富国富钱包货币市场基金招募说明书（更新）（摘要）

（二〇一六年第一号）

【重要提示】

本基金的募集申请经中国证监会2014年4月23日【2014】439号文注册。本基金的基金合同于2014年5月7日生效。

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。

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，投资人认购（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。投资人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以及本基金特有风险等。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。

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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。

购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，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。

本招募说明书所载内容截至2016年5月7日，基金投资组合报告等相关财务数据截至2016年3月31日（财务数据未经审计）。

一、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：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：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：范伟隽
注册资本：1.8亿元人民币
股权结构（截止于2016年5月7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。

公司目前下设二十三个部门、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、固定收益研究部、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、董事会办公室、综合管理部、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、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；固定收益研究部：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的研究管理等；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；董事会办公室：履行公司章程规定的工作职责，暂与综合管理部合署办公；综合管理部：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；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；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2016年4月30日，公司有员工326人，其中62%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），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，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。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副总经理。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。

张克均先生，董事，研究生学历。现任申万宏源证券有限公司战略规划总部总经理。历任福建兴业银行厦门分行电脑部副经理、计划部副经理、证券部副经理、杏林支行副行长；申银万国证券股份有限公司厦门证券营业部副经理、经理、深圳分公司副总经理兼厦门夏禾路证券营业部经理、经纪总部总经理。

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。

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

岳增光先生，监事长，本科学历，高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司纪委书记、风控总监。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，山东省国际信托股份有限公司财务部经理。

沈寅先生，监事，本科学历。现任申银宏源证券有限公司合规与风险管理总部总经理助理及公司律师。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。

夏瑾璐女士，监事，研究生学历。现任蒙特利尔银行上海代表处首席代表。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。

仇夏萍女士，监事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司计划财务部总经理。历任中国工商银行上海分行杨浦支行所任职；在华夏证券有限公司东方路营业部任职。

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

唐洁女士，监事，本科学历，CFA。现任富国基金管理有限公司策略研究员。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。

王旭辉先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司华东营销中心总经理。历任职于郏县政府办公室职员，郏县国营一厂厂长，富国基金管理有限公司客户经理、高级客户经理。

陆运天先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司电子商务部电子商务总监助理。历任汇添富基金任电子商务经理，富国基金管理有限公司资深电子商务经理。

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，研究生学历，13年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理。历任中国建设银行上海市分支行职员、经理，华安基金管理有限公司上海营销总部投资顾问、总监助理、市场部总监助理、上海分公司总经理助理、市场部总经理、市场总监、公司副营销总裁。

李笑薇女士，研究生学历，高级经济师，13年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。历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（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，富国基金管理有限公司量化与海外投资部总经理兼基金经理、总经理助理兼量化与海外投资部总经理兼基金经理。

朱少醒先生，研究生学历，16年证券、基金从业经验。现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。历任富国基金管理有限公司产品开发主管、基金经理助理、基金经理、研究部总经理兼基金经理、总经理助理兼研究部总经理兼基金经理、总经理助理兼权益投资部总经理兼基金经理。

5、本基金基金经理

（1）现任基金经理：

1）王颀亮女士，硕士，曾任上海国利货币经纪有限公司经纪人，自2010年9月至2013年7月在富国基金管理有限公司任交易员；2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2014年8月起任富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年4月起任富国恒利分级债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金基金、富国天时货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。

2）万莉女士，硕士，自2006年7月至2008年6月在广州银行任债券交易员；自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作，历任债券交易员、基金经理助理、基金经理；自2013年7月至2014年6月中融基金（原道富基金）管理有限公司工作，任现金管理投资总监；自2014年6月至2015年10月今在富国基金管理有限公司任固定收益投资部现金管理主管，2015年10月起任富国天时货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金基金经理。

（2）历任基金经理：

1）冯彬先生，任职时间为2014年5月到2014年10月；

2）刘凌云女士，任职时间为2014年8月至2015年4月。

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、主动权益及固定收益投资副总经理朱少醒先生和量化与海外投资副总经理李笑薇女士。

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）基本情况

1、基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）
住所：北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：常振明
成立时间：1987年4月7日
组织形式：股份有限公司
注册资本：467.873亿元人民币
存续期间：持续经营
批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号
联系人：中信银行资产托管部
联系电话：010-89936330
传真：010-85230024
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务（有效期至2017年09月08日）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

中信银行（601998.SH，0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过近三十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年，中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

