

(二〇一八年第二号)

十、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。

[illegible]

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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有存在违反法律法规之股票。

(二) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,260,233.86
2	应收交易款项	40,471,477.10
3	应收股利	-
4	应收利息	80,854.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,473,769.69
7	待摊费用	-
8	预付款项	-
9	合计	44,586,135.95

(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争议的股票情况说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在争议的股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分：

报告期内买入、卖出股票中市值占基金资产比例的分值和与公允价值存在差异。

报告期内买入股票的成本(含佣金)为 1,000,000.00 元,卖出股票的收入为 1,000,000.00 元。

(十二) 基金的投资

本基金管理人恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照基金合同约定运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证收益。基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者应了解,投资者在买入或卖出投资类资产前应仔细阅读基金的投资

日期	中国黄金主 力持仓(万两)	中国黄金主 力持仓占全 盘持仓	中国黄金主 力持仓占全 盘持仓	中国黄金主 力持仓占全 盘持仓	中国黄金主 力持仓占全 盘持仓	1-3	2-6
2006/06/01-2006/12/31	4425	10.07%	9.93%	10.06%	4.23%	-0.08%	
2007/01/01-2007/12/31	13168	1.50%	8.135%	10.06%	8.131%	0.07%	
2008/01/01-2008/12/31	18441	1.06%	8.229%	1.04%	10.20%	0.08%	
2009/01/01-2009/12/31	-18476	2.05%	-10.163%	1.98%	15.75%	0.06%	
2010/01/01-2010/12/31	59156	1.24%	10.22%	1.18%	10.03%	0.20%	
2011/01/01-2011/12/31	-5628	1.65%	-15.41%	1.09%	11.09%	0.04%	
2012/01/01-2012/12/31	-11176	1.24%	-14.65%	1.01%	12.1%	0.05%	
2013/01/01-2013/12/31	15915	1.30%	3.25%	0.96%	10.69%	0.04%	
2014/01/01-2014/12/31	9776	1.10%	-1.08%	1.01%	12.67%	0.04%	
2015/01/01-2015/12/31	16229	1.01%	26.66%	0.95%	10.141%	0.27%	
2016/01/01-2016/12/31	41405	2.08%	9.74%	1.7%	21.35%	0.07%	
2017/01/01-2017/12/31	8505	1.08%	7.76%	1.02%	15.04%	0.03%	
2018/01/01-2018/12/31	36228	1.10%	8.18%	1.12%	20.97%	0.02%	
2019/01/01-2019/12/31	-14505	1.06%	-14.43%	0.95%	16.68%	0.11%	
2020/01/01-2020/12/31	10000	1.06%	10.06%	0.97%	16.68%	0.11%	

中国黄金主仓,从美国金主仓的持仓倍数和持仓变动以及与美国金主仓的持仓倍数和持仓变动率实现比较

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5000万元的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算；未达成清算协议的，基金管理人可以申请人民法院指定接管人接管该基金资产。

七、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

1. 截止2018年9月30日

2. 本基金于2006年4月16日成立，截至06年6月，从2006年4月6日起至2006年10月14日，建仓期结束时各项资产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)因发行和运作而产生的基金信息披露费用；

4. (基金)的审计费和与基金相关的主持会计师、律师费；

5. (基金)的持有人大会费用；

6. (基金)的证券交易费用；

7. 按照有关规定和基金合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

本基金以上列第2项至第7项费用，如未列明为基金资产中列支，则应由基金管理人承担。

二、基金费用的计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理费

本基金的管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.5\%$ 为当年天数

H为每日应支付的基金管理费

前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令并由基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金资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)的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的0.6%的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.6\%$ 为当年天数

H为每日应支付的基金托管费
K为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3) 上述“一、基金费用的种类”中(3)-(7)项费用由基金托管人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
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,以及处理与基金运作的有关事项发生的费用等不列入基金费用。
其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

四、基金税收
本基金运作过程中的各类纳税主体,其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。

五、与基金销售有关的费用

1、申购费用
投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

(1) 申购费率：
投资者申购本基金时，申购费按照申购金额分段计费，投资者申购一天之内如有多笔申购，逐笔费率按申购时间，从基金申购费率表中按时间顺序中的养老金客户予以除此之外的其他投资者费率类别的费率予以具体费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率（含申购费）	前端申购费率
申购100元以下	1.50%	1.50%
100元（含）至1000元	1.20%	1.20%
1000元（含）以上	0.80%	0.80%

