

# 富国优化增强债券型证券投资基金

## 更新招募说明书

(摘要)

(二〇〇九年第一号)

富国优化增强债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中国证券监督管理委员会本基金经中国证监会于2009年4月10日证监许可【2009】296号文批准发起设立。本基金的基金合同于2009年6月10日正式生效。

### 【重要提示】

投资有风险，投资人拟申购本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，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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2009年12月10日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2009年9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：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

法定代表人：陈敏

总经理：窦玉明

成立日期：1999年4月13日

电话：（021）68597788

传真：（021）68597799

联系人：李长伟

注册资本：1.8 亿元人民币

股权结构（截止于 2009 年 12 月 10 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和二个分公司，分别是：权益投资部、固定收益部、另类投资部、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、基金清算部、北京分公司和深圳分公司。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；另类投资部：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、权益投资部和另类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、帐户、社保以及共同基金的机构客户营销工作；零售业务部：管理北京分公司（华北营销中心）、深圳分公司（华南营销中心）和华东营销中心，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；基金清算部：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、行政后勤等。

截止到2009年12月10日，公司有员工151人，其中59%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

## （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。2004年开始担任富国基金管理有限公司董事长。

窦玉明先生，董事，总经理。生于1969年，硕士。历任北京中信国际合作公司交易员；深圳君安证券公司投资经理；大成基金管理有限公司基金经理助理；嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理。2008年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。现任 BMO 投资有限公司亚洲业务总经理，兼任加中贸易理事会董事。

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。

缪恒生先生，董事。生于1948年，中共党员，硕士，高级经济师。历任中

国人民银行上海市分行南市区办事处南码头分理处会计员、副主任；中国人民银行上海市分行南市区办事处会计出纳科副科长；中国工商银行上海市分行南市分行副行长；上海申银证券公司副总经理；申银万国证券股份有限公司副总经理。

Edgar Normund Legzdins 先生，董事。生于 1958 年，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 投资有限公司总裁、BMO 金融集团高级副总裁。

葛航先生，董事。生于 1966 年，大学本科，经济师。历任山东省国际信托有限公司资金信托部业务经理；山东省国际信托有限公司租赁信托部副经理、经理。现任山东省国际信托有限公司自营业务部经理。

戴国强先生，独立董事。生于 1952 年，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。

Wai P. Lam 先生，独立董事。生于 1936 年，会计学博士。1962 年至 1966 年在 PriceWaterHouseCoopers 会计师事务所担任助理会计和高级会计；1966 年至 1969 年在加拿大圣玛利亚大学担任教师；1973 年至 2002 年在加拿大 Windsor 大学担任教授；现任加拿大 Windsor 大学名誉教授。

汤期庆先生，独立董事，生于 1955 年，经济学硕士。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局长、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，大学专科。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。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。

胡志荣女士，监事。生于 1973 年，中共党员，硕士。历任四川成都邮电通信设备厂财务处会计；厦门金达通信电子有限公司财务部财务主管。现任富国基金管理有限公司财务经理。

常松先生，监事。生于 1973 年，中共党员，博士。历任富国基金管理有限公司数量研究员、高级数量研究员、研究策划部数量组组长、金融数量工程部经理。现任富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金经理、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理。

### 3、督察长

李长伟先生，督察长。生于 1964 年，中共党员，经济学硕士，工商管理硕士，讲师。历任河南省政府发展研究中心干部；中央党校经济学部讲师；申银万国证券股份有限公司海口营业部总经理、北京管理总部副总经理兼北京营业部总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2008 年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

窦玉明先生，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。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。

陈戈先生，副总经理。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，2005 年 4 月

起任富国天益价值证券投资基金基金经理至今，2009年1月起兼任权益投资部总经理、另类投资部总经理。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

现任基金经理：钟智伦，生于1968年，经济学硕士，自1994年开始从事证券行业工作。历任平安证券部门经理、上海新世纪投资服务有限公司研究员、海通证券投资经理、富国基金管理有限公司债券研究员、富国天时货币市场基金基金经理，自2008年10月开始担任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理。

