

# 富国创业板指数分级证券投资基金 招募说明书（更新）

## （摘要）

（二〇一四年第一号）

富国创业板指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2013 年 2 月 28 日证监许可[2013]200 号文核准募集。本基金的基金合同于 2013 年 9 月 12 日生效。

### 【重要提示】

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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：指数投资风险、流动性风险、市场风险、合规性风险、交易风险、各项相关业务的操作风险、业务运作的技术系统风险等，还包括本基金运作的特有风险（三类基金份额风险收益特征各异、基金收益的风险、基金份额的折/溢价交易风险等）。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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。

本招募说明书所载内容截止至 2014 年 3 月 12 日，基金投资组合报告截止至 2013 年 12 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：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 3 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。

公司目前下设十七个部门、三个分公司和二个子公司，分别是：权益投资部、固定收益部、量化与海外投资部、研究部、集中交易部、专户投资部、机构业务部、零售业务部、营销策划与产品部、客服与电子商务部、

战略发展部、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。权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益部：负责固定收益类产品的研究与投资管理；量化与海外投资部：负责 FOF、PE、定量类产品等的研究与投资管理；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；专户投资部：在固定收益部、权益投资部和量化与海外投资部内设立的虚拟部门，独立负责年金等专户产品的投资管理；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；营销策划与产品部：负责产品开发、营销策划和品牌建设等；客服与电子商务部：负责电子商务与客户服务；战略发展部：负责公司战略的研究、规划与落实；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 3 月 12 日，公司有员工 229 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

陈敏女士，董事长。生于 1954 年，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。2003 年 7 月开始担任富国基金管理有限公司董事长。

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)。

李明山先生,董事。生于 1952 年,中共党员,硕士,高级经济师。历任申银万国证券股份有限公司副总经理;上海证券交易所副总经理。现任海通证券股份有限公司总经理。

方荣义先生,董事。生于 1966 年,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。生于 1958 年,学士,加拿大特许会计师。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。生于 1973 年,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。生于 1952 年,博士研究生。历任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,金融学院副院长、金融学院常务副院长、金融学院院长;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。生于 1952 年,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。

汤期庆先生，独立董事，生于1955年，硕士研究生。历任上海针织品批发公司办事员、副科长；上海市第一商业局副科长、副处长、处长；上海交电家电商业集团公司总经理；上海市第一商业局局长助理、副局长；上海商务中心总经理；长江经济联合发展集团总裁、副董事长、党组书记。现任上海水产集团总公司董事长、党委书记。

李宪明先生，独立董事。生于1969年，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。生于1965年，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(香港)投资有限公司财务经理；山东省国际信托有限公司计财部经理。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。生于1962年，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。生于1971年，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。生于1960年，中共党员，研究生。历任中国建设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。生于1978年，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。生于 1979 年，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。生于 1977 年，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。

郑焰女士，监事。生于 1981 年，硕士。历任上海证券报、富国基金管理有限公司销售支持经理、富国基金管理有限公司营销策划高级经理，现任富国基金管理有限公司营销策划副总监。

### 3、督察长

范伟隽先生，督察长。生于 1974 年，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。生于 1972 年，中共党员，硕士，1996 年起开始从事证券行业工作。曾任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 月起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。

林志松先生，副总经理。生于 1969 年，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。

孟朝霞女士，副总经理。生于 1972 年，硕士研究生，12 年金融领域从业经历。曾任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理，泰康养老保险股份有限公司副总经理。2009 年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

王保合先生，1977 年出生，博士。自 2006 年 7 月开始从事证券行业工作。曾任富国基金管理有限公司研究员、基金经理助理；自 2011 年 3 月起担任上证综指交易型开放式指数证券投资基金及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，自 2013 年 9 月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理；兼任量化投资副总监。

#### 6、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员构成如下：公司总经理陈戈先生，研究部总经理朱少醒先生，固定收益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、基金托管人基本情况

