# 富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

（二〇一九年第一号）

重要提示

富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已于2018年8月29日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2018】1394号《关于准予富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》）。本基金的基金合同于2018年9月27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断或者保证。

本基金投资中的风险包括：因经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而形成的市场风险；基金在交易过程发生交收违约或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息导致的信用风险；债券收益率曲线变动风险；再投资风险；管理风险；操作或技术风险；合规性风险；流动性风险；本基金的特有风险；基金财产投资运营过程中的增值税等税负风险；本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。本基金属于债券型基金，风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。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。

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。

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。

本招募说明书所载内容截止至2019年3月27日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2018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2019年03月14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；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2月28日，公司有员工446人，其中68.8%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(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

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。

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

（1）现任基金经理

武磊，博士，2011年7月至2012年3月任华泰联合证券有限责任公司研究员；2012年4月至2013年7月任华泰证券股份有限公司投资经理；2013年8月至2014年10月任国泰君安证券股份有限公司资本市场部董事；2014年11月至2016年12月任上海国泰君安证券资产管理有限公司投资经理；2016年12月加入富国基金管理有限公司，2017年3月起任富国产业债债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起任富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018年7月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）（原：富国新天锋定期开放债券型证券投资基金）基金经理；2018年9月起任富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年3月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理。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、基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：（010）63636363

传真：（010）63639132

网址：www.cebbank.com

二、投资与托管业务部部门及主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生，曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国华融资产管理公司党委委员、副总裁，中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长，中国工商银行党委委员、副行长，中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事；中国投资有限责任公司党委副书记、监事长；招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长，招商银行股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席、招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长，中国光大集团有限公司董事长，中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生，经济学博士，高级经济师。

行长葛海蛟先生，曾任中国农业银行辽宁省分行国际业务部总经理助理、副总经理、总经理，中国农业银行辽宁省辽阳市分行党委书记、行长，中国农业银行大连市分行党委委员、副行长，中国农业银行新加坡分行总经理，中国农业银行国际业务部副总经理(部门总经理级)，中国农业银行黑龙江省分行党委副书记、党委书记、行长兼任悉尼分行海外高管，黑龙江省第十二届人大代表。曾兼任中国光大实业（集团）有限责任公司董事长，光大证券股份有限公司董事，中国光大集团股份公司上海总部主任，中国光大集团股份公司文旅健康事业部总经理。现任中国光大银行股份有限公司党委副书记、行长，中国光大集团股份公司党委委员。南京农业大学农业经济管理专业博士研究生，管理学博士，高级经济师。

张博先生，曾任中国光大银行厦门分行副行长，西安分行行长，乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长，青岛分行行长，光大消费金融公司筹备组组长。曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理（总经理级），负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

三、证券投资基金托管情况

截至2018年12月31日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共128只证券投资基金，托管基金资产规模3091.02亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

## 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

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

本基金暂未通过代销机构销售。

（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，并及时公告。

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

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

富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金

## 第五部分 基金类型

债券型证券投资基金

## 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。

## 第七部分 基金投资方向

本基金主要投资于标的指数的成份国开债、备选成份国开债、其他国开债等。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国债、政策性金融债、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：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。

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%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

1、优化抽样复制策略

本基金通过对标的指数中各成份国开债的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的国开债构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

2、替代性策略

对于市场流动性不足、因法律法规原因个别成份国开债被限制投资等情况，本基金无法获得对个别成份国开债足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份国开债、非成份国开债、成份国开债衍生品等方式进行替代。

3、其他债券投资策略

为了在一定程度上弥补基金费用，基金管理人还可以在控制风险的前提下，使用其他投资策略。例如，基金管理人可以利用银行间市场与交易所市场，或债券一、二级市场间的套利机会进行跨市场套利；还可以使用事件驱动策略，即通过分析重大事件发生对投资标的定价的影响而进行套利；也可以使用公允价值策略，即通过对债券市场价格与模型价格偏离度的研究，采取相应的增/减仓操作；或运用杠杆原理进行回购交易等。

4、国债期货投资策略

本基金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，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

## 第九部分 基金业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中债-1-3年国开行债券指数。

中债-1-3年国开行债券指数隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包括国家开发银行在境内公开发行且上市流通的待偿期0.5年至3年（包含0.5年和3年）的政策性银行债。