#### 6、投资决策委员会

投资决策委员会成员构成如下：公司总经理窦玉明先生，公司主管投研副总经理陈戈先生，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：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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：尹东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，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股发行后建设银行的已发行股份总数为：

233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。

2009年上半年，中国建设银行实现净利润558.41亿元，同比下降4.86%，每股盈利为0.24元（半年），同比减少0.01元，盈利水平符合预期；年化平均资产回报率、年化平均股东权益回报率分别为1.34%和22.54%，较上年全年分别提高0.03和1.86个百分点，整体盈利趋势向好；总资产达到91,101.71亿元，较上年末增长20.58%；资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为1.71%，较上年末下降0.5个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为150.51%，较上年末提升18.93个百分点。

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、纽约设有分行，在伦敦设有全资子公司、在悉尼设有代表处。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）31,896台，居全球银行业首位。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，在2009年上半年共获得40多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的“全球金融品牌500强”、“全球银行1000强”中分列第9位和第12位，被《亚洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”，被《欧洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”，连续两年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”，荣获《亚洲银行家》杂志颁发的“中国风险管理成就奖”，中国扶贫基金会颁发的“20年特别贡献奖”等奖项，被中国红十字基金会评为“最具责任感企业”，连续两年荣

获香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室，现有员工 130 余人。2008 年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第 70 号（SAS70）进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的 SAS70 国际专项认证的托管银行。

## 2、主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，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。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2009 年 9 月 30 日，中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等 7 只封闭式证券投资基金，以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华一道琼斯 88 指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票（LOF）、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合（LOF）、



华夏中小板 ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票 (LOF)、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票 (LOF)、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票 (QDII)、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票 (QDII)、海富通中国海外股票 (QDII)、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信 2026 周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票 (QDII)、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票 (LOF)、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深 300 指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合、天治趋势精选灵活配置混合、中欧价值发现股票、长信恒利优势股票、民生加银增强收益债券、国联安主题驱动股票、宝盈货币市场基金、博时策略灵活配置混合、信诚优胜精选股票、易方达沪深 300 指数、中银中证 100 指数增强、鹏华精选成长股票、金元比联价值增长股票、诺德成长优势股票、摩根士丹利华鑫领先优势、华宝兴业中证 100 指数、华安上证 180ETF 联接基金、农银汇理策略价值股票基金等 125 只开放式证券投资基金。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

1、直销机构：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

法定代表人：陈敏

总经理：窦玉明

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：(021) 68597070

传真：(021) 68597979

联系人：林燕珺

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、代销机构：

(1) 中国建设银行股份有限公司

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：郭树清

电话：(010) 66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

公司网站：[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

电话：(010) 66107900

传真：(010) 66107914

联系人：田耕

客户服务统一咨询电话：95588

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

(3) 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：蒋超良

联系电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408843

联系人：曹榕

客户服务统一咨询电话：95559

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

(4) 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 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195047

联系人：王楠

客户服务电话：95555

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

(5) 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

法定代表人：陈辛

成立日期：1995 年 12 月 29 日

电话：(021) 63370888

传真：(021) 63370777

联系人：张萍

咨询电话：(021) 962888

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

(6) 青岛银行

注册地址：山东省青岛市市南区香港中路 68 号

办公地址：山东省青岛市市南区香港中路 68 号

法定代表人：张广鸿

联系人：徐楠

电话：0532-85709793

客服电话：0532-96588

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

(7) 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，李笑鸣

客服热线：95553、400-8888-001

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

(8) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系电话：(021) 54040596

传真：(021) 54038844

联系人：王序微

客服电话：(021) 962505

公司网站：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

(9) 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：肖时庆

电话：(010) 66568613、(010) 66568587

传真：(010) 66568536

联系人：李洋

客户服务热线：400-8888-888

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

(10) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马昭明

联系电话：(0755) 82492000

传真：(0755) 82492962

联系人：盛宗凌

客户服务咨询电话：400-8888-555

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

(11) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、36、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

