富国沪深300增强证券投资基金招募说明书（摘要）

（二〇一一年第一号）

富国沪深300增强证券投资基金（以下简称“本基金”）由中国证券监督委员会2009年10月21日证监许可〔2009〕1106号文批准发起设立。本基金的基金合同于2009年12月16日正式生效。

【重要提示】

投资有风险，投资人拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件，基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《证券法》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本招募说明书所载内容截止至2011年6月16日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2011年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

本基金基金管理人为富国基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：富国基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

法定代表人：陈敏

总经理：窦玉明

成立日期：1999年4月13日

电话：（021）68597788

传真：（021）68597799

联系人：李长伟

注册资本：1.8亿元人民币

股权结构（截止于2011年6月16日）：

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	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。

公司目前下设十七个部门和三个分公司，分别是：权益投资部、固定收益部、另类投资部、研究部、集中交易部、专户投资部、机构业务部、零售业务部、营销策划与产品部、客服与电子商务部、战略发展部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、行政管理部、信息技术部、运营部、北京分公司、深圳分公司和成都分公司。权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益部：负责固定收益类产品的研究与投资管理；另类投资部：负责FOF、PE、定量类产品等的研究与投资管理；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；专户投资部：在固定收益部、权益投资部和另类投资部内设立的虚拟部门，独立负责年金等专户产品的投资管理；机构业务部：负责年金、帐户、社保以及其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、华南营销中心、华北营销中心（深圳分公司）、北方营销中心（北京分公司）、西部营销中心（成都分公司），华北营销中心，负责共同基金的零售业务；营销策划与产品部：负责产品开发、营销策划和品牌建设等；客服与电子商务部：负责电子商务与客户服务，战略发展部：负责公司战略的研究、规划与落实；监察稽核部：负责监察、风控、法务和信息披露；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；行政管理部：负责文秘、行政后勤等。

截止到2011年6月16日，公司有员工182人，其中61%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

陈敏女士，董事长。生于1954年，中共党员，工商管理硕士，经济师。历任上海市信托投资公司副处长、处长；上海市外经贸委处长；上海万国证券公司党委书记；申银万国证券股份有限公司副总裁、党委委员。2004年开始担任富国基金管理有限公司董事长。

蒙玉明先生，董事、总经理。生于1969年，硕士。历任北京中信国际合作公司交易员；深圳君安证券公司投资经理；大成基金管理有限公司基金经理助理；嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司总经理。

麦陈婉芬女士（Constance Mak），副董事长。文学及商学学士，加拿大注册会计师。1977年加入加拿大毕马威会计事务所的前身Thorne Riddell公司，并于1989年成为加拿大毕马威的合伙人之一。1989年至2000年作为合伙人负责毕马威在加拿大中部地区的对华业务。现任BMO投资有限公司亚洲业务总经理，兼任加中贸易理事会董事。

李明山先生，董事。生于1952年，中共党员，硕士，高级经济师。历任申银万国证券股份有限公司副总经理；上海证券交易所副总经理。现任海通证券股份有限公司总经理。

万荣义先生，董事。生于1966年，中共党员，博士，高级会计师。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。现任申银万国证券股份有限公司财务总监。

Edgar Normund Legzdins先生，董事。生于1958年，学士，加拿大注册会计师。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。现任BMO投资有限公司首席执行官、BMO金融集团高级副总裁及董事总经理。

葛航先生，董事。生于1966年，大学本科，经济师。历任山东省国际信托有限公司资金信托部业务经理；山东省国际信托有限公司租赁信托部副经理、经理。现任山东省国际信托有限公司自营业务部经理。

戴国强先生，独立董事。生于1952年，博士学位。历任上海市中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长；上海市第二中级人民法院办公室综合科科长。现任申银万国证券股份有限公司合规稽核总部高级法律顾问。

夏瑾璐女士，监事。生于1971年，工商管理硕士。历任上海大学外语系教师；荷兰银行上海分行结构融资部经理；蒙特利尔银行金融机构部总裁助理；荷兰银行上海分行助理副总裁。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。

仇夏禕女士，监事。生于1960年，中共党员，研究生。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所主任；华夏证券有限公司上海分公司财务主管。现任海通证券股份有限公司计划财务高副总经理。

胡志荣女士，监事。生于1973年，中共党员，硕士。历任四川成都邮电通信设备厂财务处会计；厦门金达通信电子有限公司财务部财务主管。现任富国基金管理有限公司副财务经理。

