富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)(摘要)

(二O一四年第二号)

富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")由中国证券监督委员会于2011年7月14日证监许可【2011】1095号文核准。本基金的基金合同于2011年10月12日正式生效。

【重要提示】

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。投资有风险,基金投资者认购(或申购)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和产品特性,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。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。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。

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》、《运作办法》、基金合同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2014年10月12日,基金投资组合报告和基金业绩表现等相关财务数据截止至2014年6月30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

注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

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:陈敏

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:范伟隽

注册资本:1.8亿元人民币

股权结构(截止于2014年10月12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。

公司目前下设十九个部门、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、量化与海外投资部、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、行政管理部、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;量化与海外投资部:负责量化权益投资、量化衍生品投资及境外权益等各类投资的研究与投资管理;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、华南营销中心(广州分公司)、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;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒体关系管理,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;行政管理部:负责文秘、行政后勤;富国资产管理(香港)有限公司: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2014年10月12日,公司有员工269人,其中60%以上具有硕士以上学历。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

陈敏女士,董事长。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。

陈戈先生,董事,总经理。中共党员,硕士,1996年起开始从事证券行业工作。曾任国泰君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、权益投资部总经理、富国基金管理有限公司副总经理。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,2014年1月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金融集团亚洲业务总经理(General Manager, Asia, International, BMO Financial Group)。

裴长江先生,董事。中共党员,硕士。历任石油部第四石油机械厂工会主席;上海万国证券公司研究员、营业部总经理助理、营业部总经理;申银万国证券公司浙江管理总部副总经理、申银万国证券公司经纪总部副总经理;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、总经理。现任海通证券股份有限公司副总经理。

方荣义先生,董事。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。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金融集团国际业务全球总裁(SVP & Managing Director, International, BMO Financial Group)。

岳增光先生,董事。中共党员,本科硕士,高级会计师。历任山东省济南市经济发展总公司会计;山东正源和信有限责任会计师事务所室主任;山东鲁信实业集团公司财务;山东省鲁信投资控股集团有限公司财务。现任山东省国际信托有限公司财务部经理。

戴国强先生,独立董事。博士学位。历任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,金融学院副院长、常务副院长、院长;上海财经大学教授、博士生导师,金融学院党委书记,教授委员会主任。现任上海财经大学MBA学院院长、党委书记。

伍时焯(Cary S. Ng)先生,独立董事。工商管理硕士,加拿大特许会计师。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。现任圣力嘉学院(Seneca College)工商系会计及财务金融科教授。

李宪明先生,独立董事。中共党员,博士。历任吉林大学法学院教师。现任上海市锦天城律师事务所律师、高级合伙人。

2、监事会成员

金同水先生,监事长。大学本科。历任山东省国际信托有限公司科员、项目经理、业务经理;鲁信投资有限公司财务经理;山东省国际信托有限公司高级业务经理。现任山东省国际信托有限公司风险管理部经理。

沈寅先生,监事。法学学士。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。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。

仇夏萍女士,监事。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部副总经理。

李燕女士,监事。硕士。历任国信证券有限公司、富国基金管理有限公司基金会计、基金会计主管。现任富国基金管理有限公司运营总监助理。

孙琪先生,监事。学士。历任杭州恒生电子股份公司、东吴证券有限公司,富国基金管理有限公司系统管理员、系统管理主管。现任富国基金管理有限公司IT总监助理。

唐洁女士,CFA,监事。中共党员,硕士。历任上海夏商投资咨询有限公司研究员,富国基金管理有限公司研究助理、助理研究员。现任富国基金管理有限公司策略研究员。

3、督察长

范伟隽先生,督察长。中共党员,硕士研究生。曾任毕马威华振会计师事务所项目经理,中国证监会上海监管局主任科员、副处长。2012年10月20日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

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,副总经理。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。

陆文佳女士,副总经理。中共党员,硕士研究生。曾在中国建设银行上海市分行历任分支行职员、经理。曾在华安基金管理有限公司历任市场业务一部投资顾问、上海机构业务部总监助理、市场部总监助理、上海业务部总经理、市场部总经理、公司副营销总裁。2014年6月19日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,北京大学学士,普林斯顿大学硕士,斯坦福大学博士。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(MSCIBARRA),BARRA股票风险评估部高级研究员;巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal 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6月加入富国基金管理有限公司,2009年12月至今任富国沪深300增强证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年5月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,2011年10月至今任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理;兼任量化与海外投资部总经理。