开放式基金咨询电话：(020) 87555888

开放式基金业务传真：(020) 87555303

客服电话：95575

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

(12) 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) 83516094

传真：(0755) 83516199

联系人：高峰

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

公司网站：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(13) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：陈敬达

电话：400-8866-338-627802

传真：(0755) 82433794

联系人：袁月

客服电话：(0755) 95511

网站：[www.pa18.com](http://www.pa18.com)

(14) 华泰证券有限责任公司

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) 84457777

传真：(025) 84579763

联系人：张小波

客户咨询电话：(025) 84457777

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

(15) 华泰国联证券有限责任公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：范炎

联系人：袁丽萍

开放式基金咨询电话：(0510) 82831662、(0510) 82588168

开放式基金业务传真：(0510) 82830162

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

(16) 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：徐浩明

联系电话：(021) 50818887-281

联系人：刘晨

咨询电话：(021) 68823685

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

(17) 东海证券有限责任公司

注册地址：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址：上海东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：(021) 50586660

传真：(021) 50586660-8880

联系人：邵一明

客服热线：400-8888-588 (全国)、(021) 32024658 (上海)、0519-88166222

(常州)、0379-64902266 (洛阳)

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

(18) 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：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼 (深圳总部)

法定代表人：胡关金

电话：(0755) 83025913

传真：(0755) 83025991

联系人：张友德

客服热线：400-8888-818

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

(19) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市九江路 111 号

办公地址：上海市九江路 111 号

法定代表人：蒋元真

电话：(021) 65081063

传真：(021) 65217206

联系人：谢秀峰

客服热线：(021) 962518

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

(20) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

联系电话：(0532) 85022026

业务传真：(0532) 85022511

联系人：丁韶燕

客服电话：(0532) 96577

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

(21) 广发华福证券有限公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服电话：0591-87383333

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

(22) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号

法定代表人：李工

联系电话：(0551) 5161671

业务传真：(0551) 5161672

联络人：甘霖

客服热线：0551-96518/400 80 96518

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

(23) 山西证券有限责任公司



注册地址：山西省太原市府西街 69 号国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系电话：(0351) 8686703

联系人：张治国

客户服务电话：400661618

公司网站：www.i618.com.cn

(24) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客服电话：0431-96688

公司网址：<http://www.nesc.cn>

(25) 东莞银行有限责任公司

住所地址：东莞市城区运河东一路 193 号

办公地址：东莞市城区运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

联系人：胡昱

电话：(0769) 22119061

传真：(0769) 22117730

服务热线：96228

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

(26) 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：张佑君

联系电话：(010) 85130588

联系人：魏明

开放式基金咨询电话：400-8888-108（免长途费）；

开放式基金业务传真：（010）65182261

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

（27）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、15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、15层

法定代表人：刘弘

电话：（010）59226788

传真：（010）59226799

联系人：谢亚凡

客服电话：4008878827

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

（28）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

电话：（0755）82825555

传真：（0755）82825560

客服电话：4008001001

联系人：陈剑虹

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

（29）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

办公地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

法定代表人：阎冰竹

电话：（010）66223248

客户服务电话：（010）96169

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

（30）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

电话：(0731) 4403319

传真：(0731) 4403439

联系人：郭磊

客户服务热线：(0731) 4403319

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

(31) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东陆家嘴东路 166 号中保大厦 22 层

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419393-1035 68419974

联系人：杨盛芳

传真：(021) 68419867

客服热线：4008888123

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

(32) 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：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

传真：(010) 85109219

客户服务电话：95599

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

(33) 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 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 楼

法定代表人：唐新宇

联系电话：(021) 68604866-8309

传真：(021) 50372474

联系人：张静

客服热线：(021) 68604866

公司网站：www.bocichina.com

(34) 深圳发展银行股份有限公司

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank N. Newman)

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

邮政编码：518001

联系人：周勤

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

客户服务电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(35) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

