（上接B34版）

法人代表：赖任军
联系人员：张烨
客服电话：400-9500-888
公司网站：www.jfzinv.com
(121)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号院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
联系人员：戚晓强
客服电话：4000-618-518
公司网站：danjuanapp.com
(122)上海华夏财富投资管理有限公司
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
联系人员：仲秋月
客服电话：400-817-5666
公司网站：www.amcfortune.com
（三）其他
基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金销售机构，并及时公告。
二、基金登记机构
名称：富国基金管理有限公司
住所：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楼
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
成立日期：1999年4月13日
电话：（021）20361818
传真：（021）20361616
联系人：徐慧
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
注册地址：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
联系电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：廖海
经办律师：廖海、吕红
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

第四部分 基金名称

富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

第五部分 基金类型

混合型

第六部分 投资目标

本基金主要投资于强势地区（区域经济发展较快、已经形成一定产群规模且居民购买力较强）具有较强竞争力、经营管理稳健、诚信、业绩优良的上市公司的股票。本基金遵循“风险调整后收益最大化”原则，通过“自上而下”的积极投资策略，在合理运用金融工程技术的基础上，动态调整投资组合比例，注重基金资产安全，谋求基金资产的长期稳定增值。

第七部分 基金投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等。

第八部分 基金投资策略

本基金主要采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判宏观经济状况、资本市场运行特征的前提下，以强势地区内单个证券的投资价值评判为核心，追求投资组合流动性、赢利性、安全性的中长期有效结合。

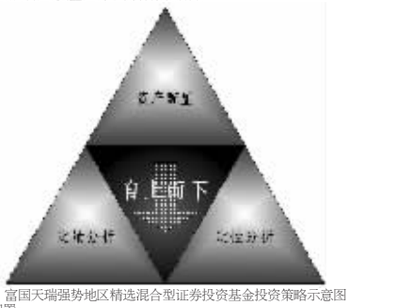
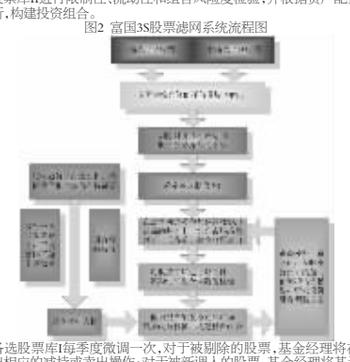


图1 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金投资策略示意图

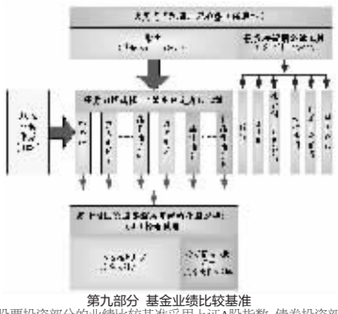
1、资产配置：
（1）在正常市场状况下，本基金投资组合中的股票投资比例浮动范围为：45%-95%；债券和短期金融工具的投资比例浮动范围为：5%-55%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。投资于强势地区的股票比例不低于基金股票投资的80%。
（2）股票与债券之间具体的比例将根据不同的市场情况动态配置，以最大限度地规避风险。
本基金管理人认为，股票市场运行的中枢取决上市公司的整体盈利能力、外部环境（政策、投资理念及投资者行为等）变化决定了市场的运行区间，股票供求、资金面的松紧程度等左右市场的短期波动；债券市场的运行中枢主要取决于市场利率、利率的预期变化决定了债券市场总体变化趋势，债券供求状况和资金松紧程度等左右债券市场的短期波动。本基金管理人将在基本分析的基础上，综合应用数量分析与技术分析等工具，研判市场的中期波动与长期趋势。
①当股票市场处于低风险区域或预期股票市场趋于上涨时，本基金管理人将采取适度积极的做法，提高股票的投资比重，分享股票市场上涨带来的收益，以争取较高回报。
②当股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时，本基金管理人将采取保守的做法，降低股票投资比例，加大债券市场的投资力度，以回避股票市场下跌的系统性风险，避免组合损失。
③当股票市场在中等风险区域或预期处于震荡运行时，本基金管理人将以结构性调整为主，适当降低股票的投资比重，选择的重点是相对价值低估的个股，同时加大可转债的投资比重。
④当预期利率下降、债券价格将上升时，组合将降低现金持有比例，并将债券资产主要投资于中长期债券，以实现较高的回报；在预期利率上升、债券价格将下降时，组合将增加现金持有比例，并将债券资产主要投资于短期债券和浮息债券。
⑤积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资。
2、股票投资策略：
本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团（BMO Financial Group）的投资管理经验及技能，根据国内市场的特征，应用“富国3S股票滤网系统（Stock Screening System）”，挖掘具有投资价值的股票：
（1）富国3S股票滤网系统的操作思路为：
①基于富国的“多因素综合价值评估模块（MVP）”，对上市公司的管理能力、财务实力、资金运用效率、资产盈利能力、成长性、经营中的现金流量状况以及股价吸引力进行总体评价；
②剔除财务指标异常和股价波动异常的个股，构建备选股票库I；
③在公司研究员和基金经理实地跟踪的基础上，结合市场趋势判断，形成重点关注股票库II；
④对股票库II进行限制性、流动性和组合风险度检验，并根据资产配置原则和市场风险分析，构建投资组合。

