

(上接B043版)

客服电话: (0731) 44033319  
公司网站: www.czfz.com  
(59) 中原证券股份有限公司  
注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号  
法人代表: 管欣军  
联系电话: 0271-69098892  
传真电话: 0371-65658899  
联系人: 程月梅  
客服电话: 0371-967218, 400-813-9666  
公司网站: www.czyw.com  
(60) 国都证券有限责任公司  
注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
办公地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
法人代表: 常喆  
联系电话: (010) 84183333  
传真电话: (010) 84183311-3389  
联系人: 戴静  
客服电话: 400-818-8118  
公司网站: www.guodu.com  
(61) 东海证券股份有限公司  
注册地址: 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层  
办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦  
法人代表: 刘化军  
联系电话: 021-50333910  
传真电话: 021-50498825  
联系人: 王彦  
客服电话: 06621-400-8889-598  
公司网站: www.longone.com.cn  
(62) 中银国际证券有限责任公司  
注册地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层  
办公地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层  
法人代表: 许刚  
联系电话: 021-20328309  
传真电话: 021-50372474  
联系人: 王慧哲  
客服电话: 400-620-8888  
公司网站: www.bocichina.com  
(63) 恒泰证券股份有限公司  
注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号  
办公地址: 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
法人代表: 杨锦祥  
联系电话: 021-52723273  
传真电话: 028-86157275  
联系人: 张曼  
客服电话: 96584  
公司网站: www.htzq.com.cn  
(65) 申万宏源证券股份有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道1601号上海证券大厦20楼2005室  
办公地址: 新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  
法人代表: 许建平  
联系电话: 010-88085858  
传真电话: 010-88085858  
联系人: 李静  
客服电话: 4008-000-562  
公司网站: www.hysec.com  
(66) 齐鲁证券有限公司  
注册地址: 济南市经七路96号  
办公地址: 济南市经七路96号22层  
法人代表: 李琦  
联系电话: 0531-68889155  
传真电话: 0531-68889185  
联系人: 吴昊  
客服电话: 96530  
公司网站: www.qizh.com.cn  
(67) 金元证券股份有限公司  
注册地址: 海口市南滨路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  
法人代表: 陆涛  
联系电话: 0756-83026022  
传真电话: 0756-83026265  
联系人: 马智涛  
客服电话: 400-8888-228  
公司网站: www.jyzy.cn  
(68) 德邦证券股份有限公司  
注册地址: 上海市普陀区曹杨路510号南幢9楼  
办公地址: 上海市福州路500号城建国际中心26楼  
法人代表: 姚文平  
联系电话: 021-68767890  
传真电话: 021-68767890  
联系人: 朱磊  
客服电话: 400 8888 128  
公司网站: http://www.tebon.com.cn  
(69) 信泰证券有限责任公司  
注册地址: 南京市长江路88号  
办公地址: 南京市长江路88号  
法人代表: 钱凯法  
联系电话: (025) 84784765  
传真电话: (025) 84784830  
联系人: 薛韵菲  
客服电话: 4008889818  
公司网站: www.tbzq.com  
(70) 华信证券有限责任公司  
注册地址: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦7/810层  
法人代表: 黄捷雄  
联系电话: 0591-87383600  
传真电话: 0591-87383610  
联系人: 张宗锐  
客服电话: 96326(福建外请先拨0591)  
公司网站: www.hxzb.com.cn  
(71) 华龙证券有限责任公司  
注册地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心  
办公地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心  
法人代表: 李晓安  
联系电话: 0931-4890208  
传真电话: (0931) 4890628  
联系人: 李海田  
客服电话: (0931) 96668, 4006898888  
公司网站: www.hljzq.com  
(72) 中国国际金融有限公司  
注册地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址: 北京市建国门外大街6号CSCA大厦3层  
法人代表: 李剑阁  
联系电话: 010-65051166  
传真电话: 010-65051166  
联系人: 陈寿  
客服电话: 010-65051166  
公司网站: http://www.cicc.com.cn  
(73) 上海华信证券有限责任公司  
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼  
法人代表: 杨敬敏  
联系电话: 021-38784818  
传真电话: 021-68775878  
联系人: 吴昊  
客服电话: 68777777  
公司网站: www.cf-clsa.com  
(74) 瑞银证券有限责任公司  
注册地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
办公地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
法人代表: 程胜华  
联系电话: (010) 88328898  
传真电话: (010) 65832812  
联系人: 牟冉  
客服电话: 4008878827  
公司网站: www.ubscurities.com  
(75) 中国中投证券有限责任公司  
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11  
办公地址: 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
法人代表: 龙光来  
联系电话: (0755) 82022442  
传真电话: (0755) 82028639  
联系人: 刘爽  
客服电话: 96532  
公司网站: www.china-invsc.com  
(76) 江海证券有限公司  
注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区颐水路6号  
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区颐水路6号  
法人代表: 孙洪梅  
联系电话: 0451-58563719  
传真电话: 0451-82287211  
联系人: 刘禹  
客服电话: 400-666-2298  
公司网站: www.hjzq.com.cn  
(77) 光大证券股份有限公司  
注册地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层  
办公地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层  
法人代表: 吴昊  
联系电话: 0755-83007159  
传真电话: 0755-83007034  
联系人: 吴昊  
客服电话: 4000-188-688  
公司网站: www.yds.com.cn  
(78) 大通证券股份有限公司  
注册地址: 大连市中山区人民路24号  
办公地址: 大连市沙河口区会展路129号大通期货大厦29层  
法人代表: 张智河  
联系电话: 0411-39673202  
传真电话: 0411-39673219  
联系人: 董立军