2、主要人员情况

李庆萍，行长，高级经济师。1984年8月至2007年1月，任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月，任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月，任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月，任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月，任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月，任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。1962年12月生，2011年4月起担任中国建设银行江苏省分行行长，党委书记；2006年7月至2011年3月担任中国建设银行河北省分行行长，党委书记；1982年8月至2006年7月在中国建设银行河南省分行工作，历任计划财务处科员，副处长，信阳地区中心支行副行长，党组成员，计划处处长，中介处处长，郑州市铁路专业支行行长，党组书记，郑州分行行长，党委书记，金水支行行长，党委书记，河南省分行副行长，党委副书记。

刘泽云先生，现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理，经济学博士。1996年8月进入本行工作，历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。

3、基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2015年末，中信银行已托管72只开放式证券投资基金，以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模突破4.8万亿元人民币。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

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：薛爱东
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

投资者可通过本公司网上交易系统理本基金的申购、赎回等业务；直销网点（上海投资理财中心）自2014年9月11日起已暂停受理本基金的申购业务，但照常受理本基金赎回业务。若有变更敬请投资者留意相关公告。

2、代销机构：
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

该机构仅开通本基金的赎回业务，暂不开通申购业务和其他业务，且赎回业务仅针对募集期内通过该机构认购的基金份额，通过直销机构认购或申购的基金份额请通过直销机构办理赎回，敬请投资者留意。若有变更敬请投资者留意相关公告。

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，变更或增减上述基金销售机构，或选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）登记机构
名称：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：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：雷青松

（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
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

富国富钱包货币市场基金

五、基金的类型

货币型

六、基金的投资目标

在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券（包含超短期融资券），一年以内（含一年）的银行定期存款、协议存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限（或回售期限）在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据，及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。

法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场基金的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下，本基金可参与其他货币市场基金的投资，不需召开基金份额持有人大会。货币市场基金投资其他货币市场基金的比例不超过基金资产的80%，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

未来若法律法规或监管机构允许货币市场基金投资同业存单的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下，本基金可参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。

在投资管理过程中，基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。具体包括：

1、总体资产配置策略

（1）利率预期分析

基于对国家宏观政策（包括：财政政策、货币政策等）的深入研究以及对央行公开市场操作、资金供求、资金流动性、货币市场与资本市场的资金互动、市场成员特征等因素的客观分析，合理预期利率变化趋势，并据此确定投资组合的总体资产配置策略。

（2）投资组合平均剩余期限控制

结合宏观经济和利率预期分析，在合理运用量化模型的基础上，动态确定并控制投资组合的平均剩余期限。具体而言，在预计市场利率上升时，适度缩短投资组合的平均剩余期限；在预计利率下降时，适度延长投资组合的平均剩余期限。

2、类别资产配置策略

本基金以短期金融工具作为投资对象，基于对各细分市场的市场规模、交易情况、各交易品种的流动性、相对收益、信用风险以及投资组合平均剩余期限要求等重要指标的分析，确定（调整）投资组合的类别资产配置比例。

对于含回售条款的债券，本基金将仅买入距回售日不超过397天以内的债券，并在回售日前进行回售或者卖出。

3、明细资产选择和交易策略

（1）收益率曲线分析策略

根据债券市场收益率曲线的动态变化以及隐含的即期利率和远期利率提供的价值判断基础，结合对当期和远期资金面的分析，寻求在一段时期内获取因收益率曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。本基金将比较分析子弹策略、哑铃策略和梯子策略等在不同市场环境下的表现，构建优化组合，获取较高收益。

（2）套利操作策略

1）跨市场套利策略

短期资金市场由交易所市场和银行间市场构成。由于其中的投资群体、交易方式等市场要素不同，使得两个市场的资金面、短期利率期限结构、流动性都存在着一定的差别。本基金将在充分论证套利机会可行性的基础上，寻找合理的介入时机，进行跨市场套利操作。

2）跨品种套利策略

由于投资群体存在一定的差异性，对期限相近的交易品种同样可能因为存在流动性、税收等市场因素的影响而出现内在价值明显偏离的情况。本基金将在保证高流动性的基础上进行跨品种套利操作，以增加超额收益。

（3）正回购放大操作策略

当预期市场利率下跌或者利率走势平稳时，通过将剩余期限相对较长的短期债券进行正回购质押，融资后再购买短期债券。在融资成本低于短期债券收益率时，该投资策略的运用可实现正收益。

