(上接C217版)
网址:www.hlzqgs.com
(7)财富证券有限责任公司
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表:周晖
客户服务热线:0731-84403319
联系人:胡智
电话:0731-84779521
传真:0731-84403439
网址:www.cfzq.com
(8)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
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-96326
联系人:张鹏
电话:0591-87278701/
传真:0591-87841150
网址:www.gfhfzq.com.cn
(9)大通证券股份有限公司
客服电话:4008-169-169
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
网址:www.datongzq.com.cn
(10)中原证券股份有限公司
地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
法定代表人:石保上
客服电话:0371-967218、4008139666
联系人:程月艳、耿铭
联系电话:0371-65585670
联系传真:0371-65585665
网址:www.ccnew.com
(11)西南证券股份有限公司
地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
客服电话:4008096096
联系人:徐雅筠、杨再巧
网址:www.swsc.com.cn
(12)山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
客服电话:0351-8686868
联系人:张治国
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
网址:www.i618.com.cn
(13)天源证券经济有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
统一客服电话:4006543218
公司网站地址:www.tyzq.com.cn
(14)天风证券有限责任公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:翟璟
联系电话:(027)87618882/(028)86711410
传真:(027)87618863
公司网站:www.tfzq.com
(15)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:曾小普
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6282293
网址:www.gsstock.com
3、场内代销机构
指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。
(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人:朱立元
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
住所:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:靳庆军、宋萍萍
联系人:宋萍萍
(四)会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦3楼
法人代表:杨绍信
经办注册会计师:汪棵、金毅
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:金毅
四、基金的名称
本基金名称:大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)
五、基金的类型
本基金类型:混合型基金
六、基金的运作方式
本基金运作方式:契约型上市开放式
七、基金的投资目标
在控制风险和保证流动性的前提下,超越业绩比较基准,寻求基金资产的长期稳健增值。
八、基金的投资范围
本基金的投资范围限于国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。
本基金股票投资比例范围为基金资产的40%-95%;现金和固定收益类证券投资比例范围为基金资产的5%-60%,其中资产支持证券投资比例范围为0-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的投资比例不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或中国证监会修改基金投资品种的规定,基金管理人在履行相应程序后,可以依据新的规定修订基金的投资范围;如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券投资的比例限制,基金管理人可相应调整基金的投资比例规定,不需经基金份额持有人大会审议。
九、基金的投资策略
本基金以股票投资为主,采用积极的投资策略,精选具备持续增长能力,价格处于合理区间的优质股票构建投资组合;本基金以固定收益品种投资为辅,确保投资组合具有良好的流动性。
1、资产配置策略
本基金在经济因素分析、经济周期分析、经济政策分析的基础上完成战略资产配置(SAA),其中:经济因素分析主要包括利率分析、汇率分析和通货膨胀率分析;经济周期分析主要通过对国民生产总值、工业生产总值、消费总量、投资总量等宏观统计数据的周期性波动的定量分析完成;经济政策分析包括存款准备金率、再贴现率和公开市场操作等货币政策分析以及政府购买水平、政府转移支付水平和税率变动情况等财政政策分析。