图2 富国3S股票滤网系统流程图



公司各选股票库I每季度微调一次，对于被剔除的股票，基金经理将在最近的一个月内作出相应的减持或卖出操作；对于被新调入的股票，基金经理将基于主客观判断进行决策；对于入选重点股票库II的，将选择适当时机进行投资操作。
（2）富国“多因素综合价值评估模块（MVP）”：
“多因素综合价值评估模块（Multifactor Valuation Pipeline）”是富国3S股票滤网系统中的核心部分之一。本基金管理人基于“定性定量分析相结合、动态静态指标相结合”的原则，运用“价值为本，成长为重”的合理价格成长投资策略（GARP-Growth At Reasonable Price）来确定具体选股标准，评估上市公司的综合素质，研判股票的投资价值。重点关注的因素包括：
①企业的管理团队优秀，管理制度健全，内部治理结构完善，重视股东利益，关注投资回报，具有良好的诚信度；
②企业在产品开发、技术进步、成本控制等方面具有较强的核心竞争力，并且在销售网络、市场知名度和品牌效应方面具有独特优势；
③企业行业地位突出，财务管理稳健，营运状况良好，具有稳定的现金流并具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；
④企业盈利能力较强，主营业务收入、主营业务利润、息税前收益以及净资产报酬率稳定并保持较高的成长性；
⑤股票具有较好的流动性，适合资金的操作；
⑥市净率（P/B）、动态市盈率（PEG）以及股票市值/主营业务销售收入/主营业务收入增长率（P/S/G）相对较低；
⑦综合股价/每股经营现金流指标（P/C）、股价/每股销售收入指标（P/S）、股利分配率（DPR）以及自由现金流折现模型（DCF）、经济价值模型（EV/EBITDA）、杜邦财务分析模型（DuPont Analysis）的分析结果。
3、债券投资策略：
在目前中国债券市场处于制度与规则快速调整的阶段，管理人将采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换和相对价值判断等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。
本基金投资示意图如下：

图3 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金投资示意图



第九部分 基金业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证A股指数，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。本基金定位在混合型基金，以股票投资为主，债券投资只是为了回避市场的系统风险，因此，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式：
上证A股指数收益率×70%+上证国债指数收益率×25%+同业存款利率×5%

第十部分 基金的风险收益特征

本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于强势地区中定价合理且具有成长潜力的优质股票，属于中度风险的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长，实现较高的超额收益。

第十一部分 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	2,179,043,381.70	81.82
	其中：股票	2,179,043,381.70	81.82
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	439,483,713.24	16.50
7	其他资产	44,588,115.51	1.67
8	合计	2,663,115,210.45	100.00