#### 1. 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建

设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行资产总额 148,592.14 亿元，较上年末增长 6.34%。2013 年上半年，中国建设银行实现净利润 1,199.64 亿元，较上年同期增长 12.65%。年化资产回报率为 1.66%，年化加权净资产收益率为 23.90%。利息净收入 1,876.60 亿元，较上年同期增长 10.59%。净利差为 2.54%，较上年同期提高 0.01 个百分点。净利息收益率为 2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入 555.24 亿元，较上年同期增长 12.76%。

中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有 10 家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等 5 家全资子公司，海外机构已覆盖到全球 14 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 27 家，拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013 年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的近 30 个重要奖项。在英国《银行家》杂志 2013 年“世界银行 1000 强排名”中位列第 5，较上年上升 1 位；在美国《财富》世界 500 强排名第 50 位，较上年上升 27 位；在



美国《福布斯》2013 年全球 2000 强上市企业排行榜中位列全球第 2，较上年提升 11 位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 225 人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2. 主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3. 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管

业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 311 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在 2005 年及自 2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在 2007 年及 2008 年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网 2011 年度和 2012 年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度“最佳基金托管银行”奖。

### 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

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) 20361544

联系人：林燕珏

客户服务统一咨询电话：95105686，4008880688

公司网站：[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)

#### 2. 场外代销机构

(1) 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

法定代表人：王洪章

传真：010-66275654

联系人：张静

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（2）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

法定代表人：姜建清

联系电话：（010）66107900

传真：（010）66107914

联系人：杨菲

客户电话：95588

公司网站：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

（3）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

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

公司网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.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

法定代表人：胡怀邦

联系电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹榕

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(5) 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

法定代表人：田国立

联系人：丰靖

电话：(010) 65550827

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

公司网站：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(6) 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

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509988 分机 7019

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(7) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：(021) 58870011

传真：(021) 68596916

客户服务电话：4007009665

公司网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(8) 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

法定代表人：储晓明

联系电话：(021) 54033888

传真：(021) 54038844

联系人：王序微

客服电话：(021) 962505

公司网站：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

(9) 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

法定代表人：万建华

传真：(021) 38670666

联系人：芮敏琪

客服热线：400-8888-666

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(10) 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

法定代表人：陈有安

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568990

联系人：田薇

客户服务热线：4008-888-888

公司网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(11) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系电话：(010) 65183888

联系人：权唐

客服电话：400-8888-108

传真：(010) 65182261

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(12) 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层

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层

法定代表人：常喆

电话：(010) 84183333

传真：(010) 84183311-3389

联系人：黄静

客服热线：400-818-8118

公司网站：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(13) 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

法定代表人：杨宇翔

电话：95511-8

联系人：郑舒丽

客服电话：95511-8

网站：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(14) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

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

法定代表人：黄耀华

电话：(0755) 83516289

传真：(0755) 83515567

联系人：刘阳

客户服务热线：（0755）33680000（深圳）、400-6666-888（非深圳地区）

公司网站：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

（15）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

法定代表人：杨泽柱

电话：（027）65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客服热线：95579 或 4008-888-999

公司网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（16）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

法定代表人：龚德雄

电话：（021）53519888

传真：（021）53519888

联系人：张瑾

客服热线：（021）962518

公司网站：[www.962518.com](http://www.962518.com)

（17）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

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

联系电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133952

客户服务统一咨询电话：95536

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（18）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

电话：021-20328309

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

客服电话：400-620-8888

公司网站：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

（19）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  
(4301-4316 房)

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41  
和 42 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

传真：(020) 87555305

客服电话：95575

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

（20）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）  
北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系电话：(010) 84588888

传真：(010) 84865560

联系人：顾凌



客户咨询电话：95558

公司网站：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（21）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法人代表人：沈强

联系人：李珊

电话：0571-85776114

传真：0571-85783771

客服热线：95548

公司网站：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

（22）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服电话：95548

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（23）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

电话：021-68777222

传真：021-68777822

联系人：汪明丽

客户服务热线：4008209898

公司网站：www.cnhbstock.com

（24）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

法定代表人：雷杰

联系电话：（0731）85832343

传真：（0731）85832214

联系人：彭博

客户咨询电话：95571

公司网站：www.foundersc.com

（25）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

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

客服电话：400-800-8899

公司网站：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（26）财富里昂证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

