富国全球债券证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

（二〇一八年第一号）

重要提示

富国全球债券证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2010年9月2日证监许可[2010]1200号文核准募集。本基金的基金合同于2010年10月20日正式生效。

基金管理人保证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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。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，并承担基金投资中出现的风险，基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、投资风险、交易对手风险、运作风险和合规与道德风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分的十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止至2018年4月20日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2018年3月31日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金名称

富国全球债券证券投资基金

第二部分 基金类型

债券型

第三部分 投资目标

本基金主要投资于全球债券市场，通过运用基金中基金（FOF:fund of funds）这种国际流行的投资管理模式，力争实现资产运作细分化、组合配置最优化、风险管理精细化、风险调整后收益最大化，从而谋求基金资产的长期稳定增值。

第四部分 基金投资范围

本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的境外债券型及货币型交易型开放式指数基金（债券型及货币型ETF），主动管理的债券型及货币型公募基金，公开发行、上市的债券，货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合比例为：债券型交易型开放式指数基金（债券型ETF）、主动管理的债券型公募基金、债券合计不低于基金资产的80%，投资于基金的部分不低于本基金基金资产的60%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的基金资产将投资于全球主要证券市场，主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区的证券市场，投资于与中国证监会签署双边监管合作备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的10%。与中国证监会签署双边监管合作备忘录国家或地区如下表所示：

所属大洲	国家或地区			
北美洲	美国	加拿大		
南美洲	巴西	阿根廷		
欧洲	英国	乌克兰	法国	卢森堡
	德国	意大利	荷兰	比利时
	瑞士	葡萄牙	罗马尼亚	土耳其
	挪威	列支敦士登	俄罗斯	爱尔兰
	瑞典	立陶宛	耿西岛	白俄罗斯
	奥地利	西班牙	马耳他	泽西岛
	马恩岛	波兰		
亚洲	香港	新加坡	日本	马来西亚
	韩国	印度尼西亚	越南	印度
	约旦	阿联酋	泰国	蒙古
	迪拜以色列	台湾卡塔尔	科威特老挝	巴基斯坦塞浦路斯
	文莱	哈萨克斯坦	阿塞拜疆	
大洋洲	澳大利亚	新西兰		
非洲	埃及	南非	尼日利亚	

如与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，本基金投资的主要证券市场相应调整。

第五部分 基金投资策略

本基金采用战略资产配置与战术资产配置相结合的策略，通过“自上而下”的方式进行资产配置，在有效分散风险（即：分散投资于单一国家或区域债券基金、单一债券类型基金以及单一基金公司及经理人的投资风险）的同时，力争实现基金资产风险调整后收益最大化。在本基金资产组合的构建过程中，根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征，基金资产被区分为核心资产和卫星资产。

（一）资产配置策略

在大类资产配置层面，本基金主要通过战略资产配置策略与战术资产配置策略有机结合的方式进行投资管理。

本基金战略资产配置（SAA）的投资标的和配置比例以业绩比较基准－巴克莱全球债券指数（Barclay Global Aggregate Index）为基础。战略资产配置策略是决定基金资产长期收益和波动率的关键，也是实现本基金投资目标的根本，其目的是通过分散投资有效降低投资组合风险。因此，本基金战略资产配置策略将落实在核心资产配置上。

本基金核心资产配置主要着眼于投资等级债券共同基金的低波动特性，并以投资等级债券基金为主要资产配置工具。核心资产配置比例将参考巴克莱全球债券指数资产配置比例。

本基金战术资产配置（TAA）将根据市场形势，对基金资产组合进行动态调整。战术资产配置主要决策因素包括：各区域与国家的景气周期、总体经济指标、货币政策、利率水平、信用市场的利差变化等。本基金在对上述因素进行充分研究后，确定卫星资产配置和调整方案。

本基金卫星资产配置着眼于投资品种的弹性和高票息收入，以ETF等较具弹性的短期投资工具，投资于高票息的新兴市场债券或高收益债券的债券基金等为主要配置工具。特别是部分新兴市场的政治经济稳定度在逐步提升，其主权评级一经调升将会引发新兴市场债券价格的上扬。同样，高收益债券也存在评级获得调升的潜在可期收益。