大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

本基金在通过战略资产配置确定各类别资产权重后,根据对投资组合中各类资产短期收益率变化的预测,确定资产类别定价差异,实现从相对较高估值资产到相对较低估值资产的再配置,即战术资产配置(TAA),以获得更高的投资收益。
2、股票投资策略
本基金的股票投资策略包获取超额收益和控制风险两个层面。
(1)收益层面
盈利的增长是支持股票价格快速、长期上涨的动力,而盈利增长水平是众多因素共同作用的结果,其中行业因素是影响企业增长性的主要外部因素;科技创新、消费趋势等则是影响企业增长性的主要内部因素。本基金将主要通过行业分析和企业研究进行股票投资的收益性选择。
①行业分析
本基金将通过行业发展现状分析、行业竞争结构分析和行业发展趋势分析,评价行业增长潜力:
A.行业发展现状分析,主要包括:
(A)行业增长率、产品集中度、企业地域分布分析;
(B)发达国家行业发展状况及行业梯度转移趋势分析;
(C)政府政策导向分析等。
B.行业竞争结构分析,主要包括:
(A)行业价值链分析及行业内主导竞争作用力分析;
(B)行业内主要竞争者财务状况及其竞争策略分析;
(C)行业所处周期及需求状况分析等。
C.行业未来发展趋势分析,主要包括:
(A)行业未来需求趋势及行业演变规律分析;
(B)行业内购并整合的可能性分析等。
②企业研究
本基金通过对企业利润增长水平的定量分析和企业创新能力、管理水平的定性分析,评价企业的增长潜力:
A.利润增长水平分析,主要包括:
(A)企业主营业务收入增长率分析;
(B)企业净利润增长率分析;
(C)企业净资产收益率分析;
(D)企业资产负债水平分析等。
B.企业创新能力分析,主要包括:
(A)企业主营产品是否符合产业升级趋势,是否顺应大众消费潮流;
(B)企业是否采取了不易被模仿和不易受到竞争对手反击的创新,确保企业在较长一段时间内独享创新带来的超额利润,并扩大市场占有率;
(C)企业是否具有品牌优势、资源独占等核心竞争优势等。
C.企业管理水平分析,主要包括:
(A)企业是否具有明确的发展战略;
(B)企业是否具有较高的资源配置效率;
(C)企业管理团队是否重视股东权益等。
(2)风险层面
在风险控制方面,本基金通过相对价值法和贴现现金流法的综合运用,在横向和纵向比较的基础上,客观评价企业的估值水平,选择价值被市场低估或者处于合理估值区间的股票,作为控制投资风险的重要手段,主要考察指标包括:
①资产重置价格
②市盈率(P/E)
③市净率(P/B)
④贴现现金流(DCF)
⑤经济价值/息税折旧摊销前利润(EV/EBITDA)
本基金将根据宏观经济状况、收益实现情况合理分配收益层面和风险层面的权重,做到可攻可守、进退有度,以期在合理控制风险的前提下,实现基金财产的长期稳健增值。
3、固定收益品种投资策略
本基金可以投资于国债、央行票据、金融债、企业债和资产支持证券等固定收益品种。本基金固定收益品种投资将采取较为积极的策略,通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析等,力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取一定的收益。
4、其他金融工具投资策略
本基金将在充分考虑收益性、流动性和风险特征的基础上,积极运用中国证监会允许基金投资的其他金融工具,以期降低组合风险,锁定既有收益,在一定程度上实现基金财产的保值、增值。
十、基金的业绩比较基准
沪深300指数×70%+中国债券总指数×30%
在本基金的运作过程中,如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益,则基金管理人可以对业绩比较基准进行适当调整,在报中国证监会核准后,公告并予以实施。
十一、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金,风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险的证券投资基金品种。
十二、基金投资组合报告
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定,于2012年1月4日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合数据截止到2011年9月30日,其中的财务资料未经审计。
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	7,445,338,427.75	85.70
	其中:股票	7,445,338,427.75	85.70
2	固定收益投资	139,902,000.00	1.61
	其中:债券	139,902,000.00	1.61
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	1,080,099,634.48	12.43
6	其他资产	21,890,183.61	0.25
7	合计	8,687,230,245.84	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	18,343,018.62	0.21
B	采掘业	428,834,174.65	4.95
C	制造业	3,867,249,690.11	44.65
C0	食品、饮料	1,820,739,174.71	21.02
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	53,666,285.21	0.62
C5	电子	86,939,960.50	1.00
C6	金属、非金属	854,343,247.61	9.86
C7	机械、设备、仪表	1,025,159,482.93	11.84
C8	医药、生物制品	26,401,539.15	0.30
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	458,711,330.77	5.30
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	162,335,498.72	1.87
H	批发和零售贸易	1,036,184,363.21	11.96
I	金融、保险业	890,225,692.95	10.28
J	房地产业	100,050,498.82	1.16
K	社会服务业	341,955,059.64	3.95
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	141,449,100.26	1.63
	合计	7,445,338,427.75	85.95

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	600132	重庆啤酒	13,441,668	844,136,750.40	9.75
2	600519	贵州茅台	4,055,949	773,023,319.91	8.92
3	002024	苏宁电器	54,624,002	568,635,860.82	6.56
4	600690	青岛海尔	44,874,396	411,946,955.28	4.76
5	600859	王府井	8,957,167	344,850,929.50	3.98
6	601166	兴业银行	27,132,588	336,172,765.32	3.88
7	000933	神火股份	22,821,125	327,026,721.25	3.78
8	600036	招商银行	25,999,933	287,559,258.98	3.32
9	002081	金螳螂	6,676,272	258,104,675.52	2.98
10	000826	桑德环境	8,991,351	222,985,504.80	2.57

4、报告期末按券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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	139,902,000.00	1.62
	其中:政策性金融债	139,902,000.00	1.62
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	139,902,000.00	1.62

5、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	100226	10国开26	1,400,000	139,902,000.00	1.62