电话：021-38784818

传真：021-68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：68777877

公司网站：www.cf-clsa.com

（27）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系电话：021-22169999

联系人：刘晨

客服热线：95525

公司网站：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(28) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

电话：(0755) 82023442

传真：(0755) 82026539

联系人：刘毅

客服电话：95532、400-600-8008

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(29) 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

法定代表人：吴万善

联系电话：(025) 83290979

传真：(025) 51863323

联系人：万鸣

客户咨询电话：95597

公司网站：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(30) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系电话：(021) 23219000

联系人：金芸

客服热线：95553、400-8888-001

公司网站：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(31) 华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：四川省成都市陕西街 239 号

法定代表人：杨炯洋

联系人：李慧灵

电话：010-52723273

传真：(028) 86150040

客户服务电话：4008888818

公司网站：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(32) 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

法定代表人：李玮

联系人：王霖

电话：0531-68889157

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(33) 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 单

元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单

元

法定代表人：牛冠兴

电话：(0755) 82558305

传真：(0755) 82558002

联系人：陈剑虹

客户服务热线：400-800-1001

公司网站：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(34) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

0327

法定代表人：李工

联系电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：甘霖

客服热线：96518（安徽）、4008096518（全国）

公司网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(35) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周熾旻

电话：021-60897869

传真：021-60897869

客户服务电话：4000766123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(36) 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-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户服务热线：95503

公司网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(37) 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

法定代表人：吉晓辉

联系人：唐苑

联系电话（021）61616150

传真（021）63604199

客服热线：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(38) 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

法定代表人：宫少林

联系电话：（0755）82943666

传真：（0755）82943636

联系人：林生迎

客服热线：95565、400-8888-111

公司网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(39) 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

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

客服电话：4008-000-562

公司网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(40) 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

法定代表人：黄金琳

联系人：张宗锐

联系电话：0591-87383600

传真：0591-87383610

客服电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(41) 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

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：(0931) 4890208

传真：(0931) 4890628

客服电话：(0931) 96668、4006898888

公司网站：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

(42) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

客户咨询电话：400-8866-567

公司网站：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.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。

3、场内代销机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

## **二、基金注册登记机构**

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：金颖

电话：(010) 59378839

传真：(010) 59378907

联系人：朱立元

## **三、律师事务所和经办律师**

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

经办律师：刘佳、孙文婷

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

## **四、会计师事务所和经办注册会计师**

名称：安永华明会计师事务所有限责任公司

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

富国创业板指数分级证券投资基金

## 五、 基金的类型

股票型

## 六、 基金份额的分级

本基金的基金份额包括富国创业板指数分级证券投资基金之基础份额（即“富国创业板份额”）、富国创业板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“富国创业板 A 份额”）与富国创业板指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“富国创业板 B 份额”）。其中，富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

### 1.1

## 七、 基金的份额配对转换

本基金基金合同生效后，在富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。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两份富国创业板份额的场内份额申请转换成一份富国创业板 A 份额与一份富国创业板 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一份富国创业板 A 份额与一份富国创业板 B 份额申请转换成两份富国创业板份额的场内份额的行为。

## 八、 基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪创业板指数。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。

## 九、 基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、固定收益产品、货币市场工具、权证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：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于创业板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，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。

## 十、 基金的投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪创业板指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金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。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪创业板指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限

定的范围之内。

### 1. 资产配置策略

本基金管理人主要按照创业板指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据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比例不低于基金资产的 90%，其中投资于创业板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，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) 组合构建原则

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪创业板指数的收益表现。

#### (2) 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、跟踪创业板指数的收益表现。

#### (3) 组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据创业板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创业板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

根据创业板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，从而有效跟踪创业板指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在创业板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数一致。

#### (4) 投资绩效评估

可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中进行相关公告。在正常市场情况下，本基金力争实现年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

### 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，降低跟踪误差。

### 4. 金融衍生工具投资策略

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。

(1) 运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能，构建权证与标的股票的组合，主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益；

(2) 构建权证与债券的组合，利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性，形成保本投资组合；

(3) 针对不同的市场环境，构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合，形成多元化的盈利模式；

(4) 在严格风险监控的前提下，通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究，谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