本基金投资的各类债券型基金定义如下：

1、投资等级债券基金是以经国际主要评等机构（如标准普尔、穆迪及惠誉等）评为投资等级的政府债券、公司债以及其他固定收益品种（如房地产抵押债券、金融抵押债券等）为主要投资目标的债券基金，例如美国投资等级债券基金、欧洲投资等级债券基金等。

2、高收益债券基金是以经国际主要评等机构评为非投资等级公司债为主要投资目标的债券基金，例如美国高收益债券基金、欧洲高收益债券基金等。

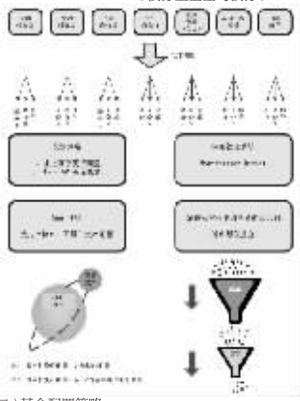
3、亚太地区（不含日本）债券基金是以亚太地区或国家的政府公债及公司债为主要投资目标的债券基金。

4、日本债券基金是以日本的政府公债及公司债为主要投资目标的债券基金。

5、新兴市场债券基金是以新兴市场国家的政府公债及公司债为主要投资目标的债券基金。

本基金投资主体示意图

（债券型基金与债券）



（二）基金配置策略

基金评选流程

1、基金筛选平台

本基金利用Morningstar Direct数据库作为备选库。作为一个专门为机构用户设计的研究平台，Morningstar Direct允许使用者进行深度的投资分析。该数据库全面整合所有投资机会，可以进行跨类别分析，包括100000个以上的全球开放式基金、2400个以上的封闭式基金及30000个以上的全球指数基金（其为晨星专业统计数据的独家来源）。

基于此平台，本基金管理人能够进行以持仓、收益为基础的风格分析，进行深入的同业/竞争力分析和透彻的经理业绩评价，同时对投资进行有效监测和报告。

本基金首先筛选出合适的候选基金。除收益外，本基金管理人还关注其规模大小、投资组合的特征（信用评级、久期、流动性等）以及是否符合本基金投资理念和投资范围等。

2、定量分析

本基金利用十个定量因素对可投资基金进行打分，每只基金依据在过往选定的时间窗口内这十项指标的表现，可获取相应分数，而十项指标得分按照各自权重的加总就是这只基金的总得分，依据这个总分我们进行基金排名，得出定量分析的结果。

这十项指标包含分析基金风险的标准差，跟踪误差，下跌标准差及分析基金收益特征及与同类型基金比较的Alpha，收益，信息比率，升市捕捉（Up-Market Capture），跌市捕捉（Down-Market Capture），上升潜力比率及下跌风险保护。各项指标的权重由投资团队根据投资经验和定量分析结果决策确定，并定期进行回顾、有效性检验和调整。

3、定性分析

本基金可向经过定量分析得出的备选基金池中的基金公司发出询问书（RFP，Request for Proposal），询问书内容包含五十多个问题，这些问题主要用来具体分析每个备选基金基金管理人在理念、过程、人、业绩和价格这5项指标（5P）的表现，这项分析的主要目标是评估基金公司是否具有可持续发展的模式，最终用以评估旗下基金重复以往业绩的概率。

定性分析具体内容包含：

（1）理念：这个项目主要考察基金公司的股东结构，管理层的经营哲学，公司业务拓展目标，以及是否为员工提供合理的激励机制等因素；

（2）过程：这个项目主要考察基金的风格与策略是否具有一致性，投资组合的建构方法是否严谨，基金的运作是否合法合规，是否有适当的风险管理与控制等因素；

（3）人：这个项目主要考察人员的流动，员工的素质与从业经历，资源的分配与组织架构等因素；

（4）业绩：这个项目主要考察基金超额收益的来源，分析历史业绩的优缺点，业绩表现的稳定性等因素；

（5）价格：这个项目虽然重要但并不是最关键的因素，我们在了解费用结构后，可以就不同的基金经理人进行比较，以分析其合理性。

4、现场尽职调查

本基金管理人可对可投资基金的管理公司进行现场尽职调查，以确定其对询问书（RFP）反馈的真实性。本基金管理人将着重讨论研究过程、考核组合经理、合规和运作过程。

5、最终决定

在对现场考察书面报告进行审查后，本基金管理人将综合考虑5P、访谈记录、各种约束和投资方针以及监管要求，得出最终投资基金名单。

6、业绩回顾与监测

季度监测：本基金管理人对每个基金的业绩进行季度考评，就滚动的一年期业绩与基准比较或者和第三方定义的可比均值比较。根据季度监测报告的分析，若基金的业绩没有达到相关标准，将根据下列准则被纳入不同观察名单：

