

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)

(二〇一九年第一号)

重要提示

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会2017年7月17日证监许可[2017]1252号文注册。本基金的基金合同于2018年2月8日生效。

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,也不表明投资者于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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,投资者认购(申购)基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身风险承受能力,理性判断市场,对认(申)购基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策,自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人不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。本基金的投资范围包括中小企业私募债券,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券,由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,存在较大流动性风险。当发生主体信用资质恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。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,由投资者自行承担。

本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

本招募说明书所载内容截止至2019年2月8日。基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2018年12月31日(财务数据未经审计)。

第一部分 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: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:陈晖
成立日期:1999年4月13日
电话:(021)20361818
传真:(021)20361616
联系人:赵瑛
注册资本:5.2亿元人民币
股权结构(截止于2019年02月08日):

| 股东名称 | 持股比例 |
|-----------------|--------|
| 上海国金证券股份有限公司 | 27.76% |
| 申万宏源证券有限公司 | 27.76% |
| 加拿大皇家银行(中国)有限公司 | 27.76% |
| 山东省国际信托股份有限公司 | 16.67% |

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,确保公司日常经营运作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。

公司目前下设二十五个部门、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、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、多元资产投资部、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、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、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部(董事会办公室)、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、一对多非公募固定收益类专户的投资管理;固定收益信用研究:建立和完善债券信用评级体系,开展信用研究等,为公司固定收益类投资决策提供研究支持;固定收益策略研究部:开展固定收益投资策略研究,统一固定收益投资中台管理,为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制;多元资产投资部:根据法律法规、公司规章制度、契约要求,在授权范围内,负责FOF基金投资运作和资产配置、跨策略的多元资产配置产品的投资管理;量化投资部:负责有关量化投资管理业务;海外权益投资部:负责公司在国际境外(含香港)的权益投资管理;权益专户投资部:负责社保、保险、OFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理;养老金业务部:负责养老金(企业年金、职业年金、基本养老金、社保等)及类养老金专户等产品的投资管理;权益研究部:负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等;集中交易部:负责投资交易和风险控制;机构业务部:负责年金、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、广东营销中心、深圳营销中心、北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心、负责公募基金的销售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定与落实、品牌建设和媒介客户服务;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:制定客户服务策略,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战略和实施细则,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;合规稽核部:履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责,开展内审与内控、管理信息披露、法律事务等;风险管理部:执行公司整体风险管理策略,牵头拟定公司风险管理制度与流程,组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对,负责公司旗下各投资组合合规监控等;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;综合管理部(董事会办公室):负责公司董事会日常工作、公司文件管理、公司(内部)宣传、信息宣传、行政后勤管理等工作;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。

截止至2019年1月31日,公司有员工445人,其中69%以上具有硕士以上学历。

二、主要人员情况

(一)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基金管理部办公室主任。
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,副经理,2005年4月至2014年4月任富国天价值证券投资基金基金经理。
麦陈婉芬女士(Constance Mak),董事,文学及商学士学位,加拿大特许会计师,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)会计师事务所的合伙人。
方荣义先生,董事,博士,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、首席风险官、董事会秘书。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。
袁长江先生,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,南北营业部总经理助理、总经理,申银万国证券公司湖北营业部总经理、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。
张科先生,董事,本科学历,经济师。现任山东省国际信托股份有限公司固有业务管理部总经理。历任山东省国际信托股份有限公司基金信贷部业务员,基金投资理财业务员,基建基金管理部业务员,基建基金管理部信托经理、基建基金管理部副总经理、固有业务管理部副总经理。
何宗豪先生,董事,硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务管理总部总经理。历任人民银行上海市徐汇区办事处计划信贷科、组织科科员,工商银行徐汇区办事处建信部支行管理处党支部书记、党支部书记兼管理处副主任(主持工作);上海申银证券公司财会部科员;上海申银证券公司浦东公司财会部筹备负责人;上海申银证券公司浦东公司财会部副经理、经理;申银万国证券股份有限公司浦东分公司财会部经理,申银万国证券股份有限公司财务管理总部(经理、总经理助理、申银万国证券股份有限公司计划财会管理总部副总经理、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。
李文庆先生,独立董事,研究生学历。现任上海金融学会常务副理事长。历任上海仪器仪表研究所计划科科长、办公室主任、办公室主任、副局长、党组书记;上海市浦东新区政府办公室主任、外事办公室主任、区政府党组成员;上海市松江区区委常委、副区长;上海市金融服务办公室副主任、中共上海市金融工作委员会委员;上海市政协常委、上海市政协民族和宗教委员会主任。
傅娟娟(Cary S. Ng)先生,独立董事,研究生学历,加拿大特许会计师。现已退休。1976年加入加拿大毕马威会计师事务所的前身Thome 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., MJL Global Business Developments Inc., UniLink Telecom Inc.等国际性公司为首席财务总监(CFO)及财务副总裁,圣嘉力学院(Seneca College)工商会计及财务金融科教授。
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。

