

# 富国兴利增强债券型发起式证券投资基金招募说明书 (更新) (摘要)

(二〇二〇年第一号)

## 重要提示

富国兴利增强债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会2017年8月11日证监许可[2017]1483号文注册。本基金的基金合同于2017年9月20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。中国证监会不对本基金的估值和净值构成任何实质性的判断或保证。

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。投资有风险,投资者认购(申购)本基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,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(申)购基金的数量、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括: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、大量赎回或赎回导致的流动性风险、基金管理人及投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。本基金的投资范围包括中小企业私募债券,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发生流动性风险时,受市场流动性影响,本基金可能无法及时出售持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金的特有风险详见招募说明书“风险提示”章节。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,由投资者自行承担。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。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成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、勤勉谨慎的原则管理和运用基金财产,但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。

本招募说明书中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  
电话:(021)120361816  
传真:(021)12036188  
联系人:赵殿  
注册资本:5.2亿元人民币  
股权结构(截止于2020年01月01日):

| 股票名称         | 出资比例   |
|--------------|--------|
| 海通证券股份有限公司   | 27.77% |
| 申万宏源证券有限公司   | 27.77% |
| 光大证券股份有限公司   | 27.77% |
| 山东国际信托投资有限公司 | 16.67% |

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管理等工作,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,防范和化解合规风险,合规与道德风险。

公司目前下设二十八部门、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、固定收益专户组、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、养老金业务、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决策建议、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基金投资运作和资产、产品管理;策略类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策略业务;海外权益投资部:负责公司在国际境外(含香港)的权益投资的管理;权益专户投资部:负责社保、保险、FOF、一对一、一对多等非公募基金类专户的投资管理;养老金投资部:负责养老金(企业年金、职业年金、基本养老保险)及养老金专户等产品)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:负责机构股、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、同业资产、机构管理、私人银行等部门;非银行销售与服务、机构服务部:负责协调三个销售渠道部门对接专业资源,实现项目落地,提供专业支持和客户管理,对公司已有机客客户进行持续专业服务;零售业务部:管理零售营销中心、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、负责公募基金的销售业务;营销管理部:负责营销计划的制定和落实、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,制定客户服务发展策略,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,支持产品决策;电子商务部:负责基金电子商务发展趋势分析,拟定并落地公司电子商务发展策略和实施规则,有效推进公司电子商务业务;战略与产品发展部:负责规划、维护公募基金产品,协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略;基金数据监测、分析和评价,为公司投资决策、品牌宣传、合规发展、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、合规报告、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:执行公司风险管理政策,牵头负责公司风险管理治理结构与流程,组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对,对公司旗下各投资组合合规监测等;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计核算;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;富国资产管理(香港)有限公司:证券交易、就证券提供意见和建议并履行管理;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。

截至2019年8月31日,公司有员工466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产品部研究员、湖北营业部总经理助理、总经理,曾任中国证券公司湖北营业部总经理,浙江证券总部总经理、经纪总部总经理,华信信托投资有限公司总经理,华英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月任富国基金价值证券投资基金基金经理。

麦陈婉芬女士(Constance Mak),董事,文学及工商管理学士,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),加国投资管理董事和加拿大中文媒体顾问团队成员。历任St. Margaret’s College教师,加拿大毕马威(KPMG)会计师事务所的合伙人。

万荣义先生,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总审计师、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室主任,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(深圳城市支行)会计处副处长,中国人民银行深圳城市支行非银行金融机构处处长,中国人民银行监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行管理处处长、中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、计划财务部管理本部副经理/经理,海通国际证券股份有限公司财务财务官、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分行。

蔡洪先生,董事,本科学历,经济师。现任广东国际信托投资有限公司拥有业务管理总部经理。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,拥有业务管理部副总经理。

何家荣先生,董事,硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务部总部总经理。历任人民银行上海分行总办处主任计划信贷科、信贷科科员;工商银行徐汇区办事处建国西路分理处支库部代主任、党支部书记兼分理处副主任(主持工作);上海申银证券公司上海分公司支行会计处科长,中国人民银行深圳城市支行非银行金融机构处处长,中国人民银行监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行管理处处长、中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、计划财务部管理本部副经理/经理,海通国际证券股份有限公司财务财务官、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分行。

蔡洪先生,董事,本科学历,经济师。现任广东国际信托投资有限公司拥有业务管理总部经理。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,拥有业务管理部副总经理。

何家荣先生,董事,硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务部总部总经理。历任人民银行上海分行总办处主任计划信贷科、信贷科科员;工商银行徐汇区办事处建国西路分理处支库部代主任、党支部书记兼分理处副主任(主持工作);上海申银证券公司上海分公司支行会计处科长,中国人民银行深圳城市支行非银行金融机构处处长,中国人民银行监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行管理处处长、中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、计划财务部管理本部副经理/经理,海通国际证券股份有限公司财务财务官、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分行。

蔡洪先生,董事,本科学历,经济师。现任广东国际信托投资有限公司拥有业务管理总部经理。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

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业务经理,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部副经理。