（4）滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特征，采用持续滚动投资方法，以提高投资组合的整体持续变现能力。

（5）债券相对价值判断策略

基于量化模型的分析结果，识别出被市场错误定价的债券，进而采取适当的交易以获得收益。一方面，可通过对利率期限结构分析，在现金流特征相近且处于同一风险等级的多只债券品种中寻找更具投资价值的品种；另一方面，通过对债券等级、债券息票率、所在行业特征等因素的分析，评估判断短期风险债券与无风险短期债券间的合理息差。

（6）波动性交易策略

根据市场利率的波动性特征，利用关键市场时机（例如：季节性因素、突发事件）造成的短期市场失衡机会进行短期交易，以获得超额收益。

（7）流动性管理策略

根据对市场资金面分析以及对申购、赎回变化的动态预测，通过现金库存管理、回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持本基金资产充分流动性的基础上，确保稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

活期存款利率（税后）

本基金定位为现金管理工具，注重基金资产的流动性和安全性，因此采用活期存款利率（税后）作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

如果今后法律法规发生变化，或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，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，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	固定收益投资	1,143,541,742.47	61.04
	其中：债券	1,143,541,742.47	61.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,195.00	2.67
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	650,617,663.59	34.73
4	其他资产	29,192,703.38	1.56
5	合计	1,873,352,304.44	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	16.29	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	251,939,354.03	15.55
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

3、基金投资组合平均剩余期限

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	96

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

（2）报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	32.75	15.55
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	12.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	12.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	33.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天（含）	22.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		113.81	15.55

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	摊余成本（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	209,978,142.23	12.96
	其中：政策性金融债	209,978,142.23	12.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	500,033,840.28	30.86
6	中期票据	-	-
7	同业存单	433,529,759.96	26.76
8	其他	-	-
9	合计	1,143,541,742.47	70.57
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150311	15进出11	1,000,000.00	99,968,242.38	6.17
2	111609073	16浦发CD073	1,000,000.00	98,883,467.97	6.10
3	011573009	15鲁高速SCP009	600,000.00	60,016,784.35	3.70
4	150419	15农发19	600,000.00	59,977,433.09	3.70
5	150416	15农发16	500,000.00	50,032,466.76	3.09
6	041569006	15鲁西化工CP001	500,000.00	50,015,975.54	3.09
7	011520003	15中铝SCP003	500,000.00	49,998,828.65	3.09
8	041572012	15宁夏国资CP001	500,000.00	49,993,713.31	3.09
9	011599712	15山钢SCP006	500,000.00	49,993,031.42	3.09
10	111516223	15上海银行CD223	500,000.00	49,760,950.93	3.07

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2299%
报告期内偏离度的最低值	0.1641%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2005%

注：以上数据按工作日统计

7、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。

8、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

（2）本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的声明

本报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

（3）声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。

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

（4）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	应收利息	18,748,233.13
4	应收申购款	10,444,470.25
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,192,703.38

（5）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。

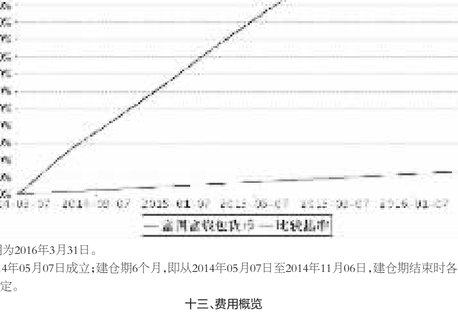
十二、基金的业绩

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。

1、富国富钱包货币市场基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2014.5.7-2014.12.31	3.3354%	0.0025%	0.2324%	0.0000%	3.1030%	0.0025%
2015.1.1-2015.12.31	4.1176%	0.0043%	0.3549%	0.0000%	3.7627%	0.0043%
2016.1.1-2016.3.31	0.7530%	0.0038%	0.0885%	0.0000%	0.6645%	0.0038%
2014.5.7-2016.3.31	8.4005%	0.0041%	0.6757%	0.0000%	7.7248%	0.0041%

2、自基金合同生效以来富国富钱包货币市场基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1.截止日期为2016年3月31日。

2.本基金于2014年05月07日成立；建仓期6个月，即从2014年05月07日至2014年11月06日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十三、费用概览