二、报告期末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	48,782,932.32	1.86
C	制造业	1,478,585,438.86	56.41
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	-	-
J	金融业	537,997,730.04	20.53
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	35,519,134.00	1.36
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	9,649,764.88	0.37
R	文化、体育和娱乐业	68,508,381.60	2.61
S	综合	-	-
	合计	2,179,043,381.70	83.14

三、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

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	002007	华兰生物	4,748,865.00	179,981,983.50	6.87
2	300408	三环集团	6,918,807.00	143,841,997.53	5.49
3	601988	中国银行	31,666,413.00	117,799,056.36	4.49
4	601233	桐昆股份	7,103,043.00	116,774,026.92	4.46
5	000661	长春高新	376,888.00	89,322,456.00	3.41
6	601318	中国平安	1,269,200.00	86,940,200.00	3.32
7	600487	亨通光电	3,394,494.00	81,094,461.66	3.09
8	601336	新华保险	1,564,351.00	78,968,438.48	3.01
9	300122	智飞生物	1,610,843.00	78,866,873.28	3.01
10	600036	招商银行	2,522,722.00	77,422,338.18	2.95

四、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注：本基金本报告期末未持有债券。
五、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
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序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。
七、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
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。
八、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
注：本基金本报告期末未持有权证。
九、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
（一）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。
（二）本基金投资股指期货的投资政策
本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。
十、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（一）本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。
（二）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	-
国债期货投资本期收益（元）	-
国债期货投资本期公允价值变动（元）	-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。
（三）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。
十一、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。
本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户、为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保、未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目、高管人员在获得任职资格核准前履职、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务、未严格审查贸易背景真实性开立信用证、违规签订保本合同销售同业非保本理财产品、非真实转让信贷资产、违规向典当行发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等违法违规事实，中国银监会于2018年2月12日对公司处以罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元的行政处罚。
基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。
本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。
（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。
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。
（三）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,760,233.55
2	应收证券清算款	40,073,199.57
3	应收股利	-
4	应收利息	80,804.32
5	应收申购款	1,673,878.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	44,588,115.51

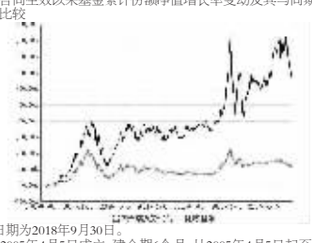
（四）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
（五）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。
（六）投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第十二部分 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
2005.04.05-2005.12.31	4.42%	0.87%	0.19%	0.95%	4.23%	-0.08%
2006.01.01-2006.12.31	133.50%	1.32%	81.37%	0.95%	52.13%	0.37%
2007.01.01-2007.12.31	92.44%	1.92%	62.20%	1.54%	30.24%	0.38%
2008.01.01-2008.12.31	-48.47%	2.58%	-50.23%	1.98%	1.76%	0.60%
2009.01.01-2009.12.31	99.16%	1.62%	52.63%	1.33%	46.53%	0.29%
2010.01.01-2010.12.31	-9.22%	1.62%	-9.14%	0.99%	-0.08%	0.63%
2011.01.01-2011.12.31	-11.31%	1.34%	-14.52%	0.81%	3.21%	0.53%
2012.01.01-2012.12.31	13.01%	1.20%	3.37%	0.76%	9.64%	0.44%
2013.01.01-2013.12.31	8.77%	1.16%	-3.80%	0.81%	12.57%	0.35%
2014.01.01-2014.12.31	16.23%	1.03%	36.64%	0.76%	-20.41%	0.27%
2015.01.01-2015.12.31	41.50%	2.68%	9.74%	1.71%	31.76%	0.97%
2016.01.01-2016.12.31	-8.95%	1.85%	-7.45%	1.02%	-1.50%	0.83%
2017.01.01-2017.12.31	35.22%	1.01%	4.85%	0.38%	30.37%	0.63%
2018.01.01-2018.09.30	-14.50%	1.50%	-9.44%	0.79%	-5.06%	0.71%
2005.04.05-2018.09.30	725.04%	1.66%	127.86%	1.15%	597.18%	0.51%