## 十一、 业绩比较基准

$95\% \times \text{创业板指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$

由于本基金投资标的指数为由深圳证券交易所编制并发布的创业板指数（指数代码：399006），且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 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为  $95\% \times \text{创业板指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，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。

## 十二、 风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国创业板 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；富国创业板 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 十三、 基金投资组合报告

### 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              | 599,399,246.47 | 81.15        |
|    | 其中：股票             | 599,399,246.47 | 81.15        |
| 2  | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 4  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 82,438,419.23  | 11.16        |
| 6  | 其他资产              | 56,798,511.50  | 7.69         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 7 | 合计 | 738,636,177.20 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

## 2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 3、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（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | 8,395,920.75   | 1.24         |
| C  | 制造业              | 321,316,818.71 | 47.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | 13,620,323.00  | 2.01         |
| F  | 批发和零售业           | 2,737,368.00   | 0.40         |
| 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  | 118,714,451.72 | 17.53        |
| J  | 金融业              | —              | —            |
| K  | 房地产业             | —              | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 24,298,645.00  | 3.59         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 13,874,801.62  | 2.05         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 37,434,352.75  | 5.53         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | —              | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 6,476,075.00   | 0.96         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 52,530,489.92  | 7.76         |
| S  | 综合               | —              | —            |
|    | 合计               | 599,399,246.47 | 88.51        |

## 4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### （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  | 300027 | 华谊兄弟 | 999,282 | 27,800,025.24 | 4.11         |
| 2  | 300070 | 碧水源  | 629,575 | 25,806,279.25 | 3.81         |
| 3  | 300058 | 蓝色光标 | 392,275 | 20,319,845.00 | 3.00         |
| 4  | 300104 | 乐视网  | 488,745 | 19,940,796.00 | 2.94         |
| 5  | 300024 | 机器人  | 363,597 | 17,707,173.90 | 2.61         |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 236,963 | 13,859,965.87 | 2.05         |
| 7  | 300146 | 汤臣倍健 | 185,822 | 13,544,565.58 | 2.00         |
| 8  | 300017 | 网宿科技 | 149,518 | 12,664,174.60 | 1.87         |
| 9  | 300002 | 神州泰岳 | 414,112 | 12,220,445.12 | 1.80         |
| 10 | 300133 | 华策影视 | 380,879 | 12,150,040.10 | 1.79         |

(2) 报告期末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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5、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资产。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：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

注：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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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) 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。

本期，本基金持有的华策影视于 2013 年 11 月 8 日公告其重大资产重

组相关方因涉嫌内幕交易被中国证监会立案调查，导致其本次重大资产重组被暂停，并可能存在被终止的风险。

华策影视为本基金跟踪标的指数的样本股，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。

本基金持有的其余九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。

(2) 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。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 228,443.73    |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 7,754.10      |
| 5  | 应收申购款   | 56,562,313.67 |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 56,798,511.50 |

(4) 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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

A、期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

B、期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(6) 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。