电话：(0755) 25859591

联系人：霍兆龙

客户服务电话：40066-99999

公司网站：www.pingan.com

(36) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48 层—50 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48 层—50 层

法定代表人：杨小阳

电话：(0755) 82026521

传真：(0755) 82026539

联系人：刘权

客服电话：4006008008

公司网站：www.cjis.cn

(37) 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楼

法定代表人：肖钢

传真：(010) 66594946

客户服务统一咨询电话：95566

公司网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(38) 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

邮政编码：200001

法定代表人：吉晓辉

联系人：徐伟

联系电话 021) 61618888

传真 021) 63604199

客服热线：95528

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

(39) 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：祝幼一

联系电话：(021) 62580818

传真：(021) 38670666

联系人：芮敏琪

客服热线：400-8888-666

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

(40) 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

法定代表人：陈小宪

联系人：王斌

电话：（010）65542337

传真：（010）65541281

客户服务热线：95558

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

（41）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179号

办公地址：合肥市寿春路179号国元证券大厦

法定代表人：凤良志

电话：（0551）2207936

传真：（0051）2207935

联系人：程维

客服热线：95578、400-8888-777（全国）、96888（安徽）

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

（42）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

联系电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133302

联系人：林建闽

客户服务统一咨询电话：95536

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

（43）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 22 层—29 层

法定代表人：王益民

联系电话：（021）63325888

联系人：吴宇

客户服务号：（021）95503 或 40088-88506

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

(44) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城新华东街111号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城新华东街111号

法定代表人：刘汝军

开放式基金咨询电话：(0471) 4961259、(021) 68405273

开放式基金业务传真：(021) 68405181

联系人：张同亮

联系电话：(021) 68405273

公司网站：www.cnht.com.cn

(45) 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 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：黄健

客服热线：95565、0755-26951111

公司网站：www.newone.com.cn

(46) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 18 楼

法定代表人：陈学荣

电话：(021) 68634518

传真：(021) 68865938

联系人：钟康莺

客服热线：400-8881-551、(021) 38784525

(47) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：（0531）81283938

传真：（0531）82024197

联系人：付咏梅

客户服务热线：95538

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

（48）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：010-68098778

传真：010-68560661

联系人：李伟

客服电话：95595

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

（49）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉新华下路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉新华下路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：（027）65799999

传真：（027）85481882

联系人：毕艇

咨询电话：4008-888-999

（50）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：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座

法定代表人：汤世生

联系人：魏海

电话：010-62267799-6318

客服电话：0991-96562

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



(51) 英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法人代表：赵文安

联系人：王睿

电话：0755-83007069

客服电话：0755-26982993

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

(52) 江海证券经纪有限责任公司

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

法定代表人：孙名扬

联系人：郭玲

联系电话：0451-82269280

客服电话：400-666-2288

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

(53) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

客服电话：400-800-8899

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

(二) 注册登记机构：富国基金管理有限公司

名称：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

法定代表人：陈敏

总经理：窦玉明

成立日期：1999年4月13日

电话：(021) 68597788

传真：(021) 68597799

联系人：雷青松

(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：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：廖海

经办律师：廖海、吴军娥

(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：上海市长乐路989号世纪商贸广场23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

富国优化增强债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

契约型开放式

## 六、基金的投资目标

本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。

## 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债券、股票、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券等固定收益类资产(含含权债券)的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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

本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差

和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。

## 1、资产配置策略

### (1) 整体资产配置策略

本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期收益率的变化情况，进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

### (2) 类属资产配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，有必要将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。在整体资产配置策略的指导下，本基金根据资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理以及市场流动性等因素，将市场细分为普通债券(含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等)、附权债券(含可转换公司债、各类附权债券等)、资产证券化产品、金融创新(各类金融衍生工具等)四个子市场，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数。

### (3) 明细资产配置策略

在明细资产配置上，首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合；其次，根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比，对照基金的收益要求决定是否纳入组合；最后，根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间)，决定投资总量。