徐幼华,复旦大学硕士研究生。曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理;2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员,2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理,2011年5月起任富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金(自2012年4月18日起正式更名为"富国中证红利指数增强型证券投资基金")基金经理,2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。

(注:本公司已于2014年11月20日发布《富国基金管理有限公司关于富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理变更的公告》,自2014年11月19日起增聘方旻先生为本基金基金经理)

6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下:公司总经理陈戈先生,权益投资部总经理朱少醒先生,固定收益投资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)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:蒋超良

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-68121510

传真:010-68121816

联系人:李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营,可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"'金牌理财'TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2014年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共227只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海日日收益货币市场基金、景顺长城景盈货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深300指数型证券投资基金、前海开源沪深300指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、招商招利1个月期理财债券型证券投资基金。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

(一)销售机构

1、场外销售机构

(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:陈敏

总经理:陈戈

直销网点:上海投资理财中心

上海投资理财中心地址:上海市杨浦区大连路588号宝地广场A座23楼

客户服务统一咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

传真:021-20361544

联系人:林燕珏

公司网站:www.fullgoal.com.cn

(2)场外代销机构

(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
法人代表: 姜建清
联系电话: (010)66107900
传真电话: (010)66107914
联系人员: 杨菲
客服电话: 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: 北京市东城区建国门内大街69号
法人代表: 蒋超良
联系电话: (010)85108227
传真电话: (010)85109219
联系人员: 曾艳
客服电话: 95599
公司网站: www.abchina.com

(3) 中国建设银行股份有限公司
注册地址: 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
法人代表: 王洪章
联系电话: (010)66275654
传真电话: 010—66275654
联系人员: 张静
客服电话: 95533
公司网站: www.ccb.com

(4) 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
法人代表: 胡怀邦
联系电话: (021)58781234
传真电话: (021)58408483
联系人员: 曹榕
客服电话: 95559
公司网站: www.bankcomm.com

(5) 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
法人代表: 李建红
联系电话: (0755)83198888
传真电话: (0755)83195109
联系人员: 曾里南
客服电话: 95555
公司网站: www.cmbchina.com

(6) 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
法人代表: 常振明
联系电话: (010)65550827
传真电话: (010)65550827
联系人员: 丰靖
客服电话: 95558
公司网站: bank.ecitic.com

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址: 上海市北京东路689号
法人代表: 吉晓辉
联系电话: (021)61616150
传真电话: (021)63604199
联系人员: 唐苑
客服电话: 95528
公司网站: www.spdb.com.cn

(8) 中国民生银行股份有限公司
注册地址: 北京市东城区正义路4号
办公地址: 北京市西城区复兴门内大街2号
法人代表: 董文标
联系电话: (010)58351666
传真电话: (010)57092611
联系人员: 杨成茜
客服电话: 95568
公司网站: www.cmbc.com.cn

(9) 上海银行股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区银城中路168号
办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号
法人代表: 范一飞
联系电话: (021)68475888
传真电话: (021)68476111
联系人员: 龚厚红
客服电话: (021)962888
公司网站: www.bankofshanghai.com

(10) 宁波银行股份有限公司
注册地址: 宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址: 宁波市鄞州区宁南南路700号
法人代表: 陆华裕
联系电话: 0574-89068340
传真电话: 0574-87050024
联系人员: 胡技勋
客服电话: 96528(上海、北京地区962528)
公司网站: www.nbcb.com.cn

(11) 天相投资顾问有限公司
注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法人代表: 林义相
联系电话: 010-66045529
传真电话: 010-66045518
联系人员: 尹伶
客服电话: 010-66045678
公司网站: www.txsec.com

(12) 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
法人代表: 万建华
联系电话: (021)38670666
传真电话: (021)38670666
联系人员: 芮敏琪
客服电话: 400-8888-666
公司网站: www.gtja.com

(13) 中信建投证券股份有限公司
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
法人代表: 王常青
联系电话: (010)65183888
传真电话: (010)65182261
联系人员: 权唐
客服电话: 400-8888-108
公司网站: www.csc108.com