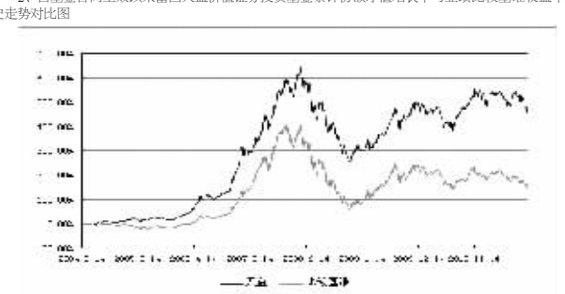
6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8、投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形:
报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(2)基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
(3)基金的其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,383,106.98
2	应收证券清算款	13,919,756.56
3	应收股利	-
4	应收利息	3,197,487.74
5	应收申购款	389,832.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,890,183.61

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
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
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
(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、富国天益价值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
2004.6.15至2004.12.31	6.03%	0.69%	-6.48%	1.01%	12.51%	-0.32%
2005.1.1至2005.12.31	14.84%	1.03%	-6.08%	1.21%	20.92%	-0.18%
2006.1.1至2006.12.31	167.57%	1.36%	114.49%	1.33%	53.08%	0.03%
2007.1.1至2007.12.31	118.41%	1.91%	149.87%	2.17%	-31.46%	-0.26%
2008.1.1至2008.12.31	-43.83%	1.87%	-62.43%	2.85%	18.60%	-0.98%
2009.1.1至2009.12.31	49.73%	1.42%	89.15%	1.93%	-39.42%	-0.51%
2010.1.1至2010.12.31	5.89%	1.28%	-10.31%	1.49%	16.20%	-0.21%
2011.1.1至2011.6.30	-1.74%	1.08%	-3.26%	1.16%	1.52%	-0.08%
2011.1.1至2011.9.30	-13.31%	1.09%	-17.46%	1.19%	4.15%	-0.10%
2004.6.15至2011.9.30	449.37%	1.44%	147.63%	1.82%	301.74%	-0.38%

(二)自基金合同生效以来富国天益价值证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:截止日期为2011年9月30日。
本基金于2004年6月15日成立,建仓期6个月,从2004年6月15日至2004年12月14日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大,建仓期3个月,从2007年11月5日至2008年2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。
十三、费用概览
(一)与基金运作有关的费用
1、与基金运作有关费用列示
(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。
2、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。管理费的计算方法如下:
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。托管费的计算方法如下:
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托管费划款指令,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"1、与基金运作有关费用列示"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。
3、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。
基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露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。
4、费用调整
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或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率,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前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。
(二)与基金销售有关的费用
1、基金的申购费
(1)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。
(2)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。具体费率如下:

申购金额(含申购费)	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上(含100万元)	1.3%
500万元(含)以上	1000元/笔

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。
(3)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,持有时间不满一年的后端申购费率为申购金额的1.8%,费率按持有时间递减,每多持有一年,其后端申购费率按20%递减,最低为零,精确到小数点后4位,小数点后第5位舍去。具体费率如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内	M=1.8%
满1年不满2年	0.8*M=1.44%
满2年不满3年	0.6*M=1.08%
满3年不满4年	0.4*M=0.72%
满4年不满5年	0.2*M=0.36%
满5年以后	0

M为持有不满一年的后端申购费率。
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。
本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金资产,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。
2、基金的赎回费
本基金的赎回费率按持有年限递减,赎回费率如下表:

持有年限	赎回费率
1年以内	0.3%
满1年不满3年	0.15%
满3年以后	0

赎回费用由赎回人承担,在扣除基金注册与过户登记人收取的注册登记费用后,余额的25%归基金财产。
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中国证监会指定的媒体上公告。
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,调整申购费和赎回费的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三个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。
3、基金的转换费
(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
基金转换费用由转出基金的赎回费和转出基金对应需收取的后端申购费两部分构成。基金转换费用由基金份额持有人承担。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
转出基金后端申购费=转出份额×申购日转出基金基金份额净值×适用后端申购费率
转出基金费用=转出基金赎回费+转出基金后端申购费
净转入金额=转出金额-转出基金费用
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。
基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记人处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。
(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"部分对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进行了更新。
2、"三、基金管理人"部分对基金管理人概况等信息进行了更新。
3、"四、基金托管人"部分对基金托管人概况、基金托管业务经营情况等进行了更新。
4、"五、相关服务机构"部分对直销机构、代销机构中部分信息进行了更新。
5、"八、基金份额的申购与赎回"部分对本基金代销机构名单进行了更新,完善了可与本基金转换的基金名单。
6、"九、基金的投资"部分对基金投资组合报告更新至2011年9月30日。
7、"十、基金的业绩"部分对基金业绩更新至2011年9月30日,并更新了历史走势对比图。
8、"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。
9、"二十二、其他应披露事项"部分对本报告期内的应披露事项予以更新。