## 2、固定收益类产品投资策略

### (1) 普通债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，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、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积

极调整。

①久期控制是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的整体久期，有效的控制整体资产风险。

②期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

③信用风险控制是管理人充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

④跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券债组合，提高投资收益，实现跨市场套利。

⑤相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。

## （2）附权债券投资策略

附权债券指对债券发行体授予某种期权，或者赋予债券投资者某种期权，从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地，从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性，也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。

### ①可转换公司债券投资策略

可转换公司债券不同于一般的企业(公司)债券，其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值，是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。

可转换公司债券最大的优点在于，可以用较小的本金损失，博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布，买入低转换溢价率的债券，并持有的投资策略，只要在可转换公司债券的存续期内，发行转债的公司股票价格上升，则投资就可以获得超额收益。

可转换公司债券可以按照协议价格转换为上市公司的股票，因此在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。本基金持有

的可转换公司债券可以转换成股票。基金管理人在日常交易过程中，会密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系，恰当的选择时机进行套利。

#### ②其它附权债券投资策略

本基金利用债券市场收益率数据，运用利率模型，计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差(OAS)，作为此类债券投资估值的主要依据。

分离交易可转换公司债券，是认股权证和公司债券的组合产品，该产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证自可交易之日起 30 个交易日内全部卖出。分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

#### (3) 资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构化安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

#### (4) 回购套利策略

基金管理人在发现债券市场明显投资机会的情况下，或债券市场存在套利机会时，通过回购等融资融券手段，应用适量的杠杆获取超额收益。

### 3、股票投资策略

#### (1) 一级市场新股申购策略

本基金将深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，挖掘公司的内在价值，根据当时股票市场整体投资环境及定价水平，发行折价水平及一、二级市场间资金供求关系，在有效控制风险的前提下制定相应的新股认购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

#### (2) 二级市场股票投资策略

当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本基金可以直接参

与股票二级市场投资，努力获取超额收益。在二级市场投资过程中，本基金主要采取自下而上的投资策略，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，结合国内市场的特征，利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法，对以下三类上市公司进行投资：

①现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红纪录或现金分红潜力的优质上市公司；

②投资价值明显被市场低估的上市公司；

③未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。

#### 4、权证投资策略

在确保与基金投资目标一致以及风险可控的前提下，本基金可适度进行谨慎的权证投资。基金对权证投资的目标首先是控制并降低组合风险，其次是令基金资产增值。本基金的权证投资策略包括：

(1) 采用市场认可的多种期权定价模型并根据研究人员对公司基本面等因素的分析，形成合理的对权证的定价；

(2) 对标的股票进行价值判断，结合权证市场发展的具体情况，决策权证的买入、持有或沽出操作；

(3) 本基金权证投资策略包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等。

#### 5. 投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员，负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

#### 6. 投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制

定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

(1) 基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合本基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

(2) 投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

(3) 基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

(4) 对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

## 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	权益投资	105,757,503.15	3.91
	其中：股票	105,757,503.15	3.91
2	固定收益投资	1,930,665,278.30	71.34
	其中：债券	1,930,665,278.30	71.34
	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	510,991,492.21	18.88
6	其他资产	158,980,148.99	5.87
7	合计	2,706,394,422.65	100.00



## 2、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	采掘业	—	—
C	制造业	46,241,503.79	1.72
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	577,704.60	0.02
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	40,000,976.47	1.48
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	5,662,822.72	0.21
C8	医药、生物制品	—	—
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	57,972,112.56	2.15
H	批发和零售贸易	—	—
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	1,543,886.80	0.06
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	105,757,503.15	3.93

## 3、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	600050	中国联通	8,000,000	50,800,000.00	1.89
2	000578	盐湖集团	1,699,999	40,000,976.47	1.48
3	300002	神州泰岳	71,753	4,161,674.00	0.15
4	300001	特锐德	89,582	2,132,051.60	0.08
5	300003	岳普医疗	70,615	2,047,835.00	0.08
6	300010	立思辰	91,947	1,655,046.00	0.06
7	601888	中国国旅	131,060	1,543,886.80	0.06
8	002115	三维通信	70,264	1,355,392.56	0.05
9	300007	汉威电子	42,313	1,142,451.00	0.04
10	300005	探路者	29,177	577,704.60	0.02

