富荣沪深300指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2019年第1号）

基金管理人：富荣基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

【重要提示】

富荣沪深300指数增强型证券投资基金由富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来。

富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可［2017]726号文注册，基金管理人为富荣基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金自2017年11月14日至 2018年2月8日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月11日生效。

富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2018]1827号文准予变更注册。

本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注册，但中国证监会对富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：市场风险、管理风险、职业道德风险、流动性风险、合规性风险、本基金特定投资策略带来的风险及其他风险等。本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金，属于证券投资基金中中高等风险、中高等预期收益的品种。本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金可投资中小企业私募债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，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。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2019年7月24日，有关财务数据截止日为2019年6月30日，净值表现截止日为2019年6月30日。（财务数据未经审计）。

本基金托管人中国光大银行股份有限公司已于2019年8月15日复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：富荣基金管理有限公司
注册地址：广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20室
办公地址：深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场3501室
法定代表人：杨小舟
设立日期：2016年1月25日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：证监许可【2015】3118号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
存续期限：永续经营
联系人：罗艳
联系电话：0755-84356637
传真：0755-83230787
股权结构：

股东名称	出资比例
广州科技金融创新投资控股有限公司	50%
深圳嘉年实业股份有限公司	45.1%
湖南典勤投资开发有限公司	4.9%

（二）主要成员情况

1、董事会成员

杨小舟先生，董事长，大连理工大学硕士研究生。历任交通银行沈阳分行国际部国际结算员、信贷科科长、中信银行沈阳皇姑支行副行长、广发银行南湖支行行长、广发银行沈阳直属支行行长助理、副行长、行长兼党委书记、广发银行沈阳分行行长兼党委书记、广发银行深圳分行行长兼党委书记。

郭容辰女士，董事，总经理，北京大学法学硕士，历任交通银行深圳福田支行行长、深圳分行零售信贷部总经理、个人金融部总经理、华夏银行深圳分行个人金融部总经理、金鹰基金管理有限公司副总经理，现任富荣基金管理有限公司总经理。

罗劲先生，董事，湖南大学工商管理硕士。曾任广州农村商业银行股份有限公司华夏支行集团客户事业部副总经理。现任广州汇垠澳丰股权投资基金管理有限公司常务副总经理、四川汇源光通信股份有限公司董事长、富荣基金管理有限公司董事。

郭涛先生，董事，上海高级金融学院研究生（在读）。现任深圳市益德置业有限公司总经理、深圳福元德租赁有限公司董事长兼总经理、深圳融博融资租赁有限公司董事长兼总经理、深圳市天汇鑫达担保有限公司总经理、深圳市亿尔德投资有限公司法人、嘉年实业股份有限公司董事、富荣基金管理有限公司董事。

李峰先生，独立董事，芝加哥大学会计学博士。现任职美国密歇根大学Ross商学院终身教授、上海交通大学上海金融学院访问教授、上海宏力达信息技术股份有限公司独立董事、银科投资控股有限公司独立董事、富荣基金管理有限公司独立董事。

林斌先生，独立董事，厦门大学经济学博士。现任中山大学管理学院会计学系教授、富荣基金管理有限公司独立董事。

余关健先生，独立董事，西南财经大学工业经济硕士研究生。曾任中国银行深圳分行信贷处处长、中国银行深圳分行风险管理处处长、深圳赛格、深圳特发集团董事、邦信资产管理公司董事总经理、对外贸易集团股份有限公司董事长、东方资产管理公司办事处总经理，现任东银实业（深圳）有限公司董事、深圳金田股份有限公司独立董事、富荣基金管理有限公司独立董事。

2、监事会成员

基金管理人不设监事会，设监事两名，其中一名为职工监事。

卢伟女士，监事，大专。在盈投控股有限公司任职，现任富荣基金管理有限公司监事。

毛志华先生，职工监事，本科。现任富荣基金管理有限公司监事。

3、高级管理人员

杨小舟先生，董事长，大连理工大学硕士研究生。历任交通银行沈阳分行国际部国际结算员、信贷科科长、中信银行沈阳皇姑支行副行长、广发银行南湖支行行长、广发银行沈阳直属支行行长助理、副行长、行长兼党委书记、广发银行沈阳分行行长兼党委书记、广发银行深圳分行行长兼党委书记。

