富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二〇一八年一月

重要提示

富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)已于2017年7月10日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2017】1199号《关于准予富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》)。

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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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;基金所投资的债券、衍生品等各种投资工具的相关风险;由于基金分额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险;本基金的特定风险等。本基金是债券基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票基金和混合基金。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,在债券基金中属于较低风险、较低收益的产品。

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、基金合同等信息披露文件。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。

第一部分前言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称 “《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)和其他有关法律法规的规定,以及《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由富国基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

第二部分释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金
2、基金管理人:指富国基金管理有限公司
3、基金托管人:指中国工商银行股份有限公司
4、基金合同:指《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书或本招募说明书:指《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7、基金份额发售公告:指《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
8、上市交易公告书:指《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
9、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
10、《基金法》: 指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
11、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
14、《流动性风险规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
15、交易型开放式指数证券投资基金:指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”
16、联接基金:指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金
17、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
18、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
19、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
20、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
21、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
22、合格境外机构投资者:指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
23、投资者:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称
24、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者
25、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回等业务
26、销售机构:指直销机构和代销机构
27、直销机构:指富国基金管理有限公司
28、代销机构:指发售代理机构和/或申购赎回代理券商
29、发售代理机构:指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构
30、申购赎回代理券商:指基金管理人指定的代理本基金申购、赎回业务的证券公司
31、登记业务:指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、存管和结算业务
32、登记机构:指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
33、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期
34、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
35、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月
36、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
37、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
38、T日:指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日
39、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
40、开放日:指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
41、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
42、《业务规则》:指基金管理人、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则和规定
43、认购:指在基金募集期内,投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
44、申购:指基金合同生效后,投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
45、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为赎回对价的行为
46、申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件
47、申购对价:指投资者申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额及其他对价或组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
48、赎回对价:指投资者赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的现金替代、现金差额及其他对价或组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
49、标的指数:指中证指数有限公司编制并发布的中证10年期国债指数及其未来可能发生的变更
50、组合证券:指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
51、现金替代:指申购或赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金
52、最小申购赎回单位:指基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍
53、现金差额:指最小申购赎回单位的资产净值与按基金合同约定的估值方法计算的最小申购赎回单位中的组合证券价值和现金替代之差;投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算
54、基金份额参考净值:指基金管理人或者基金管理人委托的机构在交易时间内,根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的行情数据计算并由上海证券交易所发布的基金份额参考净值,简称IOPV
55、基金份额折算:指基金管理人根据基金运作的需要,在基金资产净值不变的前提下,按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为
56、收益评价日:指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数增长率差额之日
57、基金份额净值增长率:指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算)
58、标的指数同期累计报酬率:指收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去1乘以100.00%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算)
59、元:指人民币元
60、基金收益:指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
61、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
62、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
63、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
64、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
65、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
66、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介
67、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分基金管理人

(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8号上海国金中心二期16-17楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼
成立日期:1999年4月13日
法定代表人:薛爱东
总经理:陈戈
电话:(021)20361818
联系人:赵瑛
注册资本:3亿元人民币
股权结构(截止于2017年9月30日):

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申万宏源证券有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托股份有限公司	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。

公司目前下设二十四个部门、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、监察稽核部、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决策提供研究支持;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FOF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、专户、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,拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则,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;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;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、行政后勤管理等工作;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2017年9月30日,公司有员工402人,其中65.4%以上具有硕士以上学历。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

薛爱东先生,董事长,研究生学历,高级经济师。历任交通银行扬州分行监察室副主任、办公室主任、会计部经理、证券部经理,海通证券股份有限公司扬州营业部总经理,兴安证券有限责任公司托管组组长,海通证券股份有限公司黑龙江管理总部总经理兼党委书记、上海分公司总经理兼党委书记、公司机关党委书记兼总经理办公室主任。

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),副董事长,文学及商学学士,加拿大注册会计师。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,副董事长,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、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,中银万国证券股份有限公司财务总监。

裴长江先生,董事,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,中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。