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系列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、指数更名等），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。

2、业绩比较基准

中债-1-3年国开行债券指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%

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，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序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

本基金属于债券型基金，风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。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。

## 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 1,993,779,940.20 | 89.85 |
| | 其中：债券 | 1,993,779,940.20 | 89.85 |
| | 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 | 170,000,375.00 | 7.66 |
| | 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 | 9,030,116.91 | 0.41 |
| 7 | 其他资产 | 46,110,730.58 | 2.08 |
| 8 | 合计 | 2,218,921,162.69 | 100.00 |

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

（三）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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,993,779,940.20 | 89.88 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,993,779,940.20 | 89.88 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,993,779,940.20 | 89.88 |

（五）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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 170205 | 17国开05 | 4,600,000.00 | 464,692,000.00 | 20.95 |
| 2 | 160206 | 16国开06 | 3,500,000.00 | 347,550,000.00 | 15.67 |
| 3 | 170209 | 17国开09 | 3,400,000.00 | 345,270,000.00 | 15.56 |
| 4 | 180202 | 18国开02 | 2,300,000.00 | 233,956,000.00 | 10.55 |
| 5 | 180212 | 18国开12 | 1,100,000.00 | 111,210,000.00 | 5.01 |

（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。

（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。

（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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、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。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、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。

3、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。

（十一）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。

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。

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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

3、其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 3,674.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 46,107,055.94 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 46,110,730.58 |

4、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。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

6、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

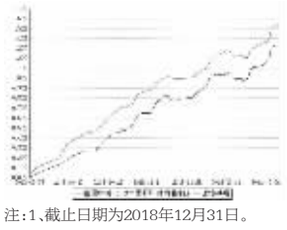
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2018.09.27-2018.12.31 | 1.34% | 0.03% | 1.54% | 0.03% | -0.20% | 0.00% |

（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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2018.09.27-2018.12.31 | 1.31% | 0.03% | 1.54% | 0.03% | -0.23% | 0.00% |

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

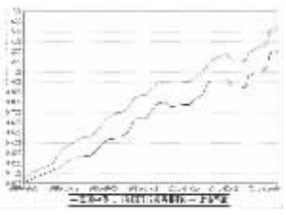
（1）自基金合同生效以来富国中债-1-3年国开行债券指数A基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2018年12月31日。

2、本基金于2018年9月27日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2018年9月27日起至2019年3月26日，本期末建仓期还未结束。

（2）自基金合同生效以来富国中债-1-3年国开行债券指数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2018年12月31日。

2、本基金于2018年9月27日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2018年9月27日起至2019年3月26日，本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；

2、基金托管人的托管费；

3、指数许可使用费；

4、C类份额的销售服务费；

5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

6、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；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金的证券、期货交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、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；

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0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。由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首日起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、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0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。由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首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。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

本基金作为指数基金，需根据与中债金融估值中心有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中债金融估值中心有限公司支付指数许可使用费。指数许可使用费费率水平根据基金资产平均净值分档设置。

当季基金资产平均净值=本基金当季存续的每日资产净值之和/当季本基金存续的自然日天数

当季基金资产平均净值对应的各档次费率水平如下：

| 季度基金资产平均净值 | 季度费率 | 年度费率 |
|---|---|---|
| 10亿人民币以下（不包括10亿人民币整） | 1 bp | 4 bp |
| 10亿-20亿人民币之间（包括10亿人民币整，不包括20亿人民币整） | 0.75 bp | 3 bp |
| 超过20亿人民币（包括20亿人民币整） | 0.625 bp | 2.5 bp |

其中：1bp=基本点数=1/10,000=0.01%。

每季度按照当季的基金资产平均净值选取适用的费率，计算公式如下：

当季度基金资产平均净值在10亿元以下（不包括10亿元），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.04%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

H=E×0.04%÷当年天数

当季度基金资产平均净值在10亿元至20亿元（包括10亿元，不包括20亿元），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

H=E×0.03%÷当年天数

当季度基金资产平均净值在20亿元以上（包括20亿元），指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.025%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

H=E×0.025%÷当年天数

H为每日应付的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

指数许可使用费自基金合同生效之日起从基金资产中计提，每季度支付一次，由基金管理人向