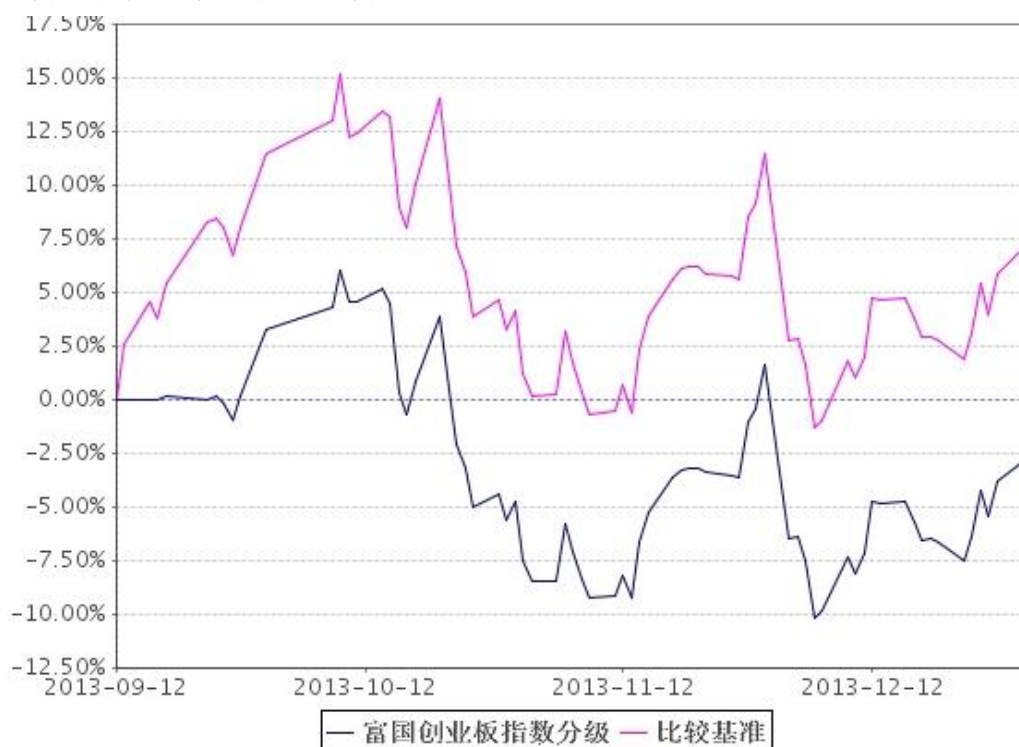
## 十四、 基金的业绩

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、富国创业板指数分级证券投资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    |
|----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2013.9.12-2013.12.31 | -3.20% | 1.78%     | 6.59%      | 1.91%         | -9.79% | -0.13% |

2、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 2013 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2013 年 9 月 12 日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月,截止 2013 年 12 月 31 日本基金仍处于建仓期。

## 十五、 十五、费用概览

### 一、与基金运作有关的费用

#### (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. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金的开户费用；
9. 基金上市费用；
10. 基金的指数使用许可费；
11. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在相关公告中载明；

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### (三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数使用许可费自基金合同生效之日起计收，计算方法如下：

$$H1 = E1 \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H1 为每日应付的指数使用许可费

E1 为前一日基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元，即不足人民币 5 万元则按照 5 万元收取。

由于深圳证券信息有限公司保留变更或提高指数使用许可费的权利，如果指数使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

## 4. 除管理费、托管费和基金的指数使用许可费之外的基金费用，由基

金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （四）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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费

#### （1）场外申购费率

本基金对通过直销中心场外申购富国创业板份额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。

养老金客户指基本养老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，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金基金以及企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。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，基金管理人可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。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

对于通过基金管理人直销中心申购富国创业板份额的养老金客户，申购费率如下：

| 申购金额 (M)            | 申购费率      |
|---------------------|-----------|
| M < 100 万元          | 0.36%     |
| 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.24%     |
| M ≥ 500 万元          | 每笔 1000 元 |

除上述养老金客户外，其他投资者场外申购富国创业板份额，申购费率如下：

| 申购金额 (M)            | 申购费率       |
|---------------------|------------|
| M < 100 万元          | 1.2%       |
| 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.8%       |
| M ≥ 500 万元          | 每笔 1,000 元 |

(2) 场内申购费率

富国创业板份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

(3) 富国创业板份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费率

富国创业板份额的赎回费率为 0.5%。

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、富国创业板份额的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。富国创业板份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低富国创业板份额的申购费率和赎回费率。

**三、基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十六、 基金份额折算

### 一、定期份额折算

在富国创业板 A 份额、富国创业板份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### （一） 基金份额折算日

每个会计年度第一个工作日。

#### （二） 基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的富国创业板 A 份额、富国创业板份额。

#### （三） 基金份额折算频率

每年折算一次。

#### （四） 基金份额折算方式

富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额按照招募说明书“六、基金份额的分级与净值计算规则”进行净值计算，对富国创业板 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份富国创业板份额将按 1 份富国创业板 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