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。

蒲冰先生,董事,本科学历,中级审计师。现任山东省国际信托股份有限公司自营业务部总经理。历任山东正源和信会计师事务所审计部、评估部员工,山东省鲁信置地有限公司计财部业务经理,山东省国际信托股份有限公司计财部业务经理,山东省国际信托股份有限公司合规审计部副总经理,山东省国际信托股份有限公司自营业务部副总经理。

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代书记、党支部书记兼分理处副主任(主持工作);上海申银证券公司浦东公司财会部筹备负责人;上海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。历任上海市劳改局政治处主任;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副科长、办公室副主任、办公室主任、副所长;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、党组副书记;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。现任圣力嘉学院(Seneca College)工商系会计及财务金融科教授。1976年加入加拿大毕马威会计事务所的前身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。

李宪明先生,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。

2、监事会成员

付吉广先生,监事长,研究生学历。现任山东省国际信托股份有限公司风控总监。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四部经理。

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总部副总经理,公司律师。历任上海市高、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审判员、办公室综合科科长。

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资本管理总监;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总经理助理,历任海通证券股份有限公司稽核部二级部经理等。

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运营总监。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。

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。历任上海金新金融工程研究院部门经理、友联战略管理中心部门经理、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。

杨轶琴女士,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、营销策划经理、销售支持经理、高级销售支持经理。

沈喜慧女士,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。

3、督察长

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。

4、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经理。

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,现任富国基金管理有限公司副总经理。

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

(下转A38版)

富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)已于2017年7月10日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2017】1199号)。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金的基金类别是债券型基金,基金运作方式是契约型,交易型开放式。

3、本基金的管理人为富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。

网上现金认购是指投资者通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司以现金进行的认购;网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购;网下债券认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行的认购。

6、本基金募集期自2018年1月8日至2018年3月9日。其中,网下现金认购的日期为2018年1月8日至2018年3月9日;网上现金认购的日期为2018年3月7日至2018年3月9日;网下债券认购的日期为2018年1月8日至2018年3月9日。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整,我司将相应调整并及时公告。基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告。

7、投资者认购本基金,需具有中国证券登记结算有限责任公司的上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户。

8、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。

网下现金认购以基金份额申请。单笔认购须为1,000份或其整数倍。

网下债券认购以单只债券手数申报,用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券(详见本公告“七、网下债券认购清单”)。单只债券最低认购申报数为1手(人民币1000元面值债券为1手),超过1手的部分须为1手的整数倍。

9、投资者认购本基金时,需按基金管理人或发售机构的规定,备足认购资金或债券,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤消指定的认购申请。网下现金认购申请提交后,在发售机构规定的时间之后不得撤销。网下债券认购申请提交后,在发售机构规定的时间之后不得撤销。

10、发售机构(指发售代理机构和/或直销机构)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实接受了认购申请。申请的成功确认应以基金合同生效后,登记机构的确认登记为准。客户可以在基金合同生效后到原认购的销售网点打印认购成交确认凭证。

11、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。客户欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2018年1月3日刊登在中国证券报和证券时报上的《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。本基金的招募说明书、基金合同及本公告将同时发布在本公司网站(www.fullgoal.com.cn),投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集相关事宜。

12、发售机构的销售网点以及开户认购等事项的详细情况请向各发售机构咨询。

13、投资者可拨打本公司的客户服务电话95105686,400-888-0688咨询购买事宜。

14、基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

15、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。

16、本基金属于债券基金,风险与收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低预期收益和预期风险水平的投资品种。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。

17、风险提示

在投资本基金前,投资者应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险,因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险或负收益风险,因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险,因本产品相关技术、规则、操作等创新性造成基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,本基金的特定风险等等。特定风险包括:指数下跌风险、跟踪偏离风险、流动性风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、申购赎回风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、标的指数变更的风险、第三方机构服务的风险、操作或技术风险、国债期货投资风险等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

另外,本基金在上海证券交易所上市交易,对于选择通过二级市场交易的投资者而言,其投资收益为买卖价差收益,交易费用和二级市场流动性因素都会在一定程度上影响投资者的投资收益。投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本基金合同及招募说明书。

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。

18、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业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