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9月30日。
2、本基金于2005年4月5日成立，建仓期6个月，从2005年4月5日起至2005年10月4日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

第十三部分 费用概览

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）基金合同生效后的基金信息披露费用；
（4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的证券交易费用；
（7）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金资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资产总值中扣除。
二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
（1）基金管理费
本基金的管理费按该基金资产净值的1.5%年费率计提，计算方法如下：
H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应支付的基金管理费
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个工作日内从基金资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）基金托管费
本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提，计算方法如下：
H=E×2.5‰÷当年天数
H为每日应支付的基金托管费
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个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
（3）上述“一、基金费用的种类”中（3）-（7）项费用由基金托管人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，从基金资产中支付。
三、不列入基金费用的项目
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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。
其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。
四、基金税收
本基金运作过程中的各类纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
五、与基金销售有关的费用
1、申购费用
投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。
（1）前端申购费
投资者选择交纳前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金前端收费模式对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体费率如下：
A、前端申购费率：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元（含）-500万元	1.2%
500万元（含）以上	1000元/笔

注：上述前端申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户外的其他选择前端收费模式的投资者。
B、特定申购费率：

申购金额（含申购费）	特定申购费率
M<100万元	0.45%
100万元≤M<500万元	0.36%
M≥500万元	每笔1000元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台选择前端收费模式申购本公司旗下开放式基金的养老金客户，包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：
1、全国社会保障基金；
2、可以投资基金的地方社会保障基金；
3、企业年金单一计划以及集合计划；
4、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
5、企业年金养老金产品
如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。
投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。
（2）后端申购费
投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	后端申购费率
1年以内（含）	1.8%
1年-3年（含）	1.2%
3年-5年（含）	0.6%
5年以上	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额，不再收取后端申购费用。
如果投资者选择交纳前端申购费用，则申购份额的计算方法如下：
净申购金额=申购金额/（1+前端申购费率）
前端申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值
如果投资者选择交纳后端申购费用，则申购份额的计算方法如下：
申购份额=申购金额/T日基金份额净值
2、赎回费用
本基金根据投资者认（申）购方式采用不同的赎回费率。
投资者选择交纳前端申购费用时，对持续持有期少于7日的投资者收取赎回金额1.5%的赎回费，对持续持有期不少于7日的投资者收取赎回金额0.5%的赎回费。
投资者选择交纳后端认（申）购费用时，赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	赎回费率
少于7日	1.5%
7日（含）-2年以内（含）	0.6%
2年-3年（含）	0.3%
3年以上	0

如投资者在认购/申购时选择交纳前端认购/申购费用，则赎回金额计算方法如下：
赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用
如果投资者在认购/申购时选择交纳后端认购/申购费用，则赎回金额的计算方法如下：
赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值
后端认购/申购费用=赎回份额×认购/申购日基金份额净值×后端认购/申购费率
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-后端认购/申购费用-赎回费用
3、转换费用
（1）前端转前端
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费补差两部分构成，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。其中：转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用；转入基金申购补差费是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。
基金转换的计算公式如下：
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。
（2）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。
1）对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金，其后端收费模式下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
申购补差费用=（转出金额-转出基金赎回费用）×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
2）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。
4、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，应最迟于新的费率开始实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。
5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

第十四部分 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》及其他有关法律法规的要求进行了更新，主要更新内容如下：
1、“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。
2、“三、基金管理人”部分，对基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。
3、“四、基金托管人”部分，对基金托管人的基金托管业务经营情况进行了更新。
4、“五、相关服务机构”部分，对代销机构信息进行了更新。
5、“八、基金份额的申购与赎回”部分，对代销机构的代销网点、最低申购金额限制进行了更新。
6、“九、基金的投资”部分，对基金投资组合报告进行了更新，内容截止至2018年9月30日。
7、“十、基金的业绩”部分，对基金业绩表现数据及历史走势图进行了更新，内容截止至2018年9月30日。
8、“二十一、对基金份额持有人的服务”部分，对部分服务内容进行了更新。
9、“二十二、其他应披露事项”部分，对本报告期内的其他应披露事项进行了更新。