对于富国创业板 A 份额期末的约定应得收益，即富国创业板 A 份额每个会计年度 12 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内富国创业板份额分配给富国创业板 A 份额持有人。富国创业板份额持有人持有的每 2 份富国创业板份额将按 1 份富国创业板 A 份额获得新增富国创业板份额的分配。持有场外富国创业板份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国创业板份额的分配；持有场内富国创业板份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国创业板份额的分配。经过上述份额折算，富国创业板 A 份额和富国创业板份额的基金份额参考净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算日，本基金将对富国创业板 A 份额和富国创业板份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行富国创业板 A 份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

### 1. 富国创业板 A 份额

定期份额折算后富国创业板 A 份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

定期份额折算后富国创业板 A 份额的份额数 = 定期份额折算前富国创业板 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{富国创业板}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前富国创业板份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{每份富国创业板A份额期末资产净值} 1.000) \times NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}}$$

富国创业板 A 份额持有人新增的场内富国创业板份额的份额数 =

$$\frac{NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}} \times (\text{每份富国创业板A份额期末资产净值} 1.000)}{NAV_{\text{富国创业板}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{富国创业板}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后富国创业板份额净值

$NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前富国创业板份额的份额数

$NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前富国创业板 A 份额的份额数

### 2. 富国创业板 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变富国创业板 B 的基金份额参考净值及其份额数。

### 3. 富国创业板份额

$$NAV_{\text{富国创业板}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前富国创业板份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{每份富国创业板A份额期末资产净值} 1.000) \times NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}}$$

富国创业板份额持有人新增的富国创业板份额=

$$\frac{NUM_{\text{富国创业板}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{每份富国创业板A份额期末资产净值} 1.000}{NAV_{\text{富国创业板}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后富国创业板份额的份额数 = 定期份额折算前富国创业板份额的份额数 + 富国创业板份额持有人新增的富国创业板份额的份

额数+ 富国创业板 A 份额持有人新增的富国创业板份额的份额数。

其中：

$NAV_{富国创业板}^{后}$ ：定期份额折算后富国创业板份额净值

$NUM_{富国创业板}^{前}$ ：定期份额折算前富国创业板份额的份额数

## 二、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当富国创业板份额的基金份额净值达到 1.500 元；当富国创业板 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元。

（一）当富国创业板份额的基金份额净值达到 1.500 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

### 1. 基金份额折算日

富国创业板份额的基金份额净值达到 1.500 元，基金管理人可根据市场情况确定折算日。

### 2. 基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额和富国创业板份额。

### 3. 基金份额折算频率

不定期。

### 4. 基金份额折算方式

当富国创业板份额的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额和富国创业板份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额的比例为 1：1，份额折算后富国创业板份额的基金份额净值、富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

当富国创业板份额的份额净值达到 1.500 元后，富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额、富国创业板份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

#### （1）富国创业板 A 份额



份额折算原则：

① 份额折算前富国创业板 A 份额的份额数与份额折算后富国创业板 A 份额的份额数相等；

② 富国创业板 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1.000 元以上的净值部分全部折算为场内富国创业板份额。

$$NUM_{富国创业板}^{后} = NUM_{富国创业板}^{前}$$

富国创业板 A 份额持有人新增的场内富国创业板份额的份额数=

$$\frac{NUM_{富国创业板}^{前} \times (NAV_{富国创业板}^{前} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板 A 份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板 A 份额的份额数

$NAV_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板 A 份额的基金份额参考净值

## (2) 富国创业板 B 份额

份额折算原则：

① 份额折算后富国创业板 B 份额与富国创业板 A 份额的份额数保持 1:1 配比；

② 份额折算前富国创业板 B 份额的资产净值与份额折算后富国创业板 B 份额的资产净值及新增场内富国创业板份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前富国创业板 B 的持有人在份额折算后将持有富国创业板 B 份额与新增场内富国创业板份额。

$$NUM_{富国创业板}^{后} = NUM_{富国创业板}^{前}$$

富国创业板 B 份额持有人新增的场内富国创业板份额的份额数=

$$\frac{NUM_{富国创业板}^{前} \times (NAV_{富国创业板}^{前} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板 B 份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板 A 份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板 B 份额的份额数