(二)监事会成员

付吉广先生,监事长,研究生学历。现任山东省国际信托股份有限公司风控总监。历任济宁信托投资公司投资部科员,济宁市留庄港运输总公司董事、副总经理,山东省国际信托投资有限公司行业业务部经理、副经理,山东省国际信托投资有限公司稽核法律部经理,山东省中鲁远洋渔业股份有限公司财务总监,山东省国际信托有限公司信托业务四部经理。
沈寅先生,监事,本科学历。现任申万宏源证券有限公司合规与风险管理中心法律合规部副总经理,风险管理办公室副主任,公司律师。历任上海市高级人民法院助理研究员,上海市中级人民法院,上海市第二中级人民法院助理审判员、审判员、审判组长,办公室综合科科长,以及上海仲裁委员会仲裁员。
张晓女士,监事,博士。现任蒙特利尔银行亚洲区和蒙特利尔银行(中国)有限公司首席风险官。历任美国加州理工大学化学系研究员,加拿大多伦多大学化学系助理教授,蒙特利尔银行市场风险管理部模型发展和风险审查高级经理,蒙特利尔银行操作风险本管理总监,逆回购证券交易风险管理部副总裁兼主管,华侨银行集团市场风险控制主管,新加坡交易所高级副总裁和风险管理部主管。

傅旭先生,监事,研究生学历。现任海通证券股份有限公司稽核部副总经理,历任海通证券股份有限公司稽核部二部经理、二级经理、稽核部总经理助理等。
李晋薇女士,监事,研究生学历。现任富国基金管理有限公司运营部运营总监。历任富国基金管理有限公司资金清算员、登记结算主管、运营总监助理、运营部运营副总监。
肖凯先生,监事,博士。现任富国基金管理有限公司集中交易部风控总监。历任上海金新金融工程研究院部门经理、友联战略管理中心部门经理,富国基金管理有限公司监察部风控监察员,高级风控监察员,稽核副总监。
杨轶女士,监事,本科学历。现任富国基金管理有限公司零售业务部零售总监助理。历任辽宁证券分公司北京西路营业部客户经理、富国基金管理有限公司客户服务经理、营销策划经理、高级销售支持经理。

沈蕾女士,监事,本科学历。现任富国基金管理有限公司人力资源部人力资源总监助理。历任上海交通大学南洋中学教师、博朗软件开发(上海)有限公司招聘主管、思源电气股份有限公司人事行政部部长、富国基金管理有限公司人事经理。

(三)督察长

赵瑛女士,研究生学历,硕士学位。曾任职于海通证券股份有限公司业务部、上海国盛(集团)有限公司资产管理部/风险管理部,海通证券股份有限公司合规与风险管理总部、上海海通证券资产管理有限公司合规与风控部;2015年7月加入富国基金管理有限公司,历任监察稽核部总经理,现任富国基金管理有限公司督察长。
(四)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,本科学历,工商管理硕士学位。曾任漳州进出口商品检验局秘书,晋江进出口商品检验局办公室负责人,厦门证券公司业务经理;1998年10月参与富国基金管理有限公司筹备,历任监察稽核部稽核员,高级稽核员、部门副经理、部门经理、督察长,现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,硕士学位。曾任中国建设银行上海市分行职员,华安基金管理有限公司市场总监、副营销总监;2014年5月加入富国基金管理有限公司,现任富国基金管理有限公司副总经理。
李奕薇女士,研究生学历,博士学位,高级经济师。曾任国家教委外贷贷款办公室项目官员,摩士丹利资本国际(Barru公司)(MSCI BARRA)BARRA股票风险评估部高级研究员,巴克莱国际投资管理公司(Barclays Global Investors)大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员;2009年6月加入富国基金管理有限公司,历任基金经理、量化与海外投资部总经理、公司总经理助理,现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金基金经理。
邵少胤先生,研究生学历,博士学位,2000年6月加入富国基金管理有限公司,历任产品开发主管、基金经理助理、基金经理,研究部总经理,权益投资部总经理、公司总经理助理,现任富国基金管理有限公司副经理兼权益投资部副经理兼基金经理。