（一）基金的费用与税收

1、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）销售服务费；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（6）基金份额持有人大会费用；
（7）基金的证券交易费用；
（8）基金的银行汇划费用；
（9）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。

2、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0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.27%÷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，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。

（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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷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。

（3）基金销售服务费

本基金的年销售服务费率为0.25%，若将来本基金增加基金份额类别的，本基金各类份额的年销售服务费率最高为0.25%，具体设置见基金管理人届时更新的招募说明书或相关公告。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式具体如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数
H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“1、基金费用的种类中第（4）－（9）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。

3、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。

4、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。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金不收取申购费用。

2、赎回费用

本基金不收取赎回费用。

3、转换费用

A 前端转前端

（1）基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购补差费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

1）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

2）转入基金申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式，转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

（2）基金转换的计算：

转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率
转入金额＝转出金额－转出基金赎回费
净转入金额＝转入金额÷（1＋申购补差费率）
申购补差费＝转入金额－净转入金额
转入份额＝净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

B 后端转后端

后端收费模式基金发生转换时，其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成，其中申购补差费率按照转入基金与转出基金的后端申购费率的差额计算。当转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时，基金转换申购费补差费率为转出基金与转入基金申购费率之差；当转出基金的后端申购费率低于转入基金的后端申购费率，申购补差费率为零。

对于由本公司担任注册登记机构的基金，后端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值
转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率
申购补差费=（转出金额-转出基金赎回费用）×补差费率/（1+补差费率）
净转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费用
转入份额=净转入金额/转换申请当日转入基金的基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

十四、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》、《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》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分增加了基金合同生效日期、更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。
3、对“四、基金托管人”部分进行了更新。
4、“八、基金份额的申购与赎回”部分更新了可与本基金转换的基金名单。
5、“九、基金的投资”部分更新了基金投资组合报告，内容截止至2016年3月31日。
6、更新了“十、基金的业绩”，内容截止至2016年3月31日。
7、对“二十一、对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。
8、更新了“二十二、其他应披露事项”，对本报告期内的其他事项进行披露。

富国基金管理有限公司
二〇一六年六月十四日

股票代码：001896　　股票简称：豫能控股　　公告编号：临2016-57

河南豫能控股股份有限公司董事会2016年第8次临时会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

1. 河南豫能控股股份有限公司董事会2016年第8次临时会议召开通知于2016年6月8日以书面和电子邮件形式发出。

2. 2016年6月13日会议以巡签表决方式召开。

3. 应出席会议董事6人。郑晓彬、张留锁、张勇董事和董鹏、刘汴生、申香华独立董事共6人出席了会议。

4. 会议的召开和出席会议人数符合《公司法》等有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

二、董事会会议审议情况

（一）审议通过了《关于设立河南豫能新能源有限公司的议案》

为推进公司能源产业结构调整，优化资源配置，加快公司由区域性单一燃煤火电企业向综合性能源投资集团转变，董事会同意：以自有资金出资1亿元，独资设立河南豫能新能源有限公司（公司名称最终以公司登记机关最后核准登记为准），开展新能源项目的开发、设计、建设及运营工作；授权总经理组建公司，履行出资义务。河南豫能新能源有限公司经营范围：风电、太阳能发电、生物质（含垃圾）发电及其他新能源项目的开发建设，电力生产（限分支机构）、销售。（以公司登记机关最后核准登记为准），注册地：郑州市。

三、备查文件

1. 河南豫能控股股份有限公司董事会2016年第8次临时会议决议；

特此公告。

河南豫能控股股份有限公司
董　事　会
2016年6月14日

股票代码：001896　　股票简称：豫能控股　　公告编号：临2016-58

河南豫能控股股份有限公司对外投资公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、对外投资概述

为推进公司能源产业结构调整，优化资源配置，加快公司由区域性单一燃煤火电企业向综合性能源投资集团转变，2016年6月13日，公司召开董事会2016年第8次临时会议，审议通过了《关于设立河南豫能新能源有限公司的议案》，决定以自有资金出资1亿元，独资设立河南豫能新能源有限公司（公司名称最终以公司登记机关最后核准登记为准），开展新能源项目开发、设计、建设及运营工作。