丁畹先生，监事。生于1976年，民革党员，硕士。历任中国建设银行上海市分行信贷员、富国基金管理有限公司营销策划经理、客户服务部经理。现任富国基金管理有限公司客服与电子商务部高级客户服务经理。

3、督察长

李仁伟先生，督察长。生于1964年，中共党员，经济学硕士，工商管理硕士，讲师。历任河南省政府发展研究中心干部；中央党校经济学部讲师；申银万国证券股份有限公司海口营业部总经理、北京管理总部副总经理兼北京营业部总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司督察长。

4、经营管理层人员

窦玉明先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

林志松先生，副总经理。生于1969年，中共党员，大学本科，工商管理硕士。曾在漳州商检局办公室、晋江商检局检验科、厦门证券公司投资发展部工作。曾任富国基金管理有限公司监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、经理、督察长。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

陈戈先生，副总经理。生于1972年，中共党员，硕士，1996年起开始从事证券行业工作。曾任桂安证券研究所研究员、2000年10月加入富国基金管理有限公司，历任研究策划部研究员、研究策划部经理、总经理助理，2005年4月起任富国天益价值证券投资基金基金经理至今，2009年1月起兼任权益投资部总经理。2008年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

孟朝霞女士，副总经理。生于1972年，硕士研究生，12年金融领域从业经历。曾任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理。2009年开始担任富国基金管理有限公司副总经理。

5、本基金基金经理

①现任基金经理：李笑薇女士，1970年出生，博士，自2003年1月开始从事证券行业工作。曾任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12月起任富国沪深300增强证券投资基金基金经理；2011年1月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；同时兼任富国基金公司总经理助理、另类投资部总经理。

②历任基金经理：本基金第一任基金经理为常松先生，任职时间为2009年12月至2011年5月。

6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下：公司总经理窦玉明先生，公司主管投研副总经理陈戈先生，研究部总经理朱少醒先生，固定收益部总经理饶刚先生等人员。

列席人员包括：督察长、集中交易部总经理以及投委会主席邀请的其他人员。

本基金采取集体投资决策制度。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、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55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2011年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工130人，平均年龄30岁；95%以上员工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，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、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、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，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2011年3月，中国工商银行共托管证券投资基金205只，其中封闭式8只，开放式197只。自2003年以来，本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的25项最佳托管银行大奖；2010年，本行资产托管部总经理获得《财资》授予的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行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。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：富国基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

法定代表人：陈敏

总经理：窦玉明

成立日期：1999年4月13日

电话：（021）68597070

传真：（021）68597979

联系人：林燕珏

客户服务统一咨询电话：95105686，4008880688

公司网站：www.fullgoal.com.cn

2、代销机构

①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55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系电话：（010）66107900

传真：（010）66107914

联系人：田耕

客户电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

②中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西三环北路100号金玉大厦

法定代表人：项俊波

联系人：腾涛

传真：（010）85109219

电话：（010）85109229

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

③中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

传真：010-68858117

客服电话：95580

公司网站：www.psbc.com

④中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

传真：（010）66594946

客服电话：95566

公司网站：www.boc.com

⑤交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

联系电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：曹榕

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

⑥招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

联系人：马强

客服电话：95555

公司网站：www.cmbchina.com

⑦上海银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东二路585号

办公地址：上海市中山东二路585号

法定代表人：陈辛

联系电话：（021）68475888

传真：（021）68476111

联系人：张泽

客服电话：962888

公司网站：www.bankofshanghai.com.cn

⑧中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：（010）57092615

传真：（010）87092113

联系人：董云巍

客服电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

⑨中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：丰靖

电话：（010）65550827

传真：（010）65550827

客服电话：95558

公司网站：www.ecitic.com

⑩平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

电话：（0755）25859591

联系人：蔡宇洲

客服电话：40066-99999

公司网站：www.18ebank.com

⑪海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系电话：（021）23219000

联系人：金芸

客服电话：400-8888-001、95553

公司网站：www.htsec.com

⑫申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系电话：（021）54033888

传真：（021）64038844

联系人：王序微

客服电话：（021）962505

公司网站：www.sw2000.com.cn

⑬恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城新华东街111号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城新华东街111号