(14) 国信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法人代表: 何如
联系电话: (0755)82130833
传真电话: (0755)82133952
联系人员: 齐晓燕
客服电话: 95536
公司网站: www.guosen.com.cn

(15) 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39—45层
办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
法人代表: 宫少林
联系电话: (0755)82943666
传真电话: (0755)82943636
联系人员: 林生迎
客服电话: 95565、400-8888-111
公司网站: www.newone.com.cn

(16) 广发证券股份有限公司
注册地址: 广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(43
办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38
法人代表: 孙树明
联系电话: (020)87555305
传真电话: (020)87555305
联系人员: 黄岚
客服电话: 95575
公司网站: www.gf.com.cn

(17) 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
法人代表: 陈有安
联系电话: (010)66568430
传真电话: (010)66568990
联系人员: 田薇
客服电话: 4008-888-888
公司网站: www.chinastock.com.cn

(18) 海通证券股份有限公司
注册地址: 上海市广东路689号
办公地址: 上海市广东路689号
法人代表: 王开国
联系电话: (021)23219000
传真电话: (021)23219000
联系人员: 李笑鸣
客服电话: 95553
公司网站: www.htsec.com

(19) 申银万国证券股份有限公司
注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址: 上海市常熟路171号
法人代表: 储晓明
联系电话: (021)54033888
传真电话: (021)54038844
联系人员: 王序微
客服电话: (021)962505
公司网站: www.sywg.com

(20) 长江证券股份有限公司
注册地址: 武汉新华路特8号长江证券大厦
办公地址: 武汉新华路特8号长江证券大厦
法人代表: 杨泽柱
联系电话: (027)65799999
传真电话: 027-85481900
联系人员: 李良
客服电话: 95579或4008-888-999
公司网站: www.95579.com

(21) 安信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02
办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02
法人代表: 牛冠兴
联系电话: (0755)82558305
传真电话: (0755)82558002
联系人员: 陈剑虹
客服电话: 400-800-1001
公司网站: www.essence.com.cn

(22) 华泰证券股份有限公司
注册地址: 江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址: 江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法人代表: 吴万善
联系电话: 0755-82569143
传真电话: 0755-82492962
联系人员: 孔晓君
客服电话: 95597
公司网站: www.htsc.com.cn

(23) 信达证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法人代表: 张志刚
联系电话: 010-63080985
传真电话: 01063080978
联系人员: 唐静
客服电话: 400-800-8899
公司网站: www.cindasc.com

(24) 东方证券股份有限公司
注册地址: 上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址: 上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层
法人代表: 潘鑫军
联系电话: 021-63325888
传真电话: 021-63326729
联系人员: 胡月茹
客服电话: 95503
公司网站: www.dfzq.com.cn

(25) 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
法人代表: 薛峰
联系电话: 021-22169999
传真电话: 021-22169999
联系人员: 刘晨
客服电话: 95525
公司网站: www.ebscn.com

(26) 上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
法人代表: 龚德雄
联系电话: (021)53519888
传真电话: (021)53519888
联系人员: 张瑾
客服电话: (021)962518
公司网站: www.962518.com

(27) 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
法人代表: 杨宇翔
联系电话: 95511-8
传真电话: 95511-8
联系人员: 郑舒丽
客服电话: 95511-8
公司网站: www.pingan.com

(28) 国海证券股份有限公司
注册地址: 广西桂林市辅星路13号
办公地址: 广东省深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F
法人代表: 张雅锋
联系电话: (0755)83709350
传真电话: (0755)83704850
联系人员: 牛孟宇
客服电话: 95563
公司网站: www.ghzq.com.cn

(29) 国都证券有限责任公司
注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10
办公地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10
法人代表: 常喆
联系电话: (010)84183333
传真电话: (010)84183311-3389
联系人员: 黄静
客服电话: 400-818-8118
公司网站: www.guodu.com

(30) 宏源证券股份有限公司
注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街19号
法人代表: 冯戎
联系电话: 010-88085858
传真电话: 010-88085858
联系人员: 李巍
客服电话: 4008-000-562
公司网站: www.hysec.com

(31) 齐鲁证券有限公司
注册地址: 济南市经七路86号
办公地址: 济南市经七路86号23层
法人代表: 李玮
联系电话: 0531—68889155
传真电话: 0531—68889185
联系人员: 吴阳
客服电话: 95538
公司网站: www.qlzq.com.cn

