规则发生变化,或实际情况

需要,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

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》 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"部分,增加了基金合同生效日、招募说明书内容的

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 况等内容讲行了更新。 3.在"第四部分 基金托管人"中,对基金托管人信息进行了更新。

信息,增加了本基金募集情况。 6、"第七部分 基金合同的生效"部分,删除了基金合同不能生效时 募集资金的处理方式的不适用信息,增加了基金合同生效日。

购、赎回的日期等内容。 9、"第十二部分 基金的投资"部分,增加了基金投资组合报告,内 容截止至2018年6月30日。

11、"第二十四部分 对基金份额持有人的服务"部分,对持有人服 务的主要内容进行了更新。

富国基金管理有限公司

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:本基金本报告期末未持有股票资产

2、期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

10、基金上市费及年费;

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

7、因基金的证券/期货交易或结算而产生的费用:

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0.25%年费率计提。管理 费的计算方法如下: H=E×0.25% ÷ 当年天数

从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不 可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个 工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

3、基金的指数许可使用费

H=E×年费率/当年天数

三、不列入基金费用的项目

五、与基金销售有关的费用

截止日期及相关财务数据的截止日期。

金财产中支付。

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

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,而无需召开基金份额持有人大会。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:

指数许可使用基点费每日计算,逐日累计。计算方法如下:

-季度的,根据实际天数按比例计算。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。

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

四. 基金税收 本基全运作过程中涉及的各纳税主体 其纳税♡条按国家税收法 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。

差额及其他对价或组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价 是指投资者赎回基金份额时,基金管理人应交付给赎回人的现金替代、 现金差额及其他对价或组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。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

值、申购赎回清单计算和公告时间或频率进行调整并提前公告。 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

4、在"第五部分 相关服务机构"中,对代销机构信息进行了更新。 5、在"第六部分基金的募集"部分,删除了基金募集相关的不适用

7、"第八部分 基金份额的折算"部分,对基金份额折算的方法进行 了更新,并增加了基金份额折算与变更登记部分, 8、"第十部分 基金份额的申购与赎回"部分,增加了本基金开放申

10、增加了"第十三部分 基金的业绩",内容截止至2018年6月30

12、增加了"第二十五部分 其他应披露事项",对本报告期内的其 他事项进行披露。