郭容辰女士，总经理，北京大学法学硕士，历任交通银行深圳福田支行行长、深圳分行零售信贷部总经理、个人金融部总经理、华夏银行深圳分行个人金融部总经理、金鹰基金管理有限公司副总经理，现任富荣基金管理有限公司总经理。

苏春华先生，副总经理，首席投资官，中山大学硕士研究生，曾任广州期货贸易有限公司期货研究员、君安证券广州营业部高级分析员、光大银行广州证券部副经理兼研究室主任、广州银行资金营运中心总经理兼首席交易员，历任广东华兴银行金融市场部总经理、金融市场条线业务总监、总行副行长，现任富荣基金管理有限公司副总经理，首席投资官。

林峰先生，副总经理，法学专业本科。曾任中国银行广州分行行员、广州白云支行会计，民生银行广州分行会计结算科负责人、系统财务科科长，越秀支行行长，广东省农村信用社联合社历任资金调剂营运中心总经理助理、副总经理、负责人等，现任富荣基金管理有限公司副总经理。

李东育先生，副总经理，中山大学岭南学院EMBA硕士，曾任银河基金管理有限公司华南地区渠道销售销售总监，泰达宏利基金管理有限公司华南区总经理，金信基金管理有限公司总经理助理，华润元大基金管理有限公司总经理助理。现任富荣基金管理有限公司副总经理，分管市场、信息技术、基金事务管理等板块工作。

滕大江先生，督察长，中南大学工学学士，先后供职于平安证券、平安大华基金管理有限公司、前海开源基金管理有限公司监察稽核部门。现任富荣基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

邓宇翔先生，曾任西南证券股份有限公司资深投资经理、深圳展博投资有限公司投资经理、深圳东新佳投资有限公司投资经理。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

郭容辰女士，投资决策委员会召集人，公司董事、总经理。
苏春华先生，投资决策委员会副主任委员、副总经理、首席投资官。
林峰先生，投资决策委员会委员、副总经理。
吕晓蓉女士，投资决策委员会委员、基金经理。
邓宇翔先生，投资决策委员会委员、权益投资部总监、研究部总监、基金经理。
万方毅女士，投资决策委员会委员、固定收益部副总监。

6、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

1、基本情况
名称：招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"）
设立日期：1987年4月8日
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本：252.20亿元
法定代表人：李建红
行长：田惠宇
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号
电话：0755—83199084
传真：0755—83195201
资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2018年3月31日，本集团总资产62，522.38亿元人民币，高级法下资本充足率15.51%，权重法下资本充足率12.79%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工81人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值，独创"6S托管银行"品牌体系，以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖"，成为国内唯一获奖项国内托管银行；"托管通"获得国内《银行家》2016中国金融创新"十佳金融产品创新奖"；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】"最佳资产托管银行"；2017年6月再度荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖"，"全功能网上托管银行2.0"荣获《银行家》2017中国金融创新"十佳金融产品创新奖"；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖"，2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司"2017年度优秀资产托管机构"奖项，同月招商银行"托管大数据平台风险管理系统"荣获2016-2017年度银监会系统"金点子"方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖；3月招商银行荣获公募基金20年"最佳基金托管银行"奖。

二、主要人员情况

李建红先生，招商银行董事长、非执行董事，2014年7月起担任招商银行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，招商银行行长、执行董事，2013年5月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003 年7月至2013年5月历任上海银行副行长，中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，招商银行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任招商银行副行长；2016年11月起兼任招商银行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至2019年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管450只证券投资基金。

四、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全体人员参与。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现"内控优先"的要求，以有效防范各种风险作为内部控制的核心。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务操作流程、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构
名称：富荣基金管理有限公司直销中心
注册地址：广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20室
办公地址：深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场3501室
法定代表人：杨小舟
电话：0755-84356629
传真：0755-83230902
客服电话：4006855600
网站：www.furamc.com.cn

