

(上接 C70 版)

(47) 大连国基金销售有限公司  
注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室  
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室  
法人代表: 樊怀东  
联系人: 贾伟刚  
客服电话: 4000-899-100  
公司网站: www.yibajin.com  
(48) 北京蛋卷基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层  
办公地址: 北京市朝阳区望京 SOHO T2 B 座 2507  
法人代表: 钟斐斐  
联系人: 戚晓强  
客服电话: 400-159-9288  
公司网站: danjuanapp.com  
(49) 宏元保险代理有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室  
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室  
法人代表: 马永涛  
联系人: 卢亚博  
客服电话: 400-080-8208  
公司网站: www.hicaimofang.cn  
(50) 中国人寿保险股份有限公司  
注册地址: 中国北京市西城区金融大街 16 号  
办公地址: 中国北京市西城区金融大街 16 号  
法人代表: 杨明生  
联系人: 陈慧  
客服电话: 010-63631519  
公司网站: www.e-chinalife.com  
(三) 其他  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加或调整本基金销售机构,并在基金管理人网站公示。

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 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层  
法定代表人:袁长江  
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)31358600  
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 号东方广场东塔楼安永大楼 16 层  
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:毛鞍宁  
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、费泽旭

富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金  
第五部分 基金类型  
混合型证券投资基金

第六部分 投资目标  
本基金主要投资于精准医疗主题相关股票,通过精选个股和风险控制,力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。

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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类资产(包括国债、金融债、企业债、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、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

第八部分 基金投资策略  
1. 大类资产配置策略  
本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

第九部分 基金业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:中证精准医疗主题指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%  
中证精准医疗主题指数由中证指数有限公司发布,该指数主要纳入从事疾病筛查与诊断、数据解读、个性化化疗与用药以及其他与精准医疗相关的代表性公司,以反映上市公司中精准医疗相关公司股票的走势。中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够真实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金管理人经与基金托管人协商一致,在报中国证监会备案后,可以变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征  
本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高风险预期收益和预期风险水平的投资品种。

第十一部分 投资组合报告  
一、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	2,417,163,149.40	81.22
	其中:股票	2,417,163,149.40	81.22
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	506,156,240.31	17.01
7	其他资产	522,922,606.61	1.78
8	合计	2,976,241,996.32	100.00

二、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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,918,141,410.73	65.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	19,147.31	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	319,677,447.71	10.93
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	国民服务、环保和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	179,325,143.65	6.13
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,417,163,149.40	82.64

三、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	300122	智飞生物	3,051,753.00	205,657,634.67	7.03
2	600276	恒瑞医药	2,192,338.00	201,760,866.14	6.90
3	603259	药明康德	1,898,349.00	171,781,601.01	5.87
4	300760	迈瑞医疗	654,904.00	171,388,376.80	5.86
5	000661	长春高新	299,769.00	161,844,749.59	5.53
6	603882	金城医药	2,655,889.00	149,499,991.81	5.11
7	600161	天坛生物	3,791,036.00	137,917,898.68	4.72
8	300573	齐翔腾达	1,448,219.00	134,843,671.09	4.61
9	603658	安图生物	1,154,495.00	134,487,122.55	4.60
10	600216	浙江医药	6,635,007.00	124,406,381.25	4.25

四、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债券投资明细

五、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权证投资明细

六、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

七、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

八、报告期末本基金投资的贵金属投资情况

九、报告期末本基金投资的期权投资情况

十、报告期末本基金投资的资产支持证券情况

十一、投资组合报告附注

十二、其他资产构成

十三、基金费用

十四、基金业绩

十五、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十六、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十七、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十八、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十九、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十一、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十二、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十三、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十四、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十五、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十六、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十七、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十八、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十九、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

三十、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

定性;c、公司治理方面,考察上市公司是否有清晰、合理、可执行的发展战略;是否具有合理的治理结构,管理团队是否团结高效、经验丰富,是否具有进取精神等。2) 本基金主要对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析,包括:a、成长性指标:收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等;b、财务指标:毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等;c、估值指标:市盈率(PE)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市销率(PS)和总市值等。

3. 债券投资策略  
本基金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、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上,根据对宏观经济形势、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,针对收益率曲线形状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)市场转换是指基金管理人将针对债券子市场间不同运行规律和风险-收益特征构建和调整组合,提高投资收益;

(4)相对价值判断是在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属;

(5)信用风险评估是指基金管理人将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。

对于可转换债券的投资,本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性,以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益;本基金将重点关注可转债的转换价格、市场价值与其转换价格的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。

4. 资产支持证券的投资策略  
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、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行评估,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。

5. 中小企业私募债券的投资策略  
本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面,根据宏观经济运行状况的分析和预判,灵活调整组合的久期。信用风险控制方面,对单个债券资质进行详尽的分析,对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考虑,尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面,主要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

6. 金融衍生品工具投资策略  
本基金还可能运用组合资产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,基金可在履行适当程序后,相应调整和更新相关投资策略。

第九部分 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证精准医疗主题指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%  
中证精准医疗主题指数由中证指数有限公司发布,该指数主要纳入从事疾病筛查与诊断、数据解读、个性化化疗与用药以及其他与精准医疗相关的代表性公司,以反映上市公司中精准医疗相关公司股票的走势。中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够真实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金管理人经与基金托管人协商一致,在报中国证监会备案后,可以变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高风险预期收益和预期风险水平的投资品种。

第十一部分 投资组合报告

一、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	2,417,163,149.40	81.22
	其中:股票	2,417,163,149.40	81.22
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	506,156,240.31	17.01
7	其他资产	522,922,606.61	1.78
8	合计	2,976,241,996.32	100.00

二、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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,918,141,410.73	65.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	19,147.31	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	319,677,447.71	10.93
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	国民服务、环保和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	179,325,143.65	6.13
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,417,163,149.40	82.64

三、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	300122	智飞生物	3,051,753.00	205,657,634.67	7.03
2	600276	恒瑞医药	2,192,338.00	201,760,866.14	6.90
3	603259	药明康德	1,898,349.00	171,781,601.01	5.87
4	300760	迈瑞医疗	654,904.00	171,388,376.80	5.86
5	000661	长春高新	299,769.00	161,844,749.59	5.53
6	603882	金城医药	2,655,889.00	149,499,991.81	5.11
7	600161	天坛生物	3,791,036.00	137,917,898.68	4.72
8	300573	齐翔腾达	1,448,219.00	134,843,671.09	4.61
9	603658	安图生物	1,154,495.00	134,487,122.55	4.60
10	600216	浙江医药	6,635,007.00	124,406,381.25	4.25

四、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权证投资明细

五、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

六、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

七、报告期末本基金投资的贵金属投资情况

八、报告期末本基金投资的期权投资情况

九、报告期末本基金投资的资产支持证券情况

十、投资组合报告附注

十一、基金费用

十二、基金业绩

十三、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十四、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十五、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十六、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十七、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十八、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

十九、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十一、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十二、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十三、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十四、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十五、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十六、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十七、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

二十八、基金管理人运用固有资金投资本基金情况

四、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

五、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投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

六、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。

七、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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

八、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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

九、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(一) 报告期末本基金投资的股指期货合约和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

(二) 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

十、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(一) 本期国债期货投资政策  
本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

(二) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
国债期货投资本期公允价值变动(元)	—
国债期货投资本期公允价值变动(元)	—

注:本基金本报告期末未投资国债期货。