(上接D38版)

注册地址:海口市南宝路 [illegible]号证券大厦 [illegible]楼
办公地址:深圳市深南大道 [illegible]号时代金融中心 [illegible]层
法定代表人:陆涛
联系人:马贤清
电话:[illegible]
传真:[illegible]
客户服务电话:[illegible]
公司网站:[illegible]
[illegible]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 [illegible]号写字楼 [illegible]室
办公地址:天津市南开区宾水西道 [illegible]号
法定代表人:杜庆平
电话:[illegible]
传真:[illegible]
联系人:王兆权
客户服务热线:[illegible]
公司网站:[illegible]
[illegible]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 [illegible]号 环球金融中心 [illegible]楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 [illegible]号 环球金融中心 [illegible]楼
法定代表人:罗浩
电话:[illegible]
传真:[illegible]
联系人:倪丹
客户服务电话:[illegible]
公司网站:[illegible]
[illegible]诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路 [illegible]号 [illegible]室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 [illegible]号时代金融中心 [illegible]楼
法定代表人:汪静波
联系人:张姚杰
客服电话:[illegible]
公司网址:[illegible]
[illegible]深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 [illegible]号发展银行大厦 [illegible]楼 [illegible]单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路 [illegible]号发展银行大厦 [illegible]楼 [illegible]单元
法定代表人:薛峰
联系人:张玉静
电话:[illegible]
传真:[illegible]
客户服务电话:[illegible] 基金买卖网 [illegible]
公司网址:[illegible]
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:上海市浦东新区世纪大道 [illegible]号上海国金中心二期 [illegible]层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 [illegible]号上海国金中心二期 [illegible]层
法定代表人:陈敏
总经理:窦玉明
成立日期:[illegible]日
电话:[illegible]
传真:[illegible]
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 [illegible]号联合大厦 [illegible]层
办公地址:北京市朝阳门外大街 [illegible]号联合大厦 [illegible]层
负责人:张绪生
联系电话:[illegible]
传真:[illegible]
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 [illegible]号东方广场东方经贸城安永大楼 [illegible]层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 [illegible]号环球金融中心 [illegible]楼
法定代表人:葛明
联系电话:[illegible]
传真:[illegible]
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国天益价值证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

本基金属价值型基金,主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票,或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

八、基金的投资策略

荫资产配置策略

根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断,决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布以及股票组合的行业比例配置,并进行动态配比以规避系统性风险的影响,最大限度地确保基金资产的安全。

基金经理进行资产配置的依据是:[illegible]市场总体价值;[illegible]宏观经济面;[illegible]资金面;[illegible]政策面;[illegible]行业的景气度等。

本基金原则上的资产配置比例为:股票最高可达到基金资产净值的 [illegible],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 [illegible]。在法律法规有新规定的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

荫股票投资策略

本基金采取积极的投资策略。本基金在大类资产配置和行业配置层面,遵循自上而下的积极策略,个股选择层面,遵循自下而上的积极策略。

员股票选择策略

本基金的股票选择,主要采取价值型选股策略。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。我们重点关注的价值型股票主要包括:

[illegible]市净率 [illegible]低于市场平均水平;
[illegible]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;
[illegible]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;
[illegible]企业拥有未被市场认识或被市场低估的资源;
[illegible]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;

[illegible]股票组合构建策略

在遵循既定的资产配置方针的前提下,基金经理和行业分析师结合对行业和上市公司的研究和调研,筛选投资目标股。基金经理决定投资目标股的组合权重,并负责对组合进行动态的调整和优化。

[illegible]股票组合风险控制策略

[illegible]通过资产的合理配置,有效控制组合风险。
[illegible]坚持价值型投资策略,精选个股实现组合风险的控制。
[illegible]充分注重控制投资组合的流动性风险。

荫债券投资策略

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

[illegible]的中信标普 [illegible]指数 [illegible]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

员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(%)
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
猿	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
源	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

圆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(%)
粤	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
[illegible]	木材、家具	[illegible]	[illegible]
[illegible]	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
[illegible]	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电子	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
[illegible]	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
[illegible]	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他制造业	[illegible]	[illegible]
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
耘	建筑业	[illegible]	[illegible]
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郧	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
配	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

猿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(%)
员	[illegible]	贵州茅台	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	苏宁电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	科伦药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	石基信息	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	航天信息	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	民生银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	深发展[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	威孚高科	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	东阿阿胶	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	招商银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]

源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(%)
员	国家债券	[illegible]	[illegible]
圆	央行票据	[illegible]	[illegible]
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中:政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	[illegible]	[illegible]
缘	企业短期融资券	[illegible]	[illegible]
远	中期票据	[illegible]	[illegible]
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	[illegible]	[illegible]
怨	合计	[illegible]	[illegible]

缘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(%)
员	[illegible]	[illegible]开源[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	[illegible]债[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	[illegible]出口[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	[illegible]开源[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]

远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。
苑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。
愿投资组合报告附注
[illegible]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。
[illegible]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。
怨其他资产构成

序号	名称	金额(元)
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	[illegible]
苑	待摊费用	[illegible]
愿	其他	[illegible]
怨	合计	[illegible]

[illegible]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(%)
员	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	中行转债	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]

[illegible]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。
[illegible]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。

员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
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]