富国基金管理有限公司
2018年11月17日

证券代码：601969　证券简称：海南矿业　公告编号：2018-067
债券代码：136667　债券简称：16海矿01
债券代码：143050　债券简称：17海矿01

海南矿业股份有限公司第三届董事会第二十八次会议决议公告

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。

一、董事会会议召开情况
海南矿业股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）第三届董事会第二十八次会议于2018年11月16日在公司会议室以现场及电话会议方式召开。会议通知于2018年11月6日以电子邮件方式发出。本次会议应参与表决董事10名，实际参与表决董事10名。会议由公司董事长刘明东先生主持。会议召开符合《公司法》、《公司章程》及相关法律法规的有关规定。
二、董事会会议审议情况
（一）审议通过《关于公司未弥补亏损超过实收股本总额三分之一的议案》
具体内容详见上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）《海南矿业关于未弥补亏损达实收股本总额三分之一的公告》。
表决结果：赞成10票；反对0票；弃权0票。
此议案董事会通过后须提交股东大会审议。
（二）审议通过《关于提名周淮平为第三届董事会非独立董事候选人的议案》
根据《中华人民共和国公司法》及《公司章程》的有关规定，股东海南海钢集团有限公司提名周淮平女士为公司第三届董事会非独立董事候选人。
独立董事发表了独立意见，内容详见上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）。
周淮平女士简历：1967年1月出生，汉族，法律硕士学位，审计师。历任海南省省直单位会计管理中心（省财政国库支付局）第二核算站站长、省财政厅法规处处长；海南省财政厅机关党委专职副书记兼党组纪检组副组长、海口市秀英区人民政府副区长（挂职锻炼）、海南省纪委派驻省国土资源厅纪检组组长、省国土资源厅党组成员。现任海南海钢集团有限公司党委委员、书记。
表决结果：赞成10票；反对0票；弃权0票。
此议案董事会通过后须提交股东大会审议。
（三）审议通过《关于召开2018年第三次临时股东大会的议案》
公司拟定于2018年12月3日召开2018年第三次临时股东大会。会议通知及会议材料详见上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）。
表决结果：赞成10票；反对0票；弃权0票。
三、上网附件
（一）海南矿业独立董事关于第三届董事会第二十八次会议的独立意见
四、备查文件
（一）海南矿业第三届董事会第二十八次会议决议
特此公告。

海南矿业股份有限公司董事会
2018年11月17日

证券代码：601969　证券简称：海南矿业　公告编号：2018-068
债券代码：136667　债券简称：16海矿01
债券代码：143050　债券简称：17海矿01