客服电话: 4008-169-169  
公司网站: www.datong.com.cn  
(79) 江苏金百临投资咨询有限公司  
注册地址: 无锡市太湖新城溪南溪湖泽路9号楼  
办公地址: 无锡市太湖新城溪南溪湖泽路9号楼  
法人代表: 费晓燕  
联系电话: 0510-82758877  
传真电话: 0510-88556898  
联系人: 袁丽萍  
客服电话: 0510-9688988  
公司网站: www.wjhl.com  
(80) 和讯信息科技有限公司  
注册地址: 北京市朝外大街22号泛利大厦10层  
办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼  
法人代表: 王利  
联系电话: 400-920-0022  
传真电话: 021-20835879  
联系人: 于畅  
客服电话: 400-920-0022  
公司网站: lisa.ke.hexun.com  
(81) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司  
注册地址: 上海市金山区郡下镇漕漕公路7650号205室  
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心楼  
法人代表: 汪静波  
联系电话: 021-3860-0672  
联系人: 姚姝  
客服电话: 021-3860-2300  
公司网站: www.noah-fund.com  
(82) 深圳众成基金销售有限公司  
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元  
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元  
法人代表: 薛峰  
联系电话: 0755-33227960  
传真电话: 0755-82009798  
联系人: 陈永顺  
客服电话: 4008-788-887  
公司网站: 众成基金网: www.zcfund.cn基金买卖网 www.jjmmw.c  
(83) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C9楼  
法人代表: 其实  
联系电话: 021-54509988  
传真电话: 021-64385308  
联系人: 潘世华  
客服电话: 400-1818-188  
公司网站: www.1234567.com.cn  
(84) 上海好买基金销售有限公司  
注册地址: 上海市虹口区区浏阳路196号26楼2楼41号  
办公地址: 上海市浦东新区浦明路118号鄂尔多斯大厦903-906室  
法人代表: 杨文斌  
联系电话: (021) 58870011  
传真电话: (021) 68569616  
联系人: 张磊  
客服电话: 4007009665  
公司网站: www.howbuy.com  
(85) 杭州数米基金销售有限公司  
注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室  
办公地址: 杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法人代表: 陈柏青  
联系电话: 021-60897840  
传真电话: 0571-26697013  
联系人: 张裕  
客服电话: 4000766123  
公司网站: www.fund123.com  
(86) 上海长江基金销售有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路268号2楼220室  
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路268号505号裕康国际B座16层  
法人代表: 张跃伟  
联系电话: 021-58789878-8201, 13585790204  
传真电话: 021-58787698  
联系人: 沈雯斌  
客服电话: 400-089-1289  
公司网站: www.shcfund.com  
(87) 北京展恒基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区将台路15号院2号楼5层501号  
办公地址: 北京市朝阳区将台路15号院2号楼5层501号  
法人代表: 闫振杰  
联系电话: (010) 62020088  
联系人: 宋丽君  
客服电话: 4008886661  
公司网站: www.myfund.com  
(88) 中银国际基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街16号中国中期大厦A座11层  
办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街16号中国中期大厦A座11层  
法人代表: 路茜  
联系电话: 010-59539718  
传真电话: 010-59539701  
联系人: 侯英建  
客服电话: 96162-6876162  
公司网站: www.cibcfund.com  