注：上述前端申购费率适用于通过本公司直销柜台申购的养老金客户外，其他选择前端收费模式的投资者，其申购费率如下：

申购金额（含申购费）	特定申购费率
申购100元以下	0.60%
100元（含）至1000元	0.40%
1000元（含）以上	0.20%

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台选择后端收费模式的本公司开放式基金的养老金客户。

1. 全国社会保障基金；

2. 可以投资基金的地方社会保障基金；

3. 企业年金单一计划以及集合计划；

4. 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；

5. 企业年金养老基金产品

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更新时或发布临时公告将入养老基金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

投资者选择红利自动再投资转成的份额不收取申购费用。

(2) 后端申购费

投资者选择交纳后端申购费时,按申购金额采用比例费率,费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内(含)	1.8%
1年—3年(含)	1.2%

3年(含)以上	0.50%
5年以上	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额,不再收取后端申购费用。

如果投资者选择交纳前端申购费用,则申购份额的计算方法如下:

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 前端申购费率)

前端申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

如果投资者选择交纳后端申购费用,则申购份额的计算方法如下:

申购份额 = 申购金额 / (1 + 申购费率) / 基金份额净值

2. 赎回费用

本基金根据投资者认(申)购方式采用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端申购费用时,对持续持有期少于7日的投资者收取赎回金额1.5%的赎回费,对持续持有期少于7日的投资者收取赎回金额0.5%的赎回费。

持有时间	赎回费率
少于7日	1.5%
7日(含)~2年以内(含)	0.6%
2年~3年(含)	0.3%
3年以上	0

赎回总额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值
赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率
赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用
如果投资者在认购/申购时选择交纳后端认购/申购费用, 则赎回金额的计算方法如下:
赎回总额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值
后端认购/申购费用 = 赎回份额 × 认购/申购日基金份额净值 × 后端认购/申购费率

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 后端认购申购费用 - 赎回费用

3、转换费用

(1) 前端转前端

基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成, 具体收取情况视每次转换时基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。其中: 转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取; 转入基金申购补差费是按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端申购的模式, 转出

基金所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的,补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差;转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的,补差费为零。

基金转换的计算公式如下:

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入金额=转出金额-转出基金赎回费

净转入金额=转入金额÷(1+申购补差费率)

申购补差费=转入金额-净转入金额

转入份额=净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值
注:转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金,且全部份额转出到账时,则净转入金额 $\geq$ 转出货币基金的当前累计未付收益。

(2)后端收费
后端收费模式基金发生转换时,其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成,其中申购补差费率根据基金转出日对应的申购费率与转入基金的基金份额净值计算,转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时,转换由转出基金承担转出申购费与补差费;其中申购补差费=转出基金当日之基金份额净值 $\times$ 转出基金后端申购费率 $\times$ 转出基金份额 $\times$ 补差费率。

1) 对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金,其后端收费模式下份额之间互相转换的公式如下:

$$\begin{aligned} \text{转出金额} &= \text{转出份额} \times \text{转换申请当日转出基金的基金份额净值} \\ \text{转出基金赎回费用} &= \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率} \\ \text{申购补差费用} &= (\text{转出金额} - \text{转出基金赎回费用}) \times \text{补差费率} \end{aligned}$$

转入份额=转入金额÷转出基金当日基金份额净值
转出份额=转出金额÷转出基金当日基金份额净值
2) 对于由本公司担任注册登记机构的基金, 前端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下:
转入金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值
转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率
申购补差费=(转出金额-转出基金赎回费用)×补差费率/(1+补差费率)
转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费

转入份额=转入金额/转换前转出基金的基金份额净值
注:转换份额的计算结果保留到小数点后2位。
如转出基金为货币基金,且全部份额转出账户时,则转出金额上转出货币基金的当前累计未付收益。
4.本基金申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的上限。在法律法规规定的限制内,基金管理人可
实际执行的申购、赎回费率,并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时,应最迟于可
开始实施前3个工作日至少在一种证监会指定的媒体上公告。
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

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》及其他有关法律法规的要求进行了更新,主要更新内容:

“一、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。

“二、基金管理人”部分,对基金管理人概况及主要人员任职进行了更新。

3、“四、基金托管人”部分,对基金托管人的基金托管业务经营情况进行了更新。

4、“五、相关服务机构”部分,对代销机构信息进行了更新。

5、“八、基金份额的申购与赎回”部分,对代销机构的代销网点、最低申购金额限制进行了更新。

6、“九、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2018年9月30日。

7、“十、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2018年9月30日。

8、“二十一、对基金份额持有人的服务”部分,对部分服务内容进行了更新。

9、“二十一、对基金份额持有人的服务”部分,对基金份额持有人的投诉处理进行了更新。

富国基金管理有限公司
2018年11月17日