

(上接 C70 版)

联系人: 史艺斐 客服电话: 400-888-7868 公司网站: www.syyqhq.com (138)元宏保险代理有限公司 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.hcamofang.cn (139)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 (一) 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:裴长江 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:上海源泰律师事务所 注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼 办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼 负责人:廖海 联系电话:(021)51150298 传真:(021)51150398 联系人:廖海 经办律师:廖海、吕红

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 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:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼 法定代表人:葛明 联系电话:(021)22288888 传真:(021)22280000 联系人:徐皓 经办注册会计师:徐皓、蒋燕华

第四部分 基金名称 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金 第五部分 基金类型 混合型

本基金主要投资于强势地区(区域经济发展领先,已经形成一定产业集群且居民购买力较强)具有较强竞争力、经营管理稳健、诚信、业绩优良的上市公司的股票。本基金遵循“风险调整后收益最大化”原则,通过“自上而下”的积极投资策略,在合理运用金融工程技术的基础上,动态调整投资组合比例,注重基金资产安全,谋求基金资产的长期稳定增值。

第七部分 基金投资方向 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业(公司)债(包括可转债)等。

第八部分 基金投资策略 本基金主要采用“自上而下”的主动投资管理策略,在充分研判宏观经济状况、资本市场运行特征的前提下,以强势地区内单个证券的投资价值评判为核心,追求投资组合流动性、赢利性、安全性的中长期有效结合。

1.资产配置: (1)在正常市场状况下,本基金投资组合中的股票投资比例浮动范围为:45%-95%;债券和短期金融工具的投资比例浮动范围为:5%-55%。其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。投资于强势地区的股票比例不低于基金股票投资的80%。

(2)股票与债券之间具体的比例将根据不同的市场情况动态配置,以最大限度地规避风险。 本基金管理人认为,股票市场中枢取向上,外部宏观(政策、投资理念及投资者行为等)变化决定了市场的运行区间,股票供求、资金面的松紧程度等左右市场的短期波动;债券市场的运行中枢主要取决于市场利率,利率的预期变化决定了债券市场总体变化趋势,债券供求状况和资金松紧程度等左右债券市场的短期波动。本基金管理人将在基本分析的基础上,综合运用数量分析与技术分析等工具,研判市场的中期波动与长期趋势。

①当股票市场处于低风险区域或预期股票市场趋于上涨时,本基金管理人将采取适度积极的做法,提高股票的投资比重,分享股票市场上涨带来的收益,以争取较高回报。 ②当股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时,本基金管理人将采取保守的做法,降低股票投资比例,加大债券市场的投资力度,以回避股票市场的系统性风险,避免组合损失。

③当股票市场在中等风险区域或预期处于震荡运行时,本基金管理人将以结构性调整为主,适当降低股票的投资比重,选择的重点是相对价值低估的个股,同时加大可转债的投资比重。 ④当预期利率下降、债券价格将上升时,组合将降低现金持有比例,并将债券资产主要投资于中长期债券,以实现较高的回报;在预期利率上升、债券价格将下降时,组合将增加现金持有比例,并将债券资产主要投资于短期债券和利息债券。

⑤积极参与与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资。 2.股票投资策略: 本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团(BMO Financial Group)的投资管理经验及技能,根据国内市场的特征,应用“富国3S股票筛选系统(Screening System)”,挖掘具有投资价值潜力的股票:

(1)富国3S股票筛选系统的操作思路为: ①富国的“多因素综合评价估值模块(MVP)”,对上市公司的管理能力、财务实力、资金运用效率、资产盈利能力、成长性、个股的现金流量状况以及股价吸引力进行总体评价; ②剔除财务指标异常和股价波动异常的个股,构建备选股票库I; ③在公司研究员和基金经理实地跟踪的基础上,结合市场趋势判断,形成重点关注股票库II; ④对股票库II进行限制性、流动性和组合风险度检验,并根据资产配置原则和市场风险分析,构建投资组合。

公司备选股票库I每季度微调一次,对于被剔除的股票,基金经理将在最近的一个月内作出相应的减持或卖出操作;对于被调入的股票,基金经理将基于主观判断进行决策;对于入选重点股票库II的,将选择适当时机进行投资操作。

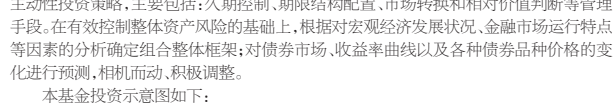
(2)富国“多因素综合评价估值模块(MVP)”: “多因素综合评价估值模块(Multifactor Valuation Pipeline)”是富国3S股票筛选系统中的核心部分之一。本基金管理人基于“定性定量分析相结合、动态静态指标相结合”的原则,运用“价值为本,成长为重”的合理价格成长投资策略(GARP-Growth At Reasonable Price)来确定具体选股标准,评估上市公司的综合素质,判断股票的投资价值。重点关注的因素包括:

①企业的管理团队优秀,管理制度健全,内部治理结构完善,重视股东利益,关注投资回报,具有良好的诚信度; ②企业在产品开发、技术进步、成本控制等方面具有较强的核心竞争力,并且在销售网络、市场知名度和品牌效应方面具有独特优势; ③企业行业地位突出,财务管理稳健,营运状况良好,具有稳定的现金流并具备一定的规模优势; ④企业盈利能力较强,主营业务收入、主营业务利润、息税前收益以及净资产回报率稳定并保持良好的成长性;

⑤股票具有较好的流动性,适合资金的操作; ⑥市净率(P/B)、动态市盈率(PEG)以及股票市值/主营业务收入/主营业务收入增长率(P/S/G)相对较低; ⑦综合股价/每股经营现金流指标(P/C)、股价/每股销售收入指标(P/S)、股利分配率(DPR)以及自由现金流折现模型(DCF)、经济价值模型(EV/EBITDA)、杜邦财务分析模型(DuPont Analysis)的分析结果。