## 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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	589,680,000.00	21.89

3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,235,112,340.70	45.85
5	企业短期融资券	101,090,000.00	3.75
6	可转债	4,782,937.60	0.18
7	其他	—	—
8	合计	1,930,665,278.30	71.67

#### 5、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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	0901040	09 央行票据 40	2,000,000	196,580,000.00	7.30
2	0901042	09 央行票据 42	2,000,000	196,560,000.00	7.30
3	0901044	09 央票 44	2,000,000	196,540,000.00	7.30
4	0980110	09 远洋地产债	1,500,000	148,860,000.00	5.53
5	0881264	08 莱钢 CP01	1,000,000	101,090,000.00	3.75

#### 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。

#### 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五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（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基金合同规定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	70,048.49
2	应收证券清算款	9,253,689.68
3	应收股利	—
4	应收利息	22,571,937.37
5	应收申购款	127,084,473.45

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	158,980,148.99

(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

序	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300002	神州泰岳	4,161,674.00	0.15	新股认购
2	300001	特锐德	2,132,051.60	0.08	新股认购
3	300003	岳普医疗	2,047,835.00	0.08	新股认购
4	300010	立思辰	1,655,046.00	0.06	新股认购
5	601888	中国国旅	1,543,886.80	0.06	新股认购
6	002115	三维通信	1,355,392.56	0.05	增发新股
7	300007	汉威电子	1,142,451.00	0.04	新股认购
8	300005	探路者	577,704.60	0.02	新股认购

(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、富国优化增强债券型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

(1) A/B 级

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

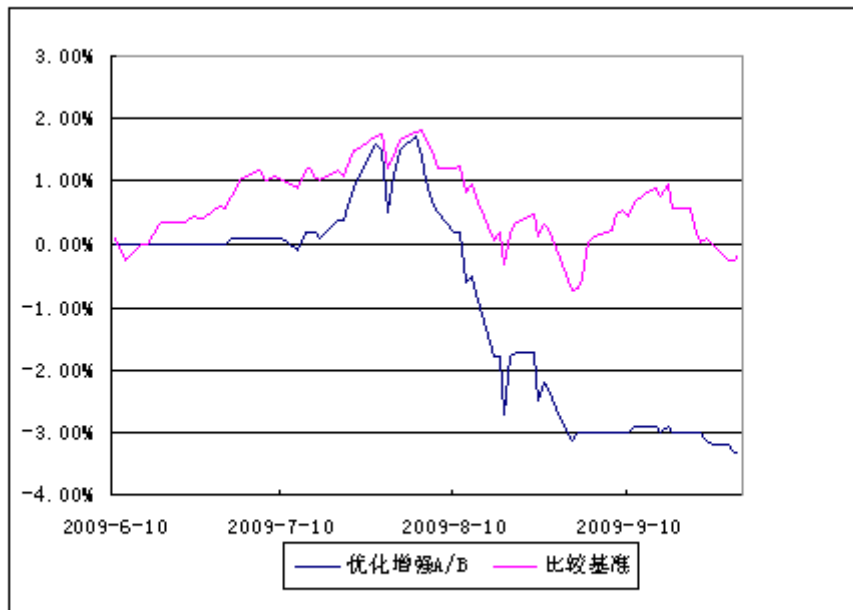
2009. 6. 10-2009. 9. 30	-3.30%	0.30%	-0.15%	0.22%	-3.15%	0.08%
-------------------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