$NAV_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板 B 份额的基金份额参考净值

### (3) 富国创业板份额

份额折算原则：

场外富国创业板份额持有人份额折算后获得新增场外富国创业板份额，场内富国创业板份额持有人份额折算后获得新增场内富国创业板份额。

$$NUM_{富国创业板}^{后} = \frac{NAV_{富国创业板}^{前} \times NUM_{富国创业板}^{前}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板份额的份额数

$NAV_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板份额净值

$NUM_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板份额的份额数

(二) 当富国创业板 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### 1. 基金份额折算日

富国创业板 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元，基金管理人可根据市场情况确定折算日。

#### 2. 基金份额折算对象

基金份额折算日登记在册的富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额、富国创业板份额。

#### 3. 基金份额折算频率

不定期。

#### 4. 基金份额折算方式

当富国创业板 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额和富国创业板份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额的

比例为 1: 1, 份额折算后富国创业板份额的基金份额净值、富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

当富国创业板 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后, 富国创业板 A 份额、富国创业板 B 份额、富国创业板份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

(1) 富国创业板 B 份额

份额折算原则:

份额折算前富国创业板 B 份额的资产净值与份额折算后富国创业板 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_{富国创业板}^{后} = \frac{NUM_{富国创业板}^{前} \times NAV_{富国创业板}^{前}}{1.000}$$

其中:

$NUM_{富国创业板}^{后}$ : 份额折算后富国创业板 B 份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{前}$ : 份额折算前富国创业板 B 份额的份额数

$NAV_{富国创业板}^{前}$ : 份额折算前富国创业板 B 份额的基金份额参考净值

(2) 富国创业板 A 份额

份额折算原则:

① 份额折算前后富国创业板 A 份额与富国创业板 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比;

② 份额折算前富国创业板 A 份额的资产净值与份额折算后富国创业板 A 份额的资产净值及新增场内富国创业板份额的资产净值之和相等;

③ 份额折算前富国创业板 A 的持有人在份额折算后将持有富国创业板 A 份额与新增场内富国创业板份额。

$$NUM_{富国创业板}^{后} = NUM_{富国创业板}^{前}$$

富国创业板 A 份额持有人新增的场内富国创业板份额的份额数=

$$\frac{NUM_{富国创业板}^{前} \times NAV_{富国创业板}^{前} - NUM_{富国创业板}^{后} \times 1.000}{1.000}$$

其中:

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板 A 份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板 B 份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板 A 份额的份额数

$NAV_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板 A 份额的基金份额参考净值

(3) 富国创业板份额：

份额折算原则：

份额折算前富国创业板份额的资产净值与份额折算后富国创业板份额的资产净值相等。

$$NUM_{富国创业板}^{后} = \frac{NUM_{富国创业板}^{前} \times NAV_{富国创业板}^{前}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{富国创业板}^{后}$ ：份额折算后富国创业板份额的份额数

$NUM_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板份额的份额数

$NAV_{富国创业板}^{前}$ ：份额折算前富国创业板份额净值

## 十七、 对招募说明书更新部分的说明

富国创业板指数分级证券投资基金招募说明书依据《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》及其它有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、在“重要提示”部分，增加了基金合同生效日、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、在“三、基金管理人”中，对基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。

3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况及基金托管业务经营情况进行了更新。

4、在“五、相关服务机构”中，对直销机构、代销机构部分信息进行

了更新。

5、在“七、基金的募集”部分，删除了募集期、发售对象、发售方式等已不适用信息，增加了本基金募集情况；

6、“八、基金备案与基金合同的生效”部分删除了部分不适用信息，增加了基金合同生效日。

7、“十、富国创业板份额的申购与赎回”部分，增加了本基金开放申购、赎回的日期，对申购和赎回的数额限制等内容进行了更新。

8、“十三、基金的投资”部分，增加了基金投资组合报告，内容截止至2013年12月31日。

9、增加了“十四、基金的业绩”，内容截止至2013年12月31日。

10、“十八、基金费用与税收”增加了申购、赎回费用等内容。

11、“二十五、基金托管协议的内容摘要”更新了基金托管人的注册资本。

12、“二十六、基金份额持有人服务”更新了基金份额持有人交易资料的寄送服务。

13、增加了“二十七、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

二〇一四年四月二十五日