红色区——基金近6个月未能达到基准和同业水平。

黄色区——基金近3个月未能达到基准和同业水平。

任何在此名单上的基金将被密集追踪，如果连续两个季度出现在红色区名单上，且无合理解释时，则将进行替换。

（三）债券投资

本基金将根据需要适度进行债券投资。债券投资将作为债券基金投资的补充，以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。本基金将主要投资于信用等级为投资级以上的债券。

（四）金融衍生品投资

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资。衍生品投资的主要策略包括：利用汇率衍生品，降低基金汇率风险；利用指数衍生品，降低基金的市场整体风险等。

本基金主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的金融衍生品，当这些交易所没有本基金需要的衍生产品时，在严格风险控制的前提下，本基金将采用场外交易市场（OTC）买卖衍生产品。

（五）股票型基金投资

当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本基金可以适度投资主动管理的股票型基金、股票型交易型开放式指数基金（股票型ETF），从而努力获取超额收益。

此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益。未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

第六部分 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：Barclay Global Aggregate Index。

Barclay全球债券指数是Barclay债券系列指数之一，用以衡量全球主要债券资产的表现。该指数主要由其美国全债指数（US Aggregate Index）、泛欧全债指数（Pan-European Aggregate Index）、亚太全债指数（Asian-Pacific Aggregate Index）组成，广泛包含三大区块的各种不同等级、产业及久期的债券。该指数每日追踪成份债的到期与新发行，进行必要替换，并以每月最后一个交易日的成份债作为下月价格计算的标准，亦即该指数再平衡的频率是以月为单位。截止至2010年5月底，巴克莱全球债券指数成分债资产配置中，按所属区域划分，美国占38.8%，欧洲占32.6%，亚太占22.8%，其他占5.8%；按资产类别划分，国债占52.2%，信用债占20.3%，证券化债占18.2%，机构和地方政府债占9.3%；按评级情况划分，Aaa级占53.2%，Aa级占30.3%，A级占10.2%，Baa级占6.3%。

本基金的业绩比较基准将在业绩评价期开始即予以明确，且和基金的投资风格一致。而Barclay债券系列指数为全球最具公信力的业绩比较基准指数之一，其业绩比较基准的数据可以合理的频率获取，组成业绩比较基准的成分和权重可以清晰的确定，业绩比较基准并具有可复制性，故被全球资产管理公司所广泛采用。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

第七部分 基金的风险特征

本基金为债券型基金中基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

第八部分 投资组合报告

一、期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	21,130,238.35	90.35
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,229,009.48	9.53
8	其他资产	27,280.18	0.12
9	合计	23,386,528.01	100.00

二、期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

三、期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

四、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益资产。

五、期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

六、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。

七、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。

八、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

九、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	PIMCO-HI YIELD BD-$INST INC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	4,435,653.72	19.52
2	FIDELITY FNDS-US HIGH YLD-A $	开放式	普通开放式基金	FIL Fund Manage-ment Ltd	4,209,519.62	18.52
3	PIMCO GBL INV GRADE-INS $ACC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	3,831,768.81	16.86
4	PIM-CO-GLOBAL BOND-$INV ACC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	3,121,458.62	13.74
5	PIM-CO-GLOBAL BOND-US UH I AC	开放式	普通开放式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	2,757,910.80	12.14
6	FULLERTON ASIAN BOND-A	开放式	普通开放式基金	Fullerton Fund Manage-ment Co Ltd	1,854,103.51	8.16
7	ISHARES BARCLAYS 20+ YEAR TR	开放式	ETF基金	BlackRock Fund Advisors	919,823.27	4.05

十、投资组合报告附注

（一）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

报告期内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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（二）申明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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

（三）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	529.69
5	应收申购款	26,750.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	27,280.18

（四）报告期末持有的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：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