(2) C 级

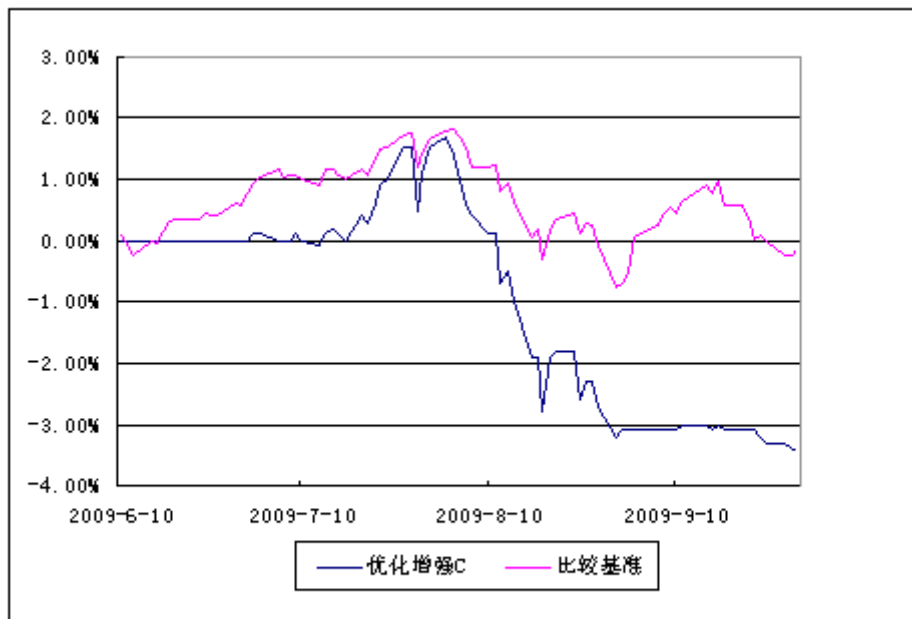
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009. 6. 10-2009. 9. 30	-3.40%	0.30%	-0.15%	0.22%	-3.25%	0.08%

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：

(1) 自基金合同生效以来富国优化增强债券型 A/B 级基金累计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



(2) 自基金合同生效以来富国优化增强债券型 C 级基金累计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：截止日期为 2009 年 9 月 30 日。

本基金于 2009 年 6 月 10 日成立，建仓期 6 个月，从 2009 年 6 月 10 日至 2009 年 12 月 9 日，截至 2009 年 9 月 30 日，本基金尚处于建仓期。

## 十三、费用概览

### （一）与基金运作有关的费用

#### 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）本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费
- （4）基金财产拨划支付的银行费用；
- （5）基金合同生效后的基金信息披露费用；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （8）基金的证券交易费用；
- （9）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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。

### 3、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 0.7% 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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

#### (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 0.2% 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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### (3) 销售服务费

本基金 A 类和 B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。

(4) 除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，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。

#### 4、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。

5、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和基金销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。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、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

(1) 投资者在申购 A 类基金份额时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减。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。具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
100 万元以下	0.8%
100 万元（含）—500 万元	0.5%
500 万元（含）以上	1000 元/笔

(2) 投资者在申购 B 类基金份额时需交纳后端申购费，费率按持有时间递减，具体如下：

持有时间	后端申购费率
1 年以内（含）	1.0%

1年—3年（含）	0.6%
3年—5年（含）	0.4%
5年以上	0

(3) 投资者在申购C类基金份额时不需要交纳申购费用。

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

## 2、赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的25%归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

本基金对A类、B类及C类基金份额收取赎回费，在投资者赎回时收取。

A类、B类及C类基金份额适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有年限	A类、B类基金份额 赎回费率	C类基金份额 赎回费率
30天以下	0.1%	0.1%
30天（含）—1年（含）	0.1%	0
1年—2年（含）	0.05%	0
2年以上	0	0

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定，在履行相应程序后调整申购费率和调低赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 3、转换费

(1) 基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额；投资者在上述两只基金之间进行转换时，注册登记机构将收取一定的转换费。

(2) 投资者将富国优化增强债券型证券投资基金（前端、后端）与富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天合稳健优选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、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金进行转换时，其拟转换份额持有时间不足1年的，转换