法定代表人：鞠瑞

客服电话：（0471）4961259、（021）68405273

传真：（021）64433260

联系人：张同亮

联系电话：（021）64224632

公司网站：www.cnht.com.cn

⑭东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：李涛

客服电话：400-8888-588（全国）

公司网站：www.longone.com.cn

⑮长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系电话：（0755）83516094

传真：（0755）83516199

联系人：匡婷

客服电话：（0755）33680000（深圳），400-6666-888（非深圳地区）

公司网站：www.cc168.com.cn

⑯中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

电话：（0532）85022026

传真：（0532）85022511

联系人：吴忠超

客服电话：96577

公司网站：www.zxwt.com.cn

⑰光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐治明

电话：（021）50818887-281

联系人：刘起

客服热线：400-8888-788

公司网站：www.ebscn.com

⑱国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦

法定代表人：万建华

联系电话：（021）62580818

传真：（021）386706666

联系人：芮敏琪

客服电话：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

⑲国元证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

联系电话：（0551）2207326

传真：（0551）2207343

联系人：沈和付

客服电话：（0551）2207777

公司网站：www.gyzq.com.cn

⑳东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路1138号

办公地址：吉林省长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系电话：（0431）85096709

传真：（0431）85096733

联系人：张瑾

客服电话：400-600-0686

公司网站：www.nesc.cn

㉑中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

联系电话：（010）66568430

传真：（010）66568536

联系人：田薇

客户服务热线：400-888-8888

公司网站：www.chinastock.com.cn

㉒中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：张佑君

联系电话：（010）65183888

联系人：魏明

开放式基金咨询电话：400-8888-108（免长途费）

开放式基金业务传真：（010）65182261

公司网站：www.csc108.com.cn

㉓长江证券股份有限公司

注册地址：武汉新华下路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉新华下路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

咨询电话：4008-888-999

公司网站：www.cjsc.com

㉔中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

电话：（010）66275654

联系人：王琳

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

㉕中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：唐新宇

电话：（021）68604866-8309

传真：（021）58774179

联系人：张静

客服电话：（021）68604866

公司网站：www.bocichina.com

㉖平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

电话：0755-82400862

联系人：周璐

客服电话：4008816168

公司网站：www.pingan.com

㉗江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

㉘招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

联系电话：（021）22169999

传真：（0755）82943636

联系人：林生迎

客服电话：400-8888-111、（0755）26951111

公司网站：www.newone.com.cn

㉙华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人：李晓安

电话：（931）4890100

传真：（931）4890118

联系人：李昕田

客服电话：（931）4890100、4890619、4890618

公司网站：www.hlzqgs.com

㉚大通证券股份有限公司

注册地址：大连市中山区人民路24号

办公地址：大连市中山区人民路24号

法定代表人：于宏民

电话：0411-39673202

传真：0411-39673219

联系人：谢立军

客服电话：4008-169-169

公司网站：www.hlzqgs.com

㉛渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道201-205号

办公地址：天津市河西区马场道201-205号

法定代表人：刘宝凤

电话：022-58316666

传真：022-58316259

联系人：王宏

客服电话：4008888811

公司网站：www.cbhb.com.cn

㉜中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3楼

法定代表人：王东明

联系电话：（010）84683893

传真：（010）84865560

联系人：陈忠

客户咨询电话：（010）84868336

公司网站：www.cs.ecitic.com

㉝宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路294号

办公地址：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

电话：021-63586210

传真：021-63586215

联系人：胡技勋

客服电话：96528（上海地区962528）

公司网址：www.nbcb.com.cn

㉞温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道196号

办公地址：温州市车站大道196号

法定代表人：邢增福

电话：0755-88990082

传真：0755-88995217

联系人：林波

客户服务热线：0577-96699

公司网址：www.wzbank.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：富国基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

法定代表人：陈敏

总经理：窦玉明

成立日期：1999年4月13日

电话：（021）68597070

传真：（021）68597979

联系人：雷青松

（三）出具法律意见书的律师事务所（基金募集时）

名称：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：韩阿

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：安冬

经办律师：秦悦民、安冬

（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有限责任公司

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：上海市长乐路989号世纪商贸广场23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

四、基金的名称

富国沪深300增强证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；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的政府债券。

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。

八、基金的投资策略

本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。

1、标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

如果沪深300指数被停止编制及发布，或沪深300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沪深300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，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和投资对象，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在中国证监会指定的媒体上公告。

2、指数化投资为主，主动性投资为辅：

本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。

富国研发的定量投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子alpha模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。