大成基金管理有限公司
二〇一二年一月二十日

(上接C219版)
办公地址:温州市车站大道196号
法定代表人:邢增福
联系人:姜晟
电话:(0577)88990085
传真:(0577)88995217
客户服务电话:96699(浙江省内)962699(上海地区)、0577-96699(其它地区)
公司网站:www.wzbank.com.cn
(70)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州郑东新区商务外环路10号
法定代表人:石保上
联系电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
联系人:程月艳、耿铭
客户咨询电话:967218(郑州市外拨打加拨区号)、400-813-9666
公司网站:www.ccnew.com
(71)金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
联系人:马贤清
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
客户服务电话:400-8888-228
公司网站:www.jyzq.cn
(72)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
电话:022-28451861
传真:022-28451892
联系人:王兆权
客户服务热线:400-651-5988
公司网站:www.bhzq.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:窦玉明
成立日期:1999年4月13日
电话:(021)20361818
传真:(021)20361616
联系人:雷青松
(三)出具法律意见书的律师事务所(基金募集时)
名称:北京市竞天公诚律师事务所
注册地址:北京市朝阳门外大街20号联合大厦15层
办公地址:北京市朝阳门外大街20号联合大厦15层
负责人:张绪生
联系电话:(010)65882200
传真:(010)65882211
联系人:许舒萱
经办律师:戴华、王燕萍
(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

富国天益价值证券投资基金招募说明书(更新摘要)

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。
九、基金的业绩比较基准
95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
十、基金的风险收益特征
本基金为价值型证券投资基金,属于证券投资基金中的中低风险品种。
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	8,331,196,464.04	88.76
	其中:股票	8,331,196,464.04	88.76
2	固定收益投资	644,889,095.40	6.87
	其中:债券	644,889,095.40	6.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	242,000,648.00	2.58
	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	157,364,173.18	1.68
6	其他资产	10,632,640.69	0.11
7	合计	9,386,083,021.31	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	316,448,404.18	3.38
C	制造业	3,867,922,087.00	41.30
C0	食品、饮料	1,093,306,806.35	11.67
C1	纺织、服装、皮毛	3,692,604.51	0.04
C2	木材、家具	25,668,113.12	0.27
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	400,179,332.11	4.27
C5	电子	3,446,367.59	0.04
C6	金属、非金属	630,585,102.60	6.73
C7	机械、设备、仪表	724,156,877.93	7.73
C8	医药、生物制品	986,886,882.79	10.54
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	137,558,308.36	1.47
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,314,348,452.16	14.03
H	批发和零售贸易	798,979,574.74	8.53
I	金融、保险业	1,465,743,725.66	15.65
J	房地产业	328,751,940.64	3.51
K	社会服务业	63,530,134.02	0.68
L	传播与文化产业	2,597,384.10	0.03
M	综合类	35,316,453.18	0.38
	合计	8,331,196,464.04	88.95

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	600519	贵州茅台	4,409,205	840,350,380.95	8.97
2	002024	苏宁电器	63,989,914	666,135,004.74	7.11
3	002422	科伦药业	10,501,233	614,427,142.83	6.56
4	600271	航天信息	19,146,011	517,133,757.11	5.52
5	600585	海螺水泥	26,145,000	449,694,000.00	4.80
6	600050	中国联通	80,079,935	410,009,267.20	4.38
7	002153	石基信息	13,045,486	367,882,705.20	3.93
8	600016	民生银行	64,007,364	353,320,649.28	3.77
9	601699	潞安环能	10,000,000	291,900,000.00	3.12
10	601989	中国重工	26,109,892	279,898,042.24	2.99

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	228,588,000.00	2.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	309,489,000.00	3.30
	其中:政策性金融债	309,489,000.00	3.30
4	企业债券	32,268,000.00	0.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	74,544,095.40	0.80
8	其他	-	-
9	合计	644,889,095.40	6.89

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	110242	11国开42	2,000,000	199,940,000.00	2.13
2	019111	11国债11	2,000,000	198,660,000.00	2.12
3	110308	11进出08	1,100,000	109,549,000.00	1.17
4	113002	工行转债	400,000	40,784,000.00	0.44
5	122897	10冀投债	300,000	32,268,000.00	0.34

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)报告期内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)报告期内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	853,913.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,083,136.82
5	应收申购款	3,695,590.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,632,640.69

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	40,784,000.00	0.44
2	113001	中行转债	27,297,000.00	0.29
3	110015	石化转债	6,463,095.40	0.07

(5)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不存在流通受限情况。
(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、富国天益价值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