(89) 嘉实财富管理有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座406-10单元  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座406-10单元  
法人代表: 朱圣  
联系电话: 021-20290110  
联系人: 张倩  
客服电话: 400-021-3850  
公司网站: www.harvestwm.cn  
(90) 北京创金启富投资管理有限公司  
注册地址: 北京市西城区民安胡同31号5号楼215A  
办公地址: 北京市西城区民安胡同31号5号楼215A  
法人代表: 梁静  
联系电话: (010) 66154828  
传真电话: (010) 88067626  
联系人: 张旭  
客服电话: 400-6262-818  
公司网站: www.51rich.com  
(91) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区望京路89号望泰15层1809  
办公地址: 北京市朝阳区望京路89号望泰15层1809  
法人代表: 沈伟彬  
联系电话: 010-52856713  
传真电话: 010-59594295  
联系人: 利刚  
客服电话: 400-600-4200  
公司网站: www.yixinfund.com  
基金管理人可根据有关法律法规的规定, 选择其他符合要求的机构代理销售基金, 并及开公告。  
(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8号上海国金中心二期16-17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  
总经理: 陈戈  
成立日期: 1999年4月13日  
电话: (021) 20361816  
传真: (021) 20361616  
联系人: 雷奇军  
(三) 出具法律意见书的律师事务所(基金募集时)  
名称: 上海锦泰律师事务所  
注册地址: 上海市浦东新区南汇区华夏银行大厦14楼  
办公地址: 上海市浦东新区南汇区华夏银行大厦14楼  
负责人: 廖海  
联系电话: (021) 51150298  
传真: (021) 51150338  
联系人: 廖海  
经办律师: 廖海、吕红  
(四) 审计计账公司的会计师事务所  
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号东方广场东塔楼财经世纪大厦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  
四、基金名称  
富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金  
五、基金的类型  
混合型  
六、基金的投资目标  
本基金主要投资于红利型股票与固定收益类证券, 兼顾红利收益与资本增值; 力争通过具有合理的大类资产配置与专业的个股精选, 在精细化风险管理的基础上构建优化组合, 谋求基金资产的长期稳定增值。  
七、基金的投资方向  
本基金的投资范围与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、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人将视适当程序后, 可以将其纳入投资范围。  
八、基金的投资策略  
本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主观投资策略, 将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业分析、公司价值评估以及组合风险管理过程中。  
1、“自上而下”的资产配置  
(1) 本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略, 通过战略资产配置策略(SAA-Strategic Asset Allocation) 和战术资产配置策略(TAA-Tactical Asset Allocation) 的有机结合, 持续、动态、优化确定投资组合中股票、债券、短期金融工具的比例。  
具体而言, 在长期范围内, 本基金管理人将基于以宏观经济分析、中长期利率趋势分析为焦点的资产配置决策, 风险预期收益差进行战略资产配置, 在理性预期的基础上, 采取稳健的SAA优化比例, 并以此作为资产配置调整的可参照基准。在短期范围内, 本基金管理人将基于经济结构调整过程中政策类的相关变化、景气周期的不同阶段、各参与市场的具体表现、市场资金的供求状况等因素, 通过及时的时机选择进行战术资产配置, 跟踪SAA长期维持均衡的基础上积极主动的实现对大类资产配置动态优化调整。  
此外, 待股票指数期货推出后, 本基金也将依据法律法规的规定, 有计划地运用该衍生产品进行市场组合(Portfolio Insurance)。  
本基金将资产配置策略采用量化模型(Quantitative Model) 与专业判断配置(Judgmental Allocation) 相结合的方式(图中右上方), 示意图如下:



图 本基金资产配置示意图

(2) 资产类别的分配比例  
本基金投资的资产类别包括股票、债券、权证等。其中, 股票类资产包括上市公司流通股股票和未来可能出现的股权类证券, 债券类资产包括国债、金融债、企业债(包括可转债)、央行票据、资产支持证券、短期融资券、回购协议以及银行存款等。  
本基金股票资产的投资比例占基金资产的30%-80%; 权证资产的投资比例占基金资产净值的0%-3%; 债券资产的投资比例占基金资产的15%-65%, 其中中资支持证券类资产占基金资产净值的0%-20%; 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
如果有关法律法规许可, 本基金资产配置比例可作相应调整。  
【1】当股票市场处于较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】当股票市场处于较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, 降低股票投资比重, 加大债券市场的投资力度, 以回避股票市场下跌的系统性风险, 避免组合损失。  
【3】当股票市场处于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, 债券价格上涨时, 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国债, 以实现较高的回报; 在预期利率上升、债券价格下降时, 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浮动息债券。  
【5】对积极参与风险低且可获的新股申购、债券回购等投资。  
2、“自下而上”的股票策略  
本基金的股票投资策略兼顾红利收益(Dividend Income)和资本增值(Capital Appreciation)两个层面, 在精选红利型股票与稳健成长型股票的同时, 综合考虑基金组合投资回报的稳定性、持续性与成长性; 通过精细化风险管理和组合优化技术, 在组合构建中平等偏重主动性风险管理的前提下, 实现行业与风格类资产的均衡配置, 主动承担具有较大研究平台支持的、“自下而上”的股票选择风险, 从而实现风险调整后收益的最大化。  
(1) 第一层: 侧重量化筛选, 构建基本股票库(Fundamental Equity Pool)  
本基金重点关注由以下量化筛选过程产生的股票库:  
【1】按每股现金流由小到大(递增)排序, 剔除排名靠后的上市公司股票;  
【2】在此基础上, 分别采用“红利型股票量化筛选策略”与“稳健成长型股票量化筛选策略”初步确定重点关注股票样本;  
【2-1】红利型股票的量化筛选: 选取过去2年至少有1次现金分红且最近1年的预期现金股息率(D/P)较高、量化排名靠前的上市公司股票;  
【2-2】稳健成长型股票的量化筛选: 选取动态市盈率(P/E)较低、量化分析排名靠前的上市公司股票。  
对于新上市的新股, 本基金将其作为一个特殊资产类, 由基金管理人根据具体市场情况决定投资与否。  
未来, 在政策允许的条件下, 本基金还将关注那些采用回购股票、股权分红等创新方式作为现金分红的替代用以提高股东回报率的上市公司股票。  
(2) 第二层: 突出基本面分析, 构建核心股票库(Core Equity Pool)  
【1】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:

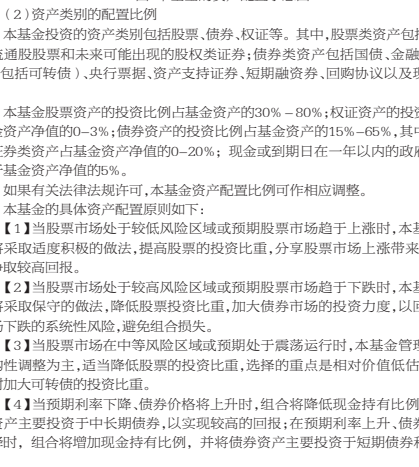


图 上市公司综合素质评估模型示意图

【2】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:



图 本基金资产配置示意图

【2】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:

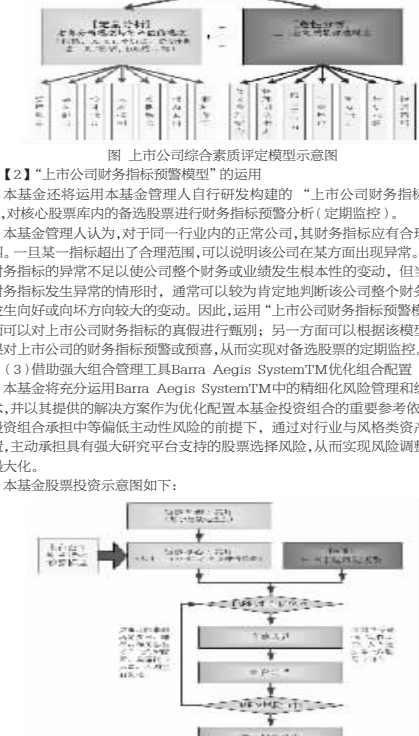


图 本基金资产配置示意图

【2】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:

