

富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金管理说明书(更新)摘要)

(二〇二〇年第二号)

重要提示

富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金管理人(以下简称“本基金”)已于2019年4月22日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可[2019]808号《关于准予富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金管理人注册的批复》)。

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申请的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景等做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险。基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。

同时由于本基金是交易型开放式基金,特定风险还包括:标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、现金流替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、资产支持证券的投资风险、金融衍生品投资风险等。本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资者申购的基金份额当日可卖出,投资者赎回获得的股票当日可卖出。

投资者投资本基金时需具有上海证券账户,但需注意,使用上海证券交易所资金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要使用中证军工龙头指数成份股或备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户;如投资者需要使用中证军工龙头指数成份股或备选成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则还应开立深圳证券交易所A股账户。

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、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。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。

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

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

成立日期:1999年4月13日

法定代表人:裴长江

总经理:陈戈

电话:(021)20361818

联系人:赵瑛

注册资本:5.2亿元人民币

股权结构(截至2019年3月31日):

股东名称	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%
加拿大蒙特利尔银行	27.77%
山东省国际信托有限公司	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POF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)及各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、客户、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、西南营销中心、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,拟定并完善公司电子商务发展战略和实施细则,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、合规稽查、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;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3月31日,公司有员工443人,其中68.9%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长,中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处副处长,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门经理/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分子书记、党支部书记兼分理处副主任(主持工作);上海市申银证券公司财会部员工;上海市申银证券公司浦东公司财会部财会部负责人;上海市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部管理总部部门经理、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。历任上海市房改局政策处主任;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科长、办公室副主任、办公室主任、副局长、副局长,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,集团公司副经理;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师事务所的前身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。

李明光先生,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

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

三、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理与内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务,经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金个人账户(RQFII、RQDII)、企业年金等产品在内的托管业务体系,是国内目前唯一托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和服务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得“全球托管人”“中国最佳托管银行”,4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”,连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

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稽核法律部经理,山东省鲁源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。

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。

杨琴女士,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。

沈蔚慧女士,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) 监督长

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。

杨琴女士,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。

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监。

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,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。

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,量化与海外市场经理、公司总经理助理,现任富国基金管理有限公司副总经理。

朱少醒先生,研究生学历,博士学位。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,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。

王乐乐,博士,自2010年6月至2011年11月在上海证券有限责任公司任研究员;自2011年11月至2012年6月在华泰联合证券有限责任公司任研究员;自2012年7月至2015年4月在华泰联合证券有限公司任研究员、创新规划团队负责人;自2015年5月加入富国基金管理有限公司,2015年8月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理,2016年10月至2018年7月任富国全球债券指数分级证券投资基金基金经理,2017年10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,2018年11月起任富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理,2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年12月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年3月起任富国恒生中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理;兼任量化投资部量化投资总监。具有基金从业资格。

(五) 本基金基金经理

王乐乐,博士,自2010年6月至2011年11月在上海证券有限责任公司任研究员;自2011年11月至2012年6月在华泰联合证券有限责任公司任研究员;自2012年7月至2015年4月在华泰联合证券有限公司任研究员、创新规划团队负责人;自2015年5月加入富国基金管理有限公司,2015年8月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理,2016年10月至2018年7月任富国全球债券指数分级证券投资基金基金经理,2017年10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,2018年11月起任富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理,2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年12月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年3月起任富国恒生中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理;兼任量化投资部量化投资总监。具有基金从业资格。

牛志冬,硕士,自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员;自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理;自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司基金经理;自2015年5月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金基金经理,2017年7月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金基金经理,2017年7月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金基金经理,2017年11月至2018年12月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金,2018年11月起任富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理,2019年3月起任富国恒生中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理;兼任量化投资部量化投资总监。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