2、其他销售机构：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	包商银行股份有限公司	注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街6号 客服电话：95352 网站：www.bsb.com.cn
2	平安证券股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 客户服务电话：95511-8 网址：stock.pingan.com
3	国泰君安证券股份有限公司	注册(办公)地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼/上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦 客户服务电话：95521/4008888666 网址：www.gtja.com
4	世纪证券有限责任公司	注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层 客服电话：4008323000 网站：http://www.csco.com.cn
5	华鑫证券有限责任公司	注册(办公)地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01，B01（b）单元 客户服务电话：95323 网址：www.cfsc.com.cn
6	长城证券股份有限公司	注册（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 客户服务热线：0755-33680000、4006666 888 网址：www.cgws.com
7	五矿证券有限公司	注册(办公)地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层01单元 客户服务电话：4001840028 网址：www.wkzq.com.cn
8	上海基煜基金销售有限公司	办公地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室 客服电话：400-820-5369 公司网址：www.jiyufund.com.cn
9	上海好买基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯大厦9楼 客服电话：400-700-9665 公司网址：www.ehowbuy.com
10	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 客户服务电话：400 076 6123 网址：www.fund123.cn
11	浙江同花顺基金销售有限公司	注册(办公)地址：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼 客户服务电话：400-877-3772 网址：www.5ifund.com
12	上海陆金所资产管理有限公司	办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元 客服电话：4008219031 公司网址：www.lufunds.com
13	上海联泰资产管理有限公司	办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 客服电话：4000466788 公司网址：www.66zichan.com
14	上海天天基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 客服电话：4001818188 公司网址：fund.eastmoney.com
15	珠海盈米财富管理有限公司	办公地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 客服电话：020-89629066 公司网址：www.yingmi.cn
16	上海长量基金销售投资顾问有限公司	办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层 客服电话：400-820-2899 公司网站：www.erichfund.com
17	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 客服电话：40081661188 公司网址：8.jrj.com.cn/
18	泰诚财富基金销售（大连）有限公司	注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号 客户服务电话：4006411999 网址：www.taichengcaifu.com
19	济安财富（北京）基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层 客户服务电话：400-673-7010 网址：www.jianfortune.com
20	金惠家保险代理有限公司	注册(办公)地址：北京市西城区阜成门外大街2号19层A2017 客户服务电话：400-1060101 网址：www.jhjfund.com
21	民商基金销售（上海）有限公司	注册(办公)地址：上海黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室 客户服务电话：021-50206003 网址：http://www.msftec.com
22	大连网金基金销售有限公司	注册(办公)地址：大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层 客户服务电话：4000-899-100 网址：http://www.yibaijin.com/
23	扬州国信嘉利基金销售有限公司	注册(办公)地址：扬州市广陵新城信息产业基地3期20B栋 客户服务电话：400 021 6088 网址：www.gxjlcn.com
24	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 客户服务电话：4006-788-887 网址：众禄基金网www.zlfund.cn 基金买卖网www.jjmmw.com
25	北京蛋卷基金销售有限公司	注册（办公）地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 客户服务电话：400 0618 518 网址：http://danjuanapp.com/
26	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 客户服务电话：400-786-8868-5 网址：www.chtfund.com
27	深圳前海财厚基金销售有限公司	办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室 客户服务电话：400-128-6800 网址：caiho.cn
28	深圳盈信基金销售有限公司	注册(办公)地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1（811-812） 客户服务电话：4007-903-688 网址：http://www.fundying.com/
29	上海挖财基金销售有限公司	注册(办公)地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室 客户服务电话：400-711-8718 网址：www.wacaijijin.com
30	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋 客户服务电话：400－821－5399 网址：www.noah-fund.com
31	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 客户服务电话：4006433389 网址：www.vstonewealth.com
32	泰信财富基金销售有限公司	注册(办公)地址：北京市朝阳区建国路甲92号世贸大厦C座18层 客户服务电话：400-004-8821 网址：www.hxlc.com

（二）登记机构
名称：富荣基金管理有限公司
住所：广东省广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20
办公地址：深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场3501室
法定代表人：杨小舟
联系人：黄文飞
电话：0755-84356604
传真：0755-83230787

（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
经办律师：安冬陆奇
联系人：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（特殊普通合伙）
住所：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
法定代表人：毛鞍宁
电话：+86 10 58153000
传真：+86 10 85188298
签字注册会计师：吴翠蓉　高鹤
联系人：吴翠蓉

四、基金的名称

基金的名称：富荣沪深300指数增强型证券投资基金。

五、基金的类型

基金的类型：股票型证券投资基金。

六、基金的投资

一、投资目标

本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

二、投资范围

本基金主要投资于沪深300指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、地方政府债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单等)、权证、资产支持证券、股指期货以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相关规定)。

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，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与沪深300指数偏离风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争控制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%，年跟踪误差不超过8.0%。