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。

张璐燕女士,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管理总监助理,通明证券交易风险管理部副总裁兼主管,华伟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。

何旭先生,监事,研究生学历。现任海通证券股份有限公司稽核核部副总经理。历任海通证券股份有限公司稽核核二部部副经理、二部经理、稽核核部总经理助理等。

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。历任上海金融工程研究院部门经理、友联战略管理中心中二部经理,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。

杨晓琴女士,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、营销规划经理、销售支持经理、高级销售支持经理。

沈婧女士,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大学教师、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

赵晓斌女士,研究生学历,硕士学位。曾任轩于海通证券股份有限公司国际业务部、上海盛宣(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。曾任进出口商品检验局秘书,曾江进出口商品检验局办事处负责人,厦门证券业务部经理;1998年10月参加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、部门经理、部门

副经理。曾兼任,现任富国基金管理有限公司副总经理兼首席信息官。

沈婕女士,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、副营销总监;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。

李美薇女士,研究生学历,博士学位,高级经济师。曾任国家教委外派资助办公室项目官员,摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCI BARRA)BARR数据库风险评估部高级研究员,巴克莱国际投资管理有限公司(Barclays Global Investors)中国中产主动股票投资总监、高级基金投资及高级研究员;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。

朱少卿先生,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  
陈昕,硕士,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;自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月起担任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国生和增强债券型发起式证券投资基金、富国中短10年期期限债券型开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起担任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

2)历任基金经理  
陈昕,硕士,自2016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;自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月起担任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国生和增强债券型发起式证券投资基金、富国中短10年期期限债券型开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起担任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

3)黄纪亮自2017年9月至2019年8月担任本基金基金经理;

2)王乐东自2017年10月至2020年1月担任本基金基金经理。

### (六) 投资决策委员会成员

公司投资决策委员会:总经理陈戈,分管副经理朱少卿,分管副总经理李美薇

### (七) 其他

上述人员之间不存在近亲关系。

## 第二部分 基金托管人

一、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56号  
成立时间:1984年1月1日  
法定代表人:陈四清  
注册资本:人民币35,640,625,708.91万元  
联系电话:010-61065799  
联系人:郭明

截至2019年9月,中国工商银行资产托管部共有员工208人,平均年龄33岁,96%以上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,严格履行托管人职责,为海内外广大基金托管人提供安全、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、最成熟的托管产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会养老保险基金、基本养老保险、企业年金基金、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券投资基金等资产的管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金专户特定客户资产管理服务、QDII专户资产、ESCROW等7类专户的托管产品体系,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2019年9月,中国工商银行共托管证券投资基金1006只。自2003年以来,中国工商银行连续六年获得新华网《亚洲货币》、英国《全球财资》、香港《财资》、美国《环球财经》、内地《证券时报》、《上海证券报》等海内外权威财经媒体评选的60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、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  
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

客户服务电话:全国客服热线:9610686,4008890688(全国统一,免长途话费)  
传真:021-20613717  
联系人:孙迪  
公司网站:www.fundoo.com.cn

### (二) 代销机构

(1) 海银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:唐湘怡  
客服电话:96367  
公司网站:www.18.cn

(2) 北京百度盈鑫金融销售有限公司  
注册地址:北京市海淀区上地十街130号1幢1层101  
办公地址:北京市海淀区上地信息路9号科爱科技大厦

法人代表:张旭阳  
联系人:孙博超  
客服电话:196665-4  
公司网站:www.baidufund.com

(3) 深圳众基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区深南东路6047号发展银行大厦25楼J、J单元  
办公地址:深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼J、J单元

法人代表:薛峰  
联系人:李海婧  
客服电话:4006-788-887  
公司网站:www.zjfund.cn

(4) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海市徐汇区龙山路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:潘世华  
客服电话:400-1818-188  
公司网站:www.1234567.com.cn

(5) 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2号3号楼41号  
办公地址:上海市浦东新区南118号鄂尔多斯大厦903-906室

法人代表:杨文斌  
联系人:张茹  
客服电话:4007-009-666  
公司网站:www.ehowbuy.com

(6) 海创(杭州)基金销售有限公司  
注册地址:杭州市文二西路1号西溪网谷二号楼202室  
办公地址:上海市徐汇区上海大道368号恒生大厦12楼

法人代表:陈柏青  
联系人:张裕  
客服电话:4000-766-123  
公司网站:www.huilianfund.com

(7) 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紫荆广场电子商务产业园2号楼2楼

法人代表:凌顺平  
联系人:吴强  
客服电话:4008-773-772  
公司网站:www.5ifund.com

(8) 珠海盈米基金销售有限公司  
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491  
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法人代表:肖雯  
联系人:黄敏娥  
客服电话:020-89629066  
公司网站:www.yingmi.cn

(9) 奕丰基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区西湾一路1号A栋201室(入驻深圳)

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:TWO WEE HOWE  
联系人:尹晶磊  
客服电话:400-684-0600  
公司网站:htp://www.ifastps.com.cn

(10) 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:徐广  
客服电话:96118  
公司网站:htp://fund.jd.com/