（六）投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

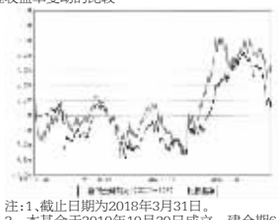
第九部分 基金的业绩

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代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、本基金历史各时间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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2010.10.20-2010.12.31	0.00%	0.04%	-2.63%	0.42%	2.63%	-0.38%
2011.01.01-2011.12.31	-4.30%	0.23%	0.51%	0.31%	-4.81%	-0.08%
2012.01.01-2012.12.31	6.06%	0.16%	4.06%	0.23%	2.00%	-0.07%
2013.01.01-2013.12.31	-6.80%	0.24%	-5.52%	0.33%	-1.28%	-0.09%
2014.01.01-2014.12.31	-0.11%	0.17%	0.95%	0.25%	-1.06%	-0.08%
2015.01.01-2015.12.31	3.07%	0.27%	2.77%	0.40%	0.30%	-0.13%
2016.01.01-2016.12.31	10.88%	0.20%	9.06%	0.38%	1.82%	-0.18%
2017.01.01-2017.12.31	-1.30%	0.21%	1.16%	0.33%	-2.46%	-0.12%
2018.01.01-2018.03.31	-4.41%	0.28%	-2.46%	0.35%	-1.95%	-0.07%
2010.10.20-2018.03.31	1.90%	0.22%	7.42%	0.33%	-5.52%	-0.11%

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2018年3月31日。

2、本基金于2010年10月20日成立，建仓期6个月，从2010年10月20日起至2011年4月19日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

第十部分 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

注册地址：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层

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层

法定代表人：薛爱东

总经理：陈戈

成立日期：1999年4月13日

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：赵瑛

注册资本：3亿元人民币

股权结构（截止于2018年04月20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；合规稽核部：履行合规审查、合规检查、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2018年3月31日，公司有员工418人，其中67.3%以上具有硕士以上学历。

二、主要人员情况

（一）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），董事，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，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、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，申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，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。

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财务部业务经理，山东省国际信托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）；上海申银证券公司财会部员工；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。

李文冠先生，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。

（二）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，兼任上海仲裁委员会仲裁员。历任上海市高级人民法院助理研究员，上海市中级人民法院、上海市第二中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长，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。

杨轶苓女士，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监控监助理。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。

沈倍慧女士，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、博明软件开发(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）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，历任基金经理、量化与海外投资部总经理、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。

朱少醒先生，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权益投资部总经理兼基金经理。

（五）本基金基金经理

（1）现任基金经理：

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5月在华泰证券股份有限公司历任研究员、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月起任富国全球债券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，2017年11月起任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理；兼量化投资部量化投资总监助理。具有基金从业资格。

（2）历任基金经理：

林如惠自2010年10月至2011年5月担任本基金基金经理；

张峰自2011年4月至2012年12月担任本基金基金经理；

李军自2012年11月至2014年4月担任本基金基金经理；

陈曙亮自2014年4月至2016年10月担任本基金基金经理。

（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，分管副总经理李笑薇

（七）备注

上述人员之间不存在近亲属关系。

第十一部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（一）基金费用的种类

1、基金的管理费；

2、基金的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、基金在所投资市场实际发生的证券交易、清算、登记等费用（out-of-pocket fees）；

5、基金份额持有人大会费用；

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、税务顾问费等根据有关法规、《基金合同》及相应协议的规定，由基金管理人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用；

7、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收和费用(包括但不限于关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税以及与前述各项有关的税收和费用任何利息、罚金及费用）（简称“税收”）；

8、代表基金投票等与基金投资活动直接相关的费用，法律法规另有规定的除外；

9、基金的银行汇划费用；

10、因更换境外托管人而进行的资产转移所产生的费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金的管理费

基金的管理费包括基金管理人的管理费和境外投资顾问的投资顾问费两部分，其中境外投资顾问的投资顾问费在境外投资顾问与基金管理人签订的《顾问协议》中进行约定。

本基金的管理费按前一日基金资产净值0.9%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.9%÷当年天数

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，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发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。境外投资顾问的投资顾问费由基金管理人进行支付，具体支付程序在《顾问协议》中列示。

2、基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.22%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3－11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用，基金收取认购费的，可以从认购费中列支，以所收取的认购费为上限；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率和基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规