3.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。在有效控制组合整体风险的基础上,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、收益率曲线以及各品种品种价格的变化进行预测,相应调整,积极调整。

本基金投资示意图如下:



第九部分 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准采用上证A股指数、债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。本基金定位为混合型基金,以股票投资为主,债券投资只是为了回避市场的系统性风险,因此,本基金的整体业绩比较基准以如下公式表示:

本基金A股指数收益率×70%+上证国债指数收益率×25%+同业存款利率×5% 第十部分 基金的风险收益特征 本基金是一只主动投资的混合型基金,主要投资于强势地区中定价合理且具有成长潜力的优质股票,属于中低风险的投资品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长,实现较高的超额收益。

第十一部分 投资组合报告 一、报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

四、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

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

九、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

十、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

十一、投资组合报告附注 (一) 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。

(二) 申明本基金投资的前十名股票是否属于基金合同规定的备选股票库。

(三) 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

(四) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

(五) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

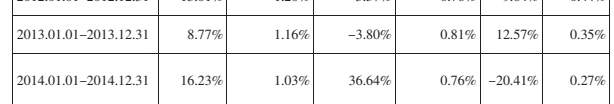
(六) 报告期末持有的其他权证品种

第十二部分 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。投资者有风险,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。

一、本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④

二、自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.截止日期为2020年3月31日。 2.本基金于2005年4月5日成立,建仓期6个月,从2005年4月5日起至2005年10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。

第十三部分 费用概览 一、基金费用的种类 (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)基金合同生效与基金相关的会计师费、律师费; (5)基金合同约定的其他费用; (6)基金的销售费用; (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。

二、基金费用的计提方法、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,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

基金管理人每日计算,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,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

第十四部分 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集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进行了更新,主要更新内容如下:

1、“重要提示”部分,更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。 2、“第三部分 基金管理人”部分,对基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。 3、“第四部分 基金托管人”部分,对基金托管人的基金托管业务经营情况进行了更新。

4、“第五部分 相关服务机构”部分,更新了相关服务机构的信息。 5、“第九部分 基金的投资”部分,对基金投资组合报告进行了更新,内容截止至2020年3月31日。 6、“第十部分 基金的业绩”部分,对基金业绩表现数据及历史走势图进行了更新,内容截止至2020年3月31日。 7、“第十七部分 风险提示”部分,新增关于投资科创板的风险揭示内容。 8、“第二十二部分 其他应披露事项”部分,对本报告期内的其他应披露事项进行了更新。

富国基金管理有限公司 2020年6月30日

富国基金管理有限公司关于开通平安银行借记卡基金电子直销交易业务并实行费率优惠活动的公告

为进一步方便投资者通过电子交易方式投资富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下的开放式证券投资基金,本公司自2020年7月1日起正式开通平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)借记卡基金电子直销交易业务并实行费率优惠活动。投资者可通过平安银行借记卡在本公司电子直销交易系统办理本公司旗下开放式证券投资基金的各项交易业务,现将有关事项公告如下: 一、业务开通时间 2020年7月1日起。 二、适用基金范围 本公司管理的所有开通电子直销交易业务的证券投资基金以及之后发行的证券投资基金产品。 三、适用业务范围 基金开户、认购、申购、赎回、转换、撤单、修改分红方式等业务。 四、适用投资者范围 投资者通过本公司电子直销交易系统办理上述业务时,应符合有关法律法规的要求与基金合同、招募说明书及相关公告的规定。 五、费率优惠 通过平安银行借记卡在本公司电子直销交易系统/申购本公司旗下开放式证券投资基金(前端收费模式),认/申购费率在基金原认/申购费率基础上实行优惠,即在基金更新的招募说明书中规定的相应费率基础上实施4折优惠,若

富国基金管理有限公司关于增加国信证券为富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告

根据富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与国信证券股份有限公司签署的销售代理协议,自2020年6月30日起,上述渠道开始代理销售富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”,基金代码:002692),投资者可通过上述渠道办理开户以及本基金的申购、赎回业务。其他业务的开通情况敬请投资者留意临时公告。 投资者可以通过以下途径咨询有关情况: 国信证券股份有限公司 客服电话:95575 公司网站:www.guosen.com.cn 投资者也可以通过以下方式联系富国基金管理有限公司进行咨询: 客户服务电话:95105686,4008880688(全国统一,均免长途话费) 风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资者注意投资风险。 投资者投资于本基金前应认真阅读基金合同、招募说明书及相关公告。 特此公告。 富国基金管理有限公司 二〇二〇年六月三十日

富国基金管理有限公司关于增加广发证券为富国创新科技混合型证券投资基金代销机构的公告

根据富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与广发证券股份有限公司签署的销售代理协议,自2020年6月30日起,上述渠道开始代理销售富国创新科技混合型证券投资基金(以下简称“本基金”,基金代码:002692),投资者可通过上述渠道办理开户以及本基金的申购、赎回业务。其他业务的开通情况敬请投资者留意临时公告。 投资者可以通过以下途径咨询有关情况: 广发证券股份有限公司 客服电话:95575 公司网站:www.gf.com.cn 投资者也可以通过以下方式联系富国基金管理有限公司进行咨询: 客户服务电话:95105686,4008880688(全国统一,均免长途话费) 风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资者注意投资风险。 投资者投资于本基金前应认真阅读基金合同、招募说明书及相关公告。 特此公告。 富国基金管理有限公司 二〇二〇年六月三十日