(五)本基金基金经理

(1)现任基金经理

1)钟智伦,硕士,曾任平安证券有限责任公司部门经理,上海新世纪投资服务有限公司研究员;海通证券股份有限公司投资经理;2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员;2006年6月至2009年3月任富国天时时市场基金基金经理;2008年10月至今任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理;2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理;2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理;2015年3月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理;2015年3月至2018年7月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理;2015年5月起任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年12月起任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理;2017年3月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理;2017年6月至2018年12月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金;2017年6月至2018年7月任富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理;2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理;2017年8月起任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年9月起任富国祥和定期开放债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理;2017年9月至2018年11月任富国富国嘉利稳健配置混合型证券投资基金基金经理;2017年11月起任富国国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金;2017年11月至2018年12月任富国国机灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

2)陈斯博,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

3)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

4)陈斯博,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

5)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

6)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

7)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

8)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

9)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

10)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

11)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

12)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

13)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

14)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

15)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

16)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

17)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

18)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

19)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

20)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

21)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

22)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

23)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

24)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

25)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

26)李英薇,硕士,自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员,投资经理;2016年10月加入富国基金管理有限公司,自2016年10月至2018年3月任投资经理,自2018年3月起任富国丰利增强债券型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,富国中证10年期国债交易开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年5月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

直销网站:直销中心
直销中心地址: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:021-206513177
联系人:孙迪
公司网站:www.fund123.cn

(二)代销机构

1)西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址:拉萨市北京中路101号
办公地址:拉萨市北京中路101号
法人代表:陈宏
联系人:唐湘怡
客服电话:96357
公司网站: http://www.18.cn

2)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼

3)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:上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法人代表:其实
联系人:潘世友
客服电话:4006-788-887
公司网站: www.1234567.com.cn

4)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区南汇路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表:杨文斌
联系人:张劼
客服电话:4007-009-665
公司网站: www.ehowbuy.com

5)浦联(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法人代表:陈柏青
联系人:张裕
客服电话:4000-766-123
公司网站: www.fund123.cn

6)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表:凌顺平
联系人:吴强
客服电话:4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com

7)北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
法人代表:江卉
联系人:徐博宇
客服电话:95118
公司网站: http://fund.jd.com/

(三)其他
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构销售本基金,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
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:上海市通力律师事务所
注册地址: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
经办律师:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华
电话:(021)31358666
传真:(021)31358666
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(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东2楼A座
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
执行事务合伙人:毛建彤
联系电话:021-22288888
传真:021-22280000
联系人:蒋燕华
经办注册会计师:蒋燕华、石静筠

第四部分 基金名称
富国宝利增强债券型发起式证券投资基金
第五部分 基金类型
债券型证券投资基金

第六部分 投资目标
本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,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。

第七部分 基金投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的市债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债(含中小企业集合债)、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股票(包括中小创、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规和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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证的比例不超过基金资产的20%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金资产配置
本基金按照自上而下的方法进行基金资产配置,通过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公司债券,可分离交易可转债、中小企业私募债券,可交换债券等债券品种,加以对国家债券、金融债、央行票据、中期票据以及质押及买断式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
本基金在基金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,进而确定固定收益类资产、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
不同类属的债券在收益率、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中以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(含可转换公司债券、各类附权债券等)、资产证券化产品、金融创新产品(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重。
(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.债券投资策略
(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、两端策略和梯形成策略等,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信用风险控制是基金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及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,构建和调整债券投资组合,提高投资收益,实现跨市场套利。
⑤相对价值判断是相对同类债券的相对价格判断,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主体授予某种期权,或者赋予债券投资者某种期权,从而使债券发行主体或投资者有某种灵活的选择余地,从而增强该种金融工具对不同发行主体融资的灵活性,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、分离交易可转债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公司债,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券内含期权价值,是一种既具有债性,又具有股性的混合金融产品,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,博取股票上涨的巨额收益,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,买入低转股溢价率的债券,并持有其投资期,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涨,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