1、股票投资策略

（1）指数化投资策略

本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。

（2）指数增强型策略

本基金数量化投资分析将基于标的指数的编制及调整方法，并参考标的指数行业构成和成份股的权重占比，结合成份股之间的相对价值、个股的短期市场机会以及流动性等指标进行分析。本基金使用数量化模型，对净利润、净利润同比增长率、市盈率、上年同期净利润同比增长、上年净利润同比增长率二阶增速、净资产收益率、个股收益率等因子进行建模，选取具有良好增长能力的股票构建股票组合。

本基金使用均值方差模型，优化股票权重，达到指数增强效果。

本基金还将分析标的指数成份股的基本面状况和竞争优势，定期跟踪成份股股票财务报表变化状况，对其盈利的可持续性和增长能力进行分析判断和预测，以此作为本基金调整股票组合和股票权重的参考。

除标的指数成份股之外，本基金亦可适当投资于一些基本面较好、股价被较大低估、存在重大投资机会的非成份股提高收益水平。

2、债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

3、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

5、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

未来随着证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资沪深300指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

（10）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（15）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（16）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；基金投资于中小企业私募债的比例不超过基金资产净值的20%；

（17）本基金参与股指期货交易，需遵守下列规定：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

4）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

5）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；

（18）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（19）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（20）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；
（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
（5）向其基金管理人、基金托管人出资；
（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

由于本基金为跟踪沪深300指数的指数型基金，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。沪深300指数是由中证指数有限公司开发的中国A 股市场指数，由上海和深圳证券市场中市值大、流动性好的300只股票组成，综合反映中国A股市场上市股票价格的整体表现。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其它指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数及投资对象，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。

若变更标的指数（及相应变更业绩比较基准）涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数（及相应变更业绩比较基准）召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并及时在指定媒介上公告。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），基金管理人经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后变更并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

六、风险收益特征

基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于证券投资基金中中高等风险、中高等预期收益的品种。本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

七、基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019 年8月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	129，356，012.62	90.00
	其中：股票	129，356，012.62	90.00
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	684，684.00	0.48
	其中：债券	684，684.00	0.48
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	13，665，614.87	9.51
8	其他资产	23，206.86	0.02
9	合计	143，729，518.35	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	1，481，018.00	1.03
B	采矿业	–	–
C	制造业	53，775，019.58	37.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4，765，600.00	3.32
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	18，716，839.62	13.05
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1，875，100.00	1.31
J	金融业	13，648，749.76	9.52
K	房地产业	2，050，572.00	1.43
L	租赁和商务服务业	11，579，711.00	8.07
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	11，157，809.66	7.78
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	119，050，419.62	83.01

（2）报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	1，214，929.00	0.85
B	采矿业	10，650.00	0.01
C	制造业	7，594，283.00	5.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	394，476.00	0.28
J	金融业	100，594.00	0.07
K	房地产业	990，661.00	0.69
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	10，305，593.00	7.19

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

3、报告期末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

（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	601888	中国国旅	130，300	11，551，095.00	8.05
2	300015	爱尔眼科	360，278	11，157，809.66	7.78
3	600009	上海机场	130，037	10，894，499.86	7.60
4	600519	贵州茅台	10，823	10，649，832.00	7.43
5	000858	五粮液	83，800	9，884，210.00	6.89
6	600809	山西汾酒	133，345	9，207，472.25	6.42
7	600585	海螺水泥	207，700	8，619，550.00	6.01
8	600233	圆通速递	592，672	7，307，645.76	5.10
9	600886	国投电力	565，300	4，392，381.00	3.06
10	002142	宁波银行	172，999	4，193，495.76	2.92

（2）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	002677	浙江美大	132，900	1，748，964.00	1.22
2	002223	鱼跃医疗	67，450	1，660，619.00	1.16
3	603899	晨光文具	23，500	1，033，295.00	0.72
4	600007	中国国贸	67，900	990，661.00	0.69
5	600801	华新水泥	47，100	953，775.00	0.67

4 、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	684，684.00	0.48
	其中：政策性金融债	684，684.00	0.48
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	684，684.00	0.48

5、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	108901	农发1801	6，840	684，684.00	0.48

6、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1） 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

（2） 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

（3） 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3） 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7，513.55
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	14，901.00
5	应收申购款	792.31
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	23，206.86

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

②期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限股票。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

