

关于拟对富国富盛量化对冲股票型养老金产品 法律文件进行变更的公告

富国基金管理有限公司作为企业年金基金投资管理人，发起设立富国富盛量化对冲股票型养老金产品，该养老金产品已于 2016 年 3 月 23 日获得人力资源社会保障部备案确认（人社厅函〔2016〕118 号，登记号 99PF20160247），产品目前已运作。

为更好契合该养老金产品的管理需求，根据《关于企业年金养老金产品有关问题的通知》（人社部发〔2013〕24 号）和《关于加强养老金产品管理有关问题的通知》（人社厅发〔2019〕85 号）相关规定，经与托管人协商一致，拟对产品投资管理合同、托管合同相关条款做如下变更：

1. 产品名称由“富国富盛量化对冲股票型养老金产品”变更为“富国富盛股票型养老金产品”。

2. 权益投资策略调整为：

本产品权益投资综合采用以下一种或多种股票投资策略获取收益，所采取的多种投资策略包括但不限于：

（1）主动投资策略

自下而上精选个股。以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种。我们重点关注的股票主要包括但不限于：

- 1) 市净率 P/B 低于市场平均水平；
- 2) 与同行业的或主营业务相近的其它公司相比，公司具有相对价值；
- 3) 结合公司未来业务发展和盈利水平确定的市盈率水平（动态市盈率）偏低；
- 4) 企业拥有未被市场认识或被市场低估的资源；
- 5) 企业经过并购和资产重组等事项后，基本面发生了积极变化，且其潜在价值未被市场充分认识；

（2）量化投资策略

采用多因子选股策略等量化投资策略，利用定量的方法，考虑宏观、技术面、

基本面等多种定价因素，对股票的价值进行评估，捕捉其定价偏差所形成的投资机会。买入低估的股票，卖出高估的股票，追求与市场波动的低相关性以及较高的成功概率。

投资管理人借鉴国际一流定量分析的应用经验，将股票超额收益的来源分解成行业及个股两个部分，建立多因子模型，在对多因子模型预测的基础上完成对股票超额收益的预测。

（3）新股投资策略

本产品将根据对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性、竞争力、成长性、估值水平等因素的综合分析选择新股。新发股票上市交易后，本产品将根据对股票内在投资价值的分析，结合市场环境的判断，选择适当的时机卖出。

3. 业绩比较基准调整为：

万得偏股混合型基金指数（885001.WI）。

4. 根据法规，修改投资经理变更时报告的时效要求。

产品投资管理人和注册登记业务人仍为富国基金管理有限公司，托管人仍为中国建设银行股份有限公司。

我公司后续将同步向人力资源社会保障部履行产品法律文件修订备案手续。待备案手续完成后，我公司将在备案确认之日起15日内，将法律文件变更内容以公告方式通知产品份额持有人，并同时公告经修改后的投资管理合同、托管协议等法律文件。

特此公告。

富国基金管理有限公司

2025 年 12 月 5 日