

2020年5月14日 星期四

(上接B080版)

法人代表: 杨健
联系人: 李海燕
客服电话: 400-673-7010
公司网站: www.jianfortune.com

(66) 上海联泰基金销售有限公司
注册地址: 中国 上海-自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路618号6座3楼
法人代表: 燕斌
联系人: 凌秋艳
客服电话: 400-046-6788
公司网站: www.66zichan.com

(67) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长兴镇绿园公路1800号2号楼6153室 上海泰和经济发展

区 办公地址: 上海市杨浦区昆明路618号A1002室
法人代表: 王翔
联系人: 蓝杰
客服电话: 400-820-5369
公司网站: www.jiuyufund.com.cn

(68) 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
法人代表: 陈继武
联系人: 李晓明
客服电话: 4000-178-000
公司网站: www.lingxinfund.com

(69) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法人代表: 鲍东华
联系人: 宁博宇
客服电话: 4008-219-031
公司网站: www.lufunds.com

(70) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法人代表: 肖斐
联系人: 黄敏娥
客服电话: 020-89629066
公司网站: www.yingmi.cn

(71) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址: 北京市宣武门外大街1号环球财讯中心A座5层
法人代表: 彭运年
联系人: 陈珍珍
客服电话: 400-8909-998
公司网站: www.jnlc.com

(72) 北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
法人代表: 江卉
联系人: 徐伯宇
客服电话: 95118
公司网站: http://fund.kt.com/

(73) 大连网金基金销售有限公司
注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法人代表: 奚尔东
联系人: 贾伟刚
客服电话: 4000-899-100
公司网站: www.yibaijin.com

(74) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

1108 办公地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
1108 法人代表: 赖军任
联系人: 邓欣霞
客服电话: 400-930-0660
公司网站: www.jifinv.com

(75) 北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号6号楼2单元21层
办公地址: 北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507
法人代表: 钟斐斐
联系人: 威晓强
客服电话: 4000-618-519
公司网站: danjuanapp.com

(76) 银滚滚财富投资管理上海有限公司
注册地址: 中国 上海-自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 729S
办公地址: 上海市浦东新区商城路 618 号良友大厦 B301-305 室
法人代表: 许欣
联系人: 唐硕颖
客服电话: 400-700-9700
公司网站: www.qiangqun.com

(77) 上海华夏财富基金管理有限公司
注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法人代表: 李一梅
联系人: 仲秋月
客服电话: 400-817-5666
公司网站: www.amcfortune.com

(三) 场内销售机构
本基金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、基金登记机构
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) 50938782
传真: (010) 50938891
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、审计基金财产的会计师事务所
名称: 安永华明会计师事务所
住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场东经贸城安永大楼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
富国中证国有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国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额(即“富国国企改革份额”)、富国中证国有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”)和富国中证国有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份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

第七部分 基金份额的配对转换
本基金基础份额生后,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成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份额申请转换成2份富国国企改革B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,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绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

第九部分 基金投资策略
本基金将具有良好流动性的金融工具,包括中证国有企业改革指数的成份股、备选成份股、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、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押和抵押式回购、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的相关规定)。

如法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为: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备选成份股的资产不低于非现金基金资产的50%,每个交易日终在港股通指期货合约缴纳的保证金后,现金或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。如果法律法规对该比例有变更的,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,依托国金量化投资平台,利用长期稳定的风险模型和交易基本模型,按照中证国有企业改革指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,并根据指数成份及其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备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,每个交易日终在港股通指期货合约缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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。

本基金管理人将按照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。本基金的股票资产投资组合及其权重的变动进行相应调整。本基金的股票资产投资组合,并根据指数成份及其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备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,每个交易日终在港股通指期货合约缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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。

1、资产配置策略
本基金管理人将按照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。本基金的股票资产投资组合及其权重的变动进行相应调整。本基金的股票资产投资组合,并根据指数成份及其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备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,每个交易日终在港股通指期货合约缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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。

2、股票投资组合构建
(1) 组合构建方法
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收益表现。

(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组成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、

申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以保证基金净值增长率与中证国有企业改革指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

①定期调整
根据中证国有企业改革指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

②不定期调整
A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪中证国有企业改革指数;

C. 根据法律法规、规定的规定,成份股在中证国有企业改革指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指一致。

3、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政策等因素对债券市场的影响,进行利率预期,判断债券市场的基本走势,制定久期策略、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调整、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金流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,降低跟踪误差。

4、衍生品投资策略
在法律法规许可的情况下,本基金可以依法投资权证、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,以控制和降低投资组合风险、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。

本基金投资股票期权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。本基金将充分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。

基金管理人将建立股指期货交易决策部小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制制度并报董事会批准。

第十一部分 标的指数与基金业绩比较基准

1、标的指数
本基金的标的指数是中证国有企业改革指数。

如果标的指数停止编制或发布,或标的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标的指数不能继续作为标的指数,或证券市场上有更广泛、更合适的投资指数推出,本基金管理人可以依法审慎原则和维护基金份额持有人合法权益的指数组合进行替代,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众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,若标的指数变更涉及本系列基金的投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更后的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案,并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响但可能导致但不限于编制机制变更、指数更名等,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后报中国证监会备案,并在指定媒介上公告。

2、业绩比较基准
95%×中证国有企业改革指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)

由于本基金投资的指数为中证国有企业改革指数,且每个交易日终在扣除港股通指期货合约缴纳的保证金后,投资于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%,因此,本基金将业绩比较基准定为95%×中证国有企业改革指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)。

如果今后法律法规发生变化,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,本基金可以在与基金托管人协商一致后,依法变更本基金的业绩比较基准及基金投资范围,并报中国证监会备案,并在指定媒介上公告。

第十二部分 基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金来看,富国国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;富国国企改革B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

第十三部分 投资组合报告

一、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 5,263,974,363.67 93.66

其中:股票 5,263,974,363.67 93.66

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

货币市场基金 - -

3 贵金属投资 - -

4 贵金属衍生品投资 - -

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 银行存款和结算备付金合计 354,283,563.87 6.30

7 其他资产 1,829,184.15 0.03

8 合计 5,620,087,111.69 100.00

二、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 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 1,778,498.21 0.03

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发零售业 19,147.31 0.00

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 3,848,511.86 0.07

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务业 17,552.98 0.00

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 卫生和计划生育 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 5,663,710.36 10.10

三、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(%)