一、本次募集基本情况

(一)基金名称

富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金

(二)基金简称和代码

场外简称:富国中证10年期国债ETF
场内简称:十年债
认购代码:511313
一级市场申赎代码:511311
二级市场交易代码:511310

(三)基金类型

债券型证券投资基金

(四)基金运作方式

契约型,交易型开放式

(五)基金存续期限

不定期

(六)基金份额面值

基金份额面值为1.00元人民币

(七)发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(八)基金份额发售机构

1、发售主协调人

申万宏源证券有限公司。

2、网下现金认购和网下债券认购的直销机构

富国基金管理有限公司。

3、网下现金认购和网下债券认购的发售代理机构

安信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司。

4、网上现金认购的发售代理机构

具有基金代销业务资格,并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司(具体名单可在上海证券交易所网站查询)。

基金管理人可根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(九)募集时间安排与基金合同生效

本基金募集期自2018年1月8日至2018年3月9日。其中,网下现金认购的日期为2018年1月8日至2018年3月9日;网上现金认购的日期为2018年3月7日至2018年3月9日;网下债券认购的日期为2018年1月8日至2018年3月9日。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整,我司将相应调整并及时公告。基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告。

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。募集的债券由登记机构予以冻结,于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

本基金日基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币(含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值)且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,日收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,日基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,基金合同生效;否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

如果募集期限届满,本基金仍未达到合同规定的基金备案条件,基金管理人将以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期活期存款利息(税后)。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券,登记机构应予以解冻,登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

(十)基金的最低募集份额总额和募集金额

本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

二、募集方式及相关规定

(一)募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。

网上现金认购是指投资者通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司以现金进行的认购;网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购;网下债券认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行的认购。

1、网上现金认购

(1)认购限额:网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。

(2)认购申请:投资者在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

(3)认购金额的计算

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

(或若适用固定费用的,认购佣金=固定费用)

认购佣金由发售代理机构收取,投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例:某投资者到某发售代理机构认购1,000份本基金,假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.4%,则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金=1.00×1,000×0.4%=4.00元

认购金额=1.00×1,000×(1+0.4%)=1,004.00元

即:投资者通过该发售代理机构网上现金认购1,000份本基金基金份额,需准备1,004.00元。

(5)清算交收:投资者提交的认购委托,由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

(6)认购确认:在基金合同生效后,投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

2、网下现金认购

(1)认购限额:网下现金认购以基金份额申请。投资者单笔认购须为1000份或其整数倍。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。

(2)认购申请:投资者在认购本基金时,需按基金管理人或发售代理机构的规定办理相关认购手续,并备足认购资金。网下现金认购申请提交后,在基金管理人或发售代理机构规定的时间之后不得撤销。

(3)认购金额的计算

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购费用、认购金额的计算公式为:

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

(或若适用固定费用的,认购费用=固定费用)

认购金额=认购价格×认购份额×(1+费率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

认购费用由基金管理人收取,投资者需以现金方式交纳认购费用。

例:某投资者到基金管理人直销柜台认购100,000份基金份额,假定认购金额产生的利息为10元,则需准备的认购金额及总认购份额计算如下:

认购费用=1.00×100,000×0.4%=400元

认购金额=1.00×100,000×(1+0.4%)=100,400元

净认购份额=100,000+10/1.00=100,010份

即:投资者若通过基金管理人认购本基金100,000份,需准备100,400元,假定该笔认购金额产生利息10元,则投资者可得到100,010份基金份额。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算:同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

(4)清算交收:通过基金管理人提交的网下现金认购申请,由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。

(5)认购确认:在基金合同生效后,投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

3、网下债券认购

(1)认购限额:网下债券认购以单只债券手数申报,用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券。单只债券最低认购申报数为1手(人民币1000元面值债券为1手),超过1手的部分须为1手的整数倍。投资者可以多次提交认购申请,累计申报数不设上限。

(2)认购申请:投资者在认购本基金时,需按发售机构的规定,到销售网点办理认购手续,并备足认购债券。网下债券认购申请提交后在发售机构规定的时间之后不得撤销。

(3)特殊情形

1)已公告的将被调出标的指数的成份券不得用于认购本基金。

2)限制个券认购规模:基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个券认购规模进行限制,并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。

3)临时拒绝个券认购:对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个券,基金管理人可不