①多因子alpha模型——股票超额回报预测

富国多因子alpha模型以对中国股票市场的长期研究为基础，一定程度上结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha模型的因子可归为如下几类：价值（value）、动量（momentum）、成长（growth）、情绪（sentiment）、质量（quality）。

这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方面信息。富国多因子alpha模型利用富国长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

②风险估测模型——有效控制风险预算

指数化投资力求跟踪误差最小，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

③交易成本模型——控制成本并保护业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，在控制成本最低的基础上减少交易造成的负业绩影响。

④投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以成分股为主，并包括非成分股中与成分股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。

3、对目标指数的跟踪调整：

①定期调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数公司原则上每半年审核一次沪深300指数成份股。本基金将按照沪深300指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

②不定期调整

根据指数编制规则，当沪深300指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日至该股票除权日之前。

此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。由于受到各项投资禁止行为以及持股比例等限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时也需要寻求替代。

4、债券投资策略

本基金管理人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市场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，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本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、现金管理等管理手段进行个券选择。

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，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

1、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	2,308,801,500.03	93.89
	其中：股票	2,308,801,500.03	93.89
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	138,667,989.88	5.64
6	其他资产	11,628,258.83	0.47
7	合计	2,459,097,748.74	100.00

2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	255,306.92	0.01
B	采掘业	415,512.24	0.02
C	制造业	264,823,707.16	10.86
C0	食品、饮料	5,957,622.00	0.24
C1	纺织、服装、皮毛	36,502,815.20	1.50
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	31,665,653.46	1.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	35,103,943.94	1.44
C5	电子	32,643,187.44	1.34
C6	金属、非金属	37,996,154.00	1.56
C7	机械、设备、仪表	52,142,092.05	2.14
C8	医药、生物制品	21,784,833.07	0.89
C99	其他制造业	11,027,406.00	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,641,208.00	0.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	33,857,716.04	1.39
H	批发和零售贸易	6,713,081.42	0.28
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	22,356,354.79	0.92
K	社会服务业	2,483,997.40	0.10
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,286,819.70	0.13
	合计	336,833,703.67	13.82

3、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	194,829,466.76	7.99
C	制造业	671,404,214.01	27.54
C0	食品、饮料	87,062,451.77	3.57
C1	纺织、服装、皮毛	358,680.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	38,765.94	0.00
C5	电子	413,820.00	0.02
C6	金属、非金属	300,332,961.71	12.32
C7	机械、设备、仪表	250,731,307.35	10.29
C8	医药、生物制品	32,466,227.24	1.33
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	72,911,066.09	2.99
E	建筑业	123,126,305.74	5.05
F	交通运输、仓储业	121,033,690.70	4.97
G	信息技术业	17,556,136.32	0.72
H	批发和零售贸易	35,980,632.80	1.48
I	金融、保险业	593,317,096.66	24.34
J	房地产业	127,498,108.78	5.23
K	社会服务业	13,959,541.50	0.57
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	351,537.00	0.01
	合计	1,971,967,796.36	80.90

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

①报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	22,307,282	124,697,706.38	5.12
2	600000	浦发银行	8,774,353	119,506,687.86	4.90
3	600030	中信证券	7,267,448	101,526,248.56	4.16
4	601006	大秦铁路	10,700,496	91,596,245.76	3.76
5	601668	中国建筑	24,674,851	91,296,948.70	3.75
6	600019	宝钢股份	12,230,162	86,467,245.34	3.55
7	600362	江西铜业	2,140,088	83,142,418.80	3.41
8	601166	兴业银行	2,837,933	81,477,056.43	3.34
9	601601	中国太保	3,068,000	67,864,160.00	2.78
10	600383	金地集团	9,353,300	63,508,907.00	2.61

②报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000726	鲁 泰A	3,477,752	35,125,295.20	1.44
2	000488	晨鸣纸业	3,968,127	31,665,653.46	1.30
3	000666	经纬纺机	1,638,757	21,189,128.01	0.87
4	600172	黄河旋风	1,370,900	19,384,526.00	0.80
5	002465	海格通信	455,558	15,889,863.04	0.65

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

本报告期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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

②申明本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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

③报告期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,169,076.63
2	应收证券清算款	7,285,305.90
3	应收股利	21,033.00
4	应收利息	29,684.97
5	应收申购款	1,123,158.33