海南矿业股份有限公司关于未弥补亏损达实收股本总额三分之一的公告

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。

一、情况概述
截至2018年9月30日，海南矿业股份有限公司（下称：“公司”）合并财务报表未分配利润为-712,887,531.96元，实收股本1,954,720,314.00元，公司未弥补亏损金额已超过实收股本总额三分之一。该事项经公司第三届董事会第二十八次会议审议通过，并提请公司2018年第三次临时股东大会审议。
二、亏损原因
1、公司铁矿石生产方式由露天开采自2017年逐渐转入地下开采。相应的生产、技术工艺流程及工作环境与露采发生了变化。地下开采存在生产组织难度较大，作业环境及劳动条件困难，排水费用高等方面因素，从而导致地下开采相对于露天开采生产成本大幅提高。
2、受宏观经济环境影响，自2014年初以来铁矿石价格快速下跌，62%铁矿石普氏指数在2015年12月15日为38.5美元为近年最低值；铁矿石价格经过持续下跌后长期在较低价位盘整，2016年、2017年及2018年1-9月62%铁矿石普氏指数均值一直徘徊于58美元-72美元之间。受到铁矿石价格因素的影响导致公司盈利能力下降。
3、2017-2018年金融市场整体低迷，公司持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值持续下跌，按照企业会计准则的相关规定，影响本期确认了较大金额公允价值变动损失。
4、根据公司人员年龄结构不尽合理、冗员较多的现状，公司本期制定并实行“离岗待退”政策，根据《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》相关规定，公司计提了离岗待退福利费用，影响公司亏损增加。
三、改进措施
面对上述种种不利因素，公司董事会及管理层带领全体员工坚持以“内生与外延并重，改革和发展同行”为工作总基调，立足岗位，多措并举，将通过以下措施争取不断提升公司盈利能力，提高公司价值：
1、通过科学有序的生产流程进一步降低生产成本。公司将合理编排生产计划，理顺生产流程，释放提升生产能力。加强现场生产组织管理，科学组织施工，全面整合公司生产力量，加强与专业机构的合作，依据产区实际条件不断优化作业流程，确保通过科学合理的生产组织达到降本增效的目的。
2、稳步有序推进《海矿机构扁平化改革总体方案》及《组织机构优化实施方案》，加快海口总部建设工作，推动公司对外发展。通过业务承包、内部改制、劳务派遣等多种方式降低人力成本，实现富余员工多渠道就业，不断提高人均效能。继续推进人才引进计划，满足公司紧缺专业人才需求。
3、公司将结合海南自贸区建设优惠政策及公司实际情况，坚持价值投资为导向，全方位出击，加快推进国内外矿产资源项目的考察、筛选工作。积极寻找符合公司战略发展的项目，增加投资项目储备。通过业务拓展提升公司持续盈利能力，扭转公司目前困难的局面。
特此公告。

海南矿业股份有限公司董事会
2018年11月17日

证券代码：601969　证券简称：海南矿业　公告编号：2018-069
债券代码：136667　债券简称：16海矿01
债券代码：143050　债券简称：17海矿01

海南矿业股份有限公司关于召开2018年第三次临时股东大会的通知

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。

重要内容提示：
●股东大会召开日期：2018年12月3日
●本次股东大会采用的网络投票系统：上海证券交易所股东大会网络投票系统
一、召开会议的基本情况
(一)股东大会类型和届次
2018年第三次临时股东大会
(二)股东大会召集人：董事会
(三)投票方式：本次股东大会所采用的表决方式是现场投票和网络投票相结合的方式
(四)现场会议召开的日期、时间和地点
召开的日期时间：2018年12月3日　14点45分
召开地点：海南矿业股份有限公司会议室
(五)网络投票的系统、起止日期和投票时间。
网络投票系统：上海证券交易所股东大会网络投票系统
网络投票起止时间：自2018年12月3日至2018年12月3日
采用上海证券交易所网络投票系统，通过交易系统投票平台的投票时间为股东大会召开当日的交易时间段，即9:15-9:25,9:30-11:30,13:00-15:00；通过互联网投票平台的投票时间为股东大会召开当日的9:15-15:00。
(六)融资融券、转融通、约定购回业务账户和沪股通投资者的投票程序
涉及融资融券、转融通业务、约定购回业务相关账户以及沪股通投资者的投票，应按照《上海证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则》等有关规定执行。
(七)
涉及公开征集股东投票权
无
二、会议审议事项
本次股东大会审议议案及投票股东类型

序号	议案名称	投票股东类型
		A股股东
非累积投票议案		
1	关于公司未弥补亏损超过实收股本总额三分之一的议案	√
累积投票议案		
2.00	关于选举董事的议案	应选董事（1）人
2.01	非独立董事候选人一周湘平	√
股东大会召开日期：2018年12月3日		

三、股东大会投票注意事项
(一)本公司股东通过上海证券交易所股东大会网络投票系统行使表决权的，既可以登陆交易系统投票平台（通过指定交易的证券公司交易终端）进行投票，也可以登陆互联网投票平台（网址：vote.sseinfo.com）进行投票。首次登陆互联网投票平台进行投票的，投资者需要完成股东身份认证。具体操作请见互联网投票平台网站说明。
(二)股东通过上海证券交易所股东大会网络投票系统行使表决权，如果其拥有多个股东账户，可以使用持有公司股票的任一股东账户参加网络投票。投票后，视