(32) 金元证券股份有限公司
注册地址: 海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址: 深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法人代表: 陆涛
联系电话: 0755-83025022
传真电话: 0755-83025625
联系人员: 马贤清
客服电话: 400-8888-228
公司网站: www.jyzq.cn

(33) 华福证券有限责任公司
注册地址: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法人代表: 黄金琳
联系电话: 0591-87383600
传真电话: 0591-87383610
联系人员: 张宗锐
客服电话: 96326(福建省外请先拨0591)
公司网站: www.hfzq.com.cn

(34) 华龙证券有限责任公司
注册地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
办公地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法人代表: 李晓安
联系电话: 0931-4890208
传真电话: (0931)4890628
联系人员: 李昕田
客服电话: (0931)96668、4006898888
公司网站: www.hlzqgs.com

(35) 瑞银证券有限责任公司
注册地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、
办公地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、
法人代表: 程宜荪
联系电话: (010)58328888
传真电话: (010)58328112
联系人员: 牟冲
客服电话: 4008878827
公司网站: www.ubssecurities.com

(36) 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
法人代表: 孙名扬
联系电话: 0451-85863696
传真电话: 0451-82287211
联系人员: 张背北
客服电话: 400-666-2288
公司网站: www.jhzq.com.cn

(37) 和讯信息科技有限公司
注册地址: 北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼
法人代表: 王莉
联系电话: 400-920-0022
传真电话: 021-20835879
联系人员: 于杨
客服电话: 400-920-0022
公司网站: licaike.hexun.com

(38) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表: 其实
联系电话: 021-54509998
传真电话: 021-64385308
联系人员: 潘世友
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn

(39) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903~906室
法人代表: 杨文斌
联系电话: (021)58870011
传真电话: (021)68596916
联系人员: 张茹
客服电话: 4007009665
公司网站: www.ehowbuy.com

(40) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址: 杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法人代表: 陈柏青
联系电话: 021- 60897840
传真电话: 0571-26697013
联系人员: 张裕
客服电话: 4000766123
公司网站: www.fund123.cn

(41) 嘉实财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表: 赵学军
联系电话: 021-20289890
传真电话: 021-20280110
联系人员: 张倩
客服电话: 400-021-8850
公司网站: www.harvestwm.cn

(42) 中国光大银行股份有限公司
注册地址: 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址: 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法人代表: 唐双宁
联系电话: 010-63636153
传真电话: 010-63639709
联系人员: 朱红
客服电话: 95595
公司网站: www.cebbank.com

(43) 北京银行股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址: 北京市西城区金融大街丙17号
法人代表: 闫冰竹
联系电话: 010-66223587
传真电话: 010-66226045
联系人员: 谢小华
客服电话: 95526
公司网站: www.bankofbeijing.com.cn

(44) 东莞银行股份有限公司
注册地址: 东莞市莞城区体育路21号
办公地址: 东莞市莞城区体育路21号
法人代表: 廖玉林
联系电话: 0769-22100193
传真电话: 0769-22117730
联系人员: 巫渝峰
客服电话: 0769-96228
公司网站: www.dongguanbank.cn

(45) 湘财证券股份有限公司
注册地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心
办公地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心
法人代表: 林俊波
联系电话: 021-68634510-8620
传真电话: (021)68865680
联系人员: 赵小明
客服电话: 400-888-1551
公司网站: www.xcsc.com

(46) 国元证券有限责任公司
注册地址: 合肥市寿春路179号
办公地址: 合肥市寿春路179号
法人代表: 蔡咏
联系电话: (0551)62207935
传真电话: (0551)62207935
联系人员: 李蔡
客服电话: 95578
公司网站: www.gyzq.com.cn

(47) 渤海证券股份有限公司
注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址: 天津市南开区宾水西道8号
法人代表: 杜庆平
联系电话: 022-28451709
传真电话: 022-28451892
联系人员: 胡天彤
客服电话: 400-651-5988
公司网站: www.bhzq.com

(48) 山西证券股份有限公司
注册地址: 太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址: 太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法人代表: 侯巍
联系电话: 0351—8686659
传真电话: 0351—8686659
联系人员: 郭熠
客服电话: 400-666-1618、95573
公司网站: www.i618.com.cn