投资1亿元设立河南豫能新能源有限公司，无需提交公司股东大会审议批准，亦不构成关联交易。

二、投资标的基本情况

1. 企业名称：河南豫能新能源有限公司（公司名称最终以公司登记机关最后核准登记为准）。

2. 类型：有限责任公司。

3. 注册地：郑州市。

4. 注册资本：1亿元，由公司以现金出资。

5. 经营范围：风电、太阳能发电、生物质（含垃圾）发电及其他新能源项目的开发建设，电力生产（限分支机构）、销售。（以公司登记机关最后核准登记为准）

三、对外投资的目的、存在的风险和对公司的影响

（一）投资目的及对公司的影响

2015年以来，为适应能源产业转型升级以及深化电力体制改革的发展趋势，公司在南阳桐柏和镇平、洛阳新安和偃师、鹤壁淇县、濮阳沿黄滩区等地相继开发、储备了较大规模的风电及光伏等新能源项目，本次设立新能源公司是为了加快新能源项目落地，优化公司产业结构，形成火电、新能源协调发展格局。

（二）投资存在的风险

1. 宏观经济和市场风险

宏观经济不景气和社会用能需求不足，盈利能力降低，投资回收期将延长。目前河南地区经济增长较快，市场基本稳定。

2. 政策风险

新能源政策不断出新，新能源项目的开发、设计、建设及运营存在较多不确定性。公司不断加大新能源政策研究，合理有效规避风险。

特此公告。

河南豫能控股股份有限公司
董　事　会
2016年6月14日

证券代码：000509　　证券简称：华塑控股　　公告编号：2016-051号

华塑控股股份有限公司关于重大资产重组停牌进展的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

华塑控股股份有限公司于2016年5月20日召开九届董事会第三十二次临时会议，审议通过了《关于<重大资产购买报告书>及其摘要的议案》等相关议案，并于5月23日在中国证监会指定的信息披露媒体刊登了相关公告。

根据中国证监会《关于〈上市公司重大资产重组管理办法〉实施后有关监管事项的通知》的要求，深圳证券交易所需对公司本次重大资产重组方案及相关文件进行事后审核，公司股票自2016年5月23日起继续停牌。

2016年5月28日，公司收到深圳证券交易所《关于对华塑控股股份有限公司的重组问询函》（非许可类重组问询函[2016]第5号）（以下简称"《问询函》"）。深圳证券交易所对公司本次重大资产重组方案提出了若干反馈意见，并要求公司及中介机构做出书面说明和出具核查意见。

公司在收到问询函后，根据深交所意见，正在协同交易各方及中介机构对问询函所涉事项作进一步的补充、修订、完善。待相关回复经深交所核准并披露后再申请复牌。

停牌期间，公司将根据相关规定及时履行信息披露义务，至少每五个交易日发布一次关于重大资产重组事项进展情况的公告。以此给投资者带来的不便，公司董事会深表歉意。

本次重大资产重组尚需经过公司股东大会审议，本次重组最终能否取得股东大会通过尚存在不确定性。

敬请广大投资者理性投资，注意风险。

特此公告。

华塑控股股份有限公司
董事会
二〇一六年六月十四日

证券代码：002310　　证券简称：东方园林　　公告编号：2016-091

北京东方园林生态股份有限公司关于副董事长辞职的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

北京东方园林生态股份有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）于2016年6月13日收到公司副董事长李东辉先生提交的书面辞职报告。

由于工作调整，李东辉先生今后主要负责北京东方园林投资控股有限公司的事务，因此李东辉先生辞去其在本公司担任的第五届董事会董事、副董事长职务，其辞职后不再担任本公司其他任何职务。

根据《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等相关制度规定，李东辉先生的辞职报告自送达公司董事会之日起生效。

公司董事会对李东辉先生担任公司副董事长期间为公司做出的贡献表示衷心的感谢！

特此公告。

北京东方园林生态股份有限公司董事会
2016年6月13日

证券代码：600705　　证券简称：中航资本　　公告编号：临2016-022

中航资本控股股份有限公司关于获准设立中航基金管理有限公司的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

近日，公司收到中国证券监督管理委员会《关于核准设立中航基金管理有限公司的批复》（证监许可【2016】1249号），核准设立中航基金管理有限公司，注册资本金为10,000万元人民币，公司全资子公司中航证券有限公司（以下简称"中航证券"）作为其唯一股东，住所为北京市。经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

中航证券将严格按照有关法律法规及相关批复要求办理筹建事宜，积极推进设立基金公司的相关工作，严格自律、规范运作，并及时履行信息披露义务。

特此公告。

中航资本控股股份有限公司
董　事　会
2016年6月14日