九、基金净值表现

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)、转型后

1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富荣沪深300指数增强A净值表现

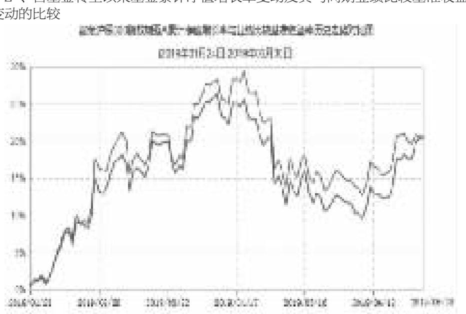
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.31%	1.43%	–1.11%	1.45%	1.42%	–0.02%
2019.01.24-2019.06.30	20.47%	1.46%	20.69%	1.53%	–0.22%	–0.07%

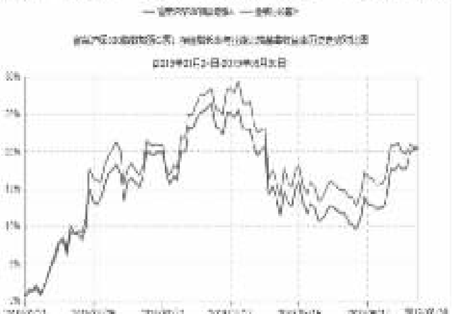
富荣沪深300指数增强C净值表现

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
过去三个月	0.29%	1.43%	–1.11%	1.45%	1.40%	–0.02%
2019.01.24-2019.06.30	20.41%	1.47%	20.69%	1.53%	–0.28%	–0.06%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

2 、自基金转型以来基金累计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：本基金于2019年1月24日转型，截止报告期末，基金转型不满6个月，仍处于建仓期。

(二)、转型前

1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金A级基金净值表现

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
2019.01.01-2019.01.23	1.56%	0.48%	1.94%	0.32%	–0.38%	0.16%
自基金合同生效起至2018.12.31	–29.07%	0.90%	–1.32%	0.40%	–27.75%	0.50%
自基金合同生效起至2019.01.23	–27.96%	0.88%	0.59%	0.40%	–28.55%	0.48%

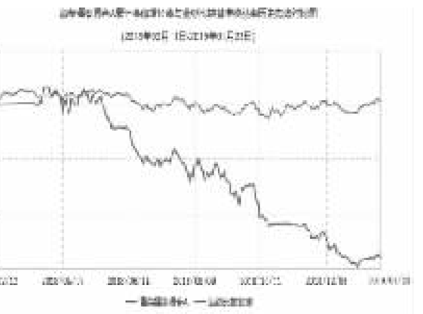
富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金C级基金净值表现

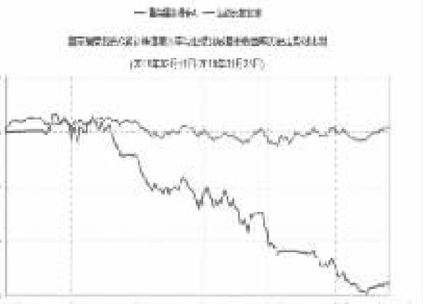
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.01.01-2019.01.23	1.57%	0.48%	1.94%	0.32%	–0.37%	0.16%
自基金合同生效起至2018.12.31	–29.15%	0.90%	–1.32%	0.40%	–27.83%	0.50%
自基金合同生效起至2019.01.23	–28.04%	0.88%	0.59%	0.40%	–28.63%	0.48%

注：①本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30% ；

②本基金于2019年1月24日转型，本报告期本基金实际报告期间为2019年1月1日至2019年1月23日

2 、自基金合同生效以来基金累计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：本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各资产配置比例符合合同约定。七、基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、C类基金份额的销售服务费；
4、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券、期货交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、基金的账户开户费用、账户维护费用；
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。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.6%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.1%。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，销售服务费计提的计算公式如下：

H=E×0.1%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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。

4、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.016%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

H=E×0.016%÷当年天数
H 为每日应计提的标的指数许可使用费
E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足50，000 元的，按 50，000 元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告并书面通知托管人。

上述"一、基金费用的种类"中第5－11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；
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、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

八、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人原公告的本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、对"重要提示"部分内容进行了更新；
2、对"三、基金管理人"部分内容进行了更新；
3、对"四、基金托管人"部分内容进行了更新；
4、对"五、相关服务机构"部分内容进行了更新；
5、对"八、基金份额的申购与赎回"部分内容进行了更新；
6、对"九、基金的投资"部分内容进行了更新；
7、对"二十一、其他应披露事项"部分内容进行了更新。

富荣基金管理有限公司
二〇一九年九月四日