(11) 北京康惠基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环东三环19号院2号楼2层2027  
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:戚晓强  
客服电话:4000-618-518  
公司网站:danjuanapp.com

(三) 其他  
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  
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、审计会计师事务所(特殊普通合伙)  
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E座东塔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:毛贻宁  
联系电话:021-22288888  
传真:021-22289000  
联系人:徐皓

经办注册会计师:蒋燕飞、石静珂

第五部分 基金名称  
富国兴利增强债券型发起式证券投资基金

基金类型 基金简称  
债券型证券投资基金

第六部分 投资目标  
本基金在追求本金安全、保持资产流动性的以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。

第七部分 基金投资方向  
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券)、资产支持证券、银行回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股票(包括中小创、创业板以及其他经中国证监会核准上市

的股票)、权证及法律法规允许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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入本基金投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证的比例不超过基金资产的20%。本基金持有现金或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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资组合的投资比例。

第八部分 基金投资策略  
本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理,在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上,通过合理配置权益类资产对高风险的企业债、可转债、资产支持证券,以及风险收益特征优异的可转债、可分离资产、分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等品种,加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资,灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值分析等策略,在保证基金流动性的前提下,积极把握固定收益证券市场中投资机会,获取各类债券的超额投资收益。

1、资产配置策略  
(1) 整体资产配置策略  
本基金在基金合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置,在对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险溢价和有关法律法规等因素的综合分析,预测各类资产在长、中、短期收益的变化情况,进而确定在固定收益类资产、权益类资产以及货币资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的投资策略。

(2) 类属资产配置策略  
不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异,有必要将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同的市场上进行配置,以求取收益性、流动性和信用风险补偿的最佳平衡点。在整体资产配置策略的指导下,本基金根据债券资产的风险来源、收益率水平、利息税优势以及市场流动性等因素,将市场部分为普通债券(含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等)、附权债券(可转换公司债券、各类附权债券等)、资产证券化产品、金融创新产品(类金融衍生工具等)四个子市场,采取积极投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优投资比例。

(3) 期限资产配置策略  
在明确组合资产配置上,首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合;其次,根据个别债券的收益率到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理与剩余期限的配比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合;最后,根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间),决定投资总量。

2、债券投资策略  
(1) 普通债券投资策略  
本基金在普通债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制,期限结构调整、信用风险调整,跨市场套利和适时投资比例调整;同时根据利率变动,债券收益率曲线以及各种债券品种的相对价值进行预测,相机进行,调整配置。

(2) 久期控制是通过对宏观经济走势、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。

(3) 期限结构配置是在确定整体久期后,针对收益率曲线特征进行确定合理的组合期限结构,包括采用梯形策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(4) 信用风险控制是基金管理人充分利用现有行业与公司研究力量,根据发债主体的经营情况和现金流等情况对其信用风险进行评估,以此作为品种选择的基本依据。

(5) 跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特征,构建和调整债券投资组合,提高投资收益,实现跨市场套利。

(6) 相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的债券,减持相对高估、价格将下降的债券。

(2) 附权债券投资策略  
附权债券指对债券发行主体某种权利,或者赋予债券投资者某种期权,从而使债券发行主体或投资者有了某种灵活的择权余地,从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性,也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或选择权特征的债券等。

(3) 可转换公司债券投资策略  
可转换公司债券不同于一般的公司债券,其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利,因此其理论价值应当等于作为普通债券的债券价值加上转股和回售的期权价值,是一种既具有债性、又具有股性的混合价值产品,具有低购价格下风险,分享票面价格上涨收益的特点。

可转换公司债券最大的优点在于,可以用较小的本金损失,换取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布,买入低转股溢价率的债券,并持有较长的投资期,只要在可转换公司债券的存续期内,发行转债的公司股票价格上涨,则投资收益可以获得超额收益。

可转换公司债券可以按照其投资价值分为上市公司股票,因此在日常交易过程中可能出现其公允价值与市场价格发生较大偏离的情况。

(4) 可转换公司债券可以转换为股票并在上市交易过程中,进行密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系,恰当的择时时机,进行套利。

(5) 其它附权债券投资策略  
本基金利用债券市场收益数据、运用利率模型,计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差(OAS),作为此类债券投资价值的主要依据。

分离交易可转换公司债券,是认股权证和公司债券的组合产品,该种产品中的公司债券和认股权证可以在上市时分别交易,即发行时组合在一起,而上市后可自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因组合分离后可转换公司债券所获得的认股权证自可交易之日起30个交易日内全部卖出。分离交易可转换公司债券上市后的认股权证由公司债的转股期限前普通债券投资策略进行管理。

(3) 中小企业私募债券的投资策略  
本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面

展开。久期控制方面,根据宏观经济运行状况的分析和预判,灵活调整组合的久期。信用风险控制方面,对单个信用资质进行详尽的分析,对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量,并尽可能地利用小信用风险暴露。流动性控制方面,要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

3、资产证券化产品投资策略  
证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产,通过一定的结构化安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产证券化产品。