

## (上接B076版)

联系人：仲秋月  
客服电话：400-817-5666  
公司网站：[www.amctfortune.com](http://www.amctfortune.com)

(三)场内销售机构  
本基金办理场内销售业务的机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。

(四)其他  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加或调整本基金代销机构,并在基金管理人网站公示。

二、基金管理人  
名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京市西城区太平桥大街 17 号  
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
法定代表人：周明  
电话：(010)50038782  
传真：(010)50038991  
联系人：赵亦清

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：孙睿  
经办律师：黎明、孙睿

四、审计企业财产的会计师事务所  
名称：安永华明会计师事务所  
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  
法定代表人：葛明  
联系电话：021-22288888  
传真：021-22280000  
联系人：徐艳  
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

第四部分 基金名称  
富国中证中国企业改革指数分级证券投资基金  
第五部分 基金类型  
股票型

第六部分 基金份额的分级  
本基金的基金份额包括富国中证中国企业改革指数分级证券投资基金的基础份额(即“富国国企改革A份额”),富国中证中国企业改革指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“富国国企改革A份额”)与富国中证中国企业改革指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“富国国企改革B份额”),其中,富国国企改革A份额、富国国企改革B份额的基金份额比例始终保持1:1的比例不变。

第七部分 基金份额的配对转换  
本基金合同生效后,在富国国企改革A份额、富国国企改革B份额的存续期内,基金管理人将为基金份额持有人办理配对转换业务。

配对转换是指本基金的富国国企改革份额与富国国企改革A份额、富国国企改革B份额之间的配对转换,包括以下两种方式的配对转换:

1. 分拆  
分拆是指基金份额持有人将其持有的每2份富国国企改革份额的场内份额申请转换为1份富国国企改革A份额与1份富国国企改革B份额的行为。

2. 合并  
合并指基金份额持有人将其持有的每1份富国国企改革A份额与1份富国国企改革B份额申请转换为2份富国国企改革份额的场内份额的行为。

第八部分 投资目标  
本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证国有企业改革指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

第九部分 基金投资方向  
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证国有企业改革指数成份股、成份股、固定收益资产(国债、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、权证、资产支持证券、质押或买断式回购、银行存款等)、衍生工具(股指期货、权证等)及法律法规或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对基金投资的特别规定)。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,可以将其纳入基金投资范围。

基金的投资比例为:本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证国有企业改革指数成份股和成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。每个交易日终在扣除股指期货保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内(含一年)的国债、货币市场基金、银行存款、证券投资基金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

第十部分 基金投资策略  
本基金主要采用完全复制法进行投资,依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风格模型及成本模型,按照成份股在中证国有企业改革指数中的组成及其基准市值构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现,并根据市场的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

当拟成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对基金跟踪中证国有企业改革指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1. 资产配置策略  
基金管理人主要按照中证国有企业改革指数的成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。本基金将根据各成份股的市值变化及权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证国有企业改革指数成份股和成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,每个交易日终在扣除股指期货保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内(含一年)的国债、货币市场基金、银行存款、证券投资基金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资比例将根据法律法规或监管机构的规定执行。

2. 股票投资组合构建  
(1)组合构建策略  
本基金将采用完全复制法构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的表现。

(2)组合调整  
本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证国有企业改革指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回等情况,对股票投资组合进行调整,股票增发等因素变化,对股票投资组合进行实时调整,以保证基金净值增长率与收益表现一致。

基金管理人将根据各成份股的市值变化及权重的变动而进行相应调整。本基金将根据各成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

3. 债券投资策略  
本基金将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,制定长期控制下的资产类别配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等手段进行有效选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。

4. 金融衍生工具投资策略  
在法律法规许可的,本基金可以谨慎原则运用权证、股票指数期货等适当金融工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险,提高投资效率,降低跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

十一、报告期本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

(2)报告期本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无

注:本基金报告期未投资国债期货。

(二)本基金投资股票投资的股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

十一、报告期本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

(2)报告期本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无

注:本基金报告期未投资国债期货。

(三)本基金投资股票投资的股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

十一、报告期本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

(2)报告期本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无

注:本基金报告期未投资国债期货。

(四)报告期本基金投资的可转换债券明细

本基金报告期未持有可转换债券。

(五)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(六)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(七)报告期本基金投资的货币市场基金的说明

本基金报告期未持有货币市场基金。

(八)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(九)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(十)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(十一)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(十二)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(十三)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(十四)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(十五)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(十六)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(十七)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(十八)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(十九)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(二十)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(二十一)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(二十二)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(二十三)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(二十四)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(二十五)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(二十六)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(二十七)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(二十八)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(二十九)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(三十)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(三十一)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(三十二)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(三十三)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(三十四)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(三十五)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(三十六)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(三十七)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(三十八)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(三十九)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(四十)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(四十一)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(四十二)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(四十三)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有债券型证券投资基金。

(四十四)报告期本基金投资的权证及金融衍生品类证券的说明

本基金报告期未持有权证及金融衍生品类证券。

(四十五)报告期本基金投资的资产支持证券的说明

本基金报告期未持有资产支持证券。

(四十六)报告期本基金投资的股指期货的说明

本基金报告期未持有股指期货。

(四十七)报告期本基金投资的国债期货的说明

本基金报告期未持有国债期货。

(四十八)报告期本基金投资的股票型证券投资基金的说明

本基金报告期未持有股票型证券投资基金。

(四十九)报告期本基金投资的债券型证券投资基金的说明