(49) 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: 大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法人代表: 张智河
联系电话: 0411-39673202
传真电话: 0411-39673219
联系人员: 谢立军
客服电话: 4008-169-169
公司网站: www.datong.com.cn

(50) 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
法人代表: 田国立
联系电话: (010)66594946
传真电话: (010)66594946
联系人员: 陈洪源
客服电话: 95566
公司网站: www.boc.cn

(51) 中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街3号
办公地址: 北京市西城区金融大街3号
法人代表: 李国华
联系电话: (010)68858057
传真电话: (010)68858057
联系人员: 王硕
客服电话: 95580
公司网站: www.psbc.com

(52) 方正证券股份有限公司
注册地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法人代表: 雷杰
联系电话: (010)57398062
传真电话: (010)57398058
联系人员: 徐锦福
客服电话: 95571
公司网站: www.foundersc.com

(53) 中原证券股份有限公司
注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
法人代表: 菅明军
联系电话: 0371—65585670
传真电话: 0371——65585665
联系人员: 程月艳
客服电话: 0371-967218、400-813-9666
公司网站: www.ccnew.com

(54) 中国国际金融有限公司
注册地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址: 北京市建国门外大街甲6号SK大厦3层
法人代表: 李剑阁
联系电话: 010-65051166
传真电话: 010-65051166
联系人员: 陶亭
客服电话: 010-65051166
公司网站: http://www.cicc.com.cn

(55) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼
法人代表: 汪静波
联系电话: 021-3860-0672
传真电话: 021-3860-2300
联系人员: 张姚杰
客服电话: 400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com

(56) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、
法人代表: 薛峰
联系电话: 0755-33227950
传真电话: 0755-82080798
联系人员: 汤素娅
客服电话: 4006-788-887
公司网站: 众禄基金网 www.zlfund.cn 基金买卖网 www.jjmmw.c

(57) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法人代表: 张跃伟
联系电话: 021-58788678 -8201,13585790204
传真电话: 021—58787698
联系人员: 沈雯斌
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

(58) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法人代表: 闫振杰
联系电话: (010)62020088
传真电话: (010)62020088
联系人员: 宋丽冉
客服电话: 4008886661
公司网站: www.myfund.com

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。

2、场内代销机构

本基金的场内代销机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区太平桥大街17号

办公地址:北京西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:(010)59378839

传真:(010)59378907

联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

住所:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人:廖海

电话:(021)51150298

传真:(021)51150398

联系人:廖海

经办律师:梁丽金、刘佳

(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

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

四、基金的名称

富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金,在力求对中证500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(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。其中,股票资产投资比例不低于基金资产的90%,投资于中证500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。

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中证500指数。中证500指数是中证指数有限公司为反映市场上不同规模特征股票的整体表现,以沪深300指数为基础,构建的包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大中小盘指数在内的规模指数体系中的组成部分。中证500指数全称"中证小盘500指数",它的样本选自沪深两个证券市场,其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票,综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

如果中证500指数被停止编制及发布,或中证500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中证500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,基金管理人将于变更后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。其选股范围将以成份股为主,并包括非成份股中与成份股相关性强,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。中证指数公司每半年审核一次中证500指数成份股。本基金将按照中证500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,当中证500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次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。

调整期间原则上定为:中证指数公司调整决定公布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%×中证500指数收益率+1%(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	151,531,515.53	93.14
	其中:股票	151,531,515.53	93.14
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	11,010,605.80	6.77
7	其他资产	150,084.81	0.09
8	合计	162,692,206.14	100.00

(下转B23版)

富国基金管理有限公司关于调整旗下基金所持"11萧国资"估值方法的提示性公告

2014年11月24日,富国基金管理有限公司(以下简称"本公司")旗下富国天利增长债券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金持有的上交所上市交易债券"11萧国资"(债券代码:122761),交易极不活跃,收盘价格异常。为保护投资者的利益,根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》([2008]38号),并与基金托管银行协商一致,决定自2014年11月24日起,对本公司旗下证券投资基金持有的"11萧国资"按照估值技术予以估值。

本公司将综合参考有关影响因素并与基金托管人协商,自该债券当日交易所收盘价能体现公允价值特征之日起,对其恢复按交易所收盘价进行估值,届时不再另行公告。

特此公告!

富国基金管理有限公司

二O一四年十一月二十五日