

# B048 信息披露 Disclosure

## 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)

(二〇二〇年第二期)

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,高于货币型基金。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	--	--
2	固定收益投资	5,543,494,389.62	83.13
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	996,475,466.00	14.94
6	银行存款和结算备付金合计	11,410,043.76	0.17
7	其他资产	117,304,037.18	1.76
8	合计	6,668,883,936.55	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末持有境内股票资产。  
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	5,543,494,389.62	83.21
4	其中:政策性金融债	5,543,494,389.62	83.21
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	5,543,494,389.62	83.21

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	100206	16国开06	14,400,000.00	1,446,472,000.00	21.70
2	180212	18国开12	10,300,000.00	1,046,759,000.00	15.70
3	180217	18国开07	6,300,000.00	532,622,000.00	8.01
4	180238	18国开08	4,500,000.00	468,100,000.00	6.88
5	180232	18国开02	4,200,000.00	421,594,000.00	6.33

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

(一) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

(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、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,以降低持仓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,随着市场的变化和基金管理的需要,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。

(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持有国债期货。

(三) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	15,564.68
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	117,288,427.60
5	应收申购款	--
6	其他应收款	--
7	预收款项	--
8	其他	--
9	合计	117,304,037.18

(一) 直接申购

注:本基金本报告期末未持有基金份额。

(二) 间接申购

注:本基金本报告期末未持有基金份额。

(三) 其他申购构成

注:本基金本报告期末未持有基金份额。

(四) 报告期内持有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流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

(六) 报告期末持有的其他文字描述部分。

因内容冗大原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项可能存在尾差。

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预示其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、本基金历史各期末阶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股

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
2018/02/27-2018/12/31	1.34%	0.03%	1.54%	0.03%	-0.20%	0.00%
2019/01/01-2019/12/31	3.69%	0.03%	3.80%	0.03%	-0.11%	0.00%
2018/02/27-2019/12/31	5.08%	0.03%	5.40%	0.03%	-0.32%	0.00%

(2) C股

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
2018/02/27-2018/12/31	1.21%	0.02%	1.54%	0.03%	-0.22%	0.00%
2019/01/01-2019/12/31	3.56%	0.03%	3.80%	0.03%	-0.24%	0.00%
2018/02/27-2019/12/31	4.91%	0.03%	5.40%	0.03%	-0.49%	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



注:1、截止日期为2019年12月31日。  
2、本基金于2018年07月27日成立,建仓6个月,从2018年07月27日起至2019年3月26日,建仓期结束时各项资产配置均符合基金合同约定。

(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2019年12月31日。  
2、本基金于2018年07月27日成立,建仓6个月,从2018年07月27日起至2019年3月26日,建仓期结束时各项资产配置均符合基金合同约定。

(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2019年12月31日。  
2、本基金于2018年07月27日成立,建仓6个月,从2018年07月27日起至2019年3月26日,建仓期结束时各项资产配置均符合基金合同约定。

第三部分 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事务所、律师事务所、审计机构和仲裁费;

7.基金份额持有人大会费用;

8.基金的债券、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证券的申购清算系统用户费用、银行网银维护费用;

11.按照国家有关规定基金管理人履行信息披露义务的费用,以及在基金资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2.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H = E × 2.0% × 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人向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、休息日等,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.06%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H = E × 0.06% × 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人向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、休息日等,支付日期顺延。

3.指数许可使用费

本基金按照指数许可使用协议约定的标准支付指数许可使用费,具体计费方式和费率按照该协议约定执行。

4.C类份额的销售服务费

C类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.10% × 当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,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向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个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

富国基金管理有限公司关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金募集规模上限的公告

富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定,在富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:006368)(以下简称“本基金”)认购期间,通过本公司网上直销系统(网上交易、APP、微理财、H5)认购本基金的,不参加富国富源包贷货币市场基金赎回转入认购本基金的优惠活动中使用借记卡认购本基金的认购费率优惠。具体认购费率请参考本基金的基金发售公告与招募说明书。

特此公告。

富国基金管理有限公司关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金不参加网上直销系统认购费率优惠活动的公告

富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定,在富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:006368)(以下简称“本基金”)认购期间,通过本公司网上直销系统(网上交易、APP、微理财、H5)认购本基金的,不参加富国富源包贷货币市场基金赎回转入认购本基金的优惠活动中使用借记卡认购本基金的认购费率优惠。具体认购费率请参考本基金的基金发售公告与招募说明书。

特此公告。

富国基金管理有限公司关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金募集规模上限的公告

富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定,在富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:006368)(以下简称“本基金”)认购期间,通过本公司网上直销系统(网上交易、APP、微理财、H5)认购本基金的,不参加富国富源包贷货币市场基金赎回转入认购本基金的优惠活动中使用借记卡认购本基金的认购费率优惠。具体认购费率请参考本基金的基金发售公告与招募说明书。

特此公告。

朱少耀先生,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基金经理。

(五) 本基金基金经理

(1) 现任基金经理

1) 武洪,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月起任富国产业债指数证券投资基金基金经理,2017年3月至2019年11月任富国目标红利一年定期纯债指数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月起任富国鑫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月起任富国新天定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理,2018年7月至2019年11月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理