费率为 0.3%；拟转换份额持有时间达到或超过 1 年的，免收转换费。

(3) 富国优化增强债券型证券投资基金（前端、后端）与富国货币间的转换：

目前，暂时不开放旗下以后端收费模式申购的开放式基金（富国天源、富国天益、富国天利、富国天益、富国天瑞、富国天合、富国天成、富国天鼎、富国优化增强债券）向富国货币的转换业务。

由富国货币转出至富国优化增强债券（前端、后端），视同于先赎回富国货币，再申购富国优化增强债券（前端、后端）；由富国优化增强债券（前端）转出至富国货币，视同于先赎回富国优化增强债券（前端），再申购富国货币。

(4) 富国优化增强债券型证券投资基金（C 类）与富国天源、富国天利、富国天益、富国天瑞、富国天合、富国天成、富国天鼎之间的转换：

由富国优化增强债券（C 类）转出至富国天源、富国天利、富国天益、富国天瑞、富国天合、富国天成、富国天鼎基金，视同于先赎回富国优化增强债券（C 类），再申购上述基金；由富国天源、富国天利、富国天益、富国天瑞、富国天合、富国天成、富国天鼎基金转出至富国优化增强债券（C 类），视同于先赎回上述基金，再申购富国优化增强债券（C 类）。

(5) 富国优化增强债券（C 类）与货币基金之间的转换：

由富国优化增强债券（C 类）转入货币基金，视同于先赎回富国优化增强债券（C 类），再申购货币基金；由货币基金转入富国优化增强债券（C 类）不收取转换费。

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下，调整上述收费方式和费率水平，但最迟应于新收费办法开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(三) 其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

## 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”部分对基金管理人主要人员情况等内容进行了更新。

3、“四、基金托管人”部分对基金托管人基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容进行了更新。

4、“五、相关服务机构”部分对代销机构及安永华明会计师事务所中部分信息进行了更新，增加了山西证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东莞银行有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京银行股份有限公司、财富证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、深圳发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信银行股份有限公司、国元证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、恒泰证券股份有限责任公司、招商证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、中国光大银行股份有限公司、长江证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、英大证券有限责任公司、江海证券经纪有限责任公司、信达证券股份有限公司的相关信息。

5、“六、基金的募集”部分删除了认购安排等已不适用的信息，增加了本基金的募集情况。

6、“基金合同的生效”部分增加了本基金的基金合同生效日。

7、“八、基金份额的申购与赎回”部分对本基金申购和赎回的场所进行了更新，增加了本基金开始办理日常申购、赎回的日期，完善了可与本基金转换的基金名单及业务规则。

8、“九、基金的投资”部分新增了本基金 2009 年第三季度的投资组合报告。

9、增加了“十、基金的业绩”，内容为本基金基金合同生效至 2009 年 9 月 30 日的基金业绩及历史走势对比图。

10、“十四、基金的费用与税收”部分增加了与基金销售有关费用的列示。

11、“十七、风险揭示”部分在声明中对本基金的代销机构进行了更新。

12、“十九、基金合同内容摘要”中根据《证券投资基金信息披露内容与格

式准则》（第 5 号招募说明书的内容与格式）的要求，将（三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算变更为（三）基金合同解除和终止的事由、程序，删除了基金合同的变更的内容。

13、“二十、托管协议的内容摘要”中根据《证券投资基金信息披露内容与格式准则》（第 5 号招募说明书的内容与格式）的要求，将（五）基金资产净值计算和会计核算变更为（五）基金资产净值计算与复核，删除了基金资产估值方法和特殊情形的处理、基金份额净值错误的处理方式、暂停估值与公告基金份额净值的情形等内容，并更新了基金托管人的邮政编码。

14、“二十一、基金份额持有人服务”部分本公司对基金对账单邮寄服务规则进行了调整。

15、增加了“二十二、其它应披露事项”，内容为本基金报告期内应披露的相关事项。

富国基金管理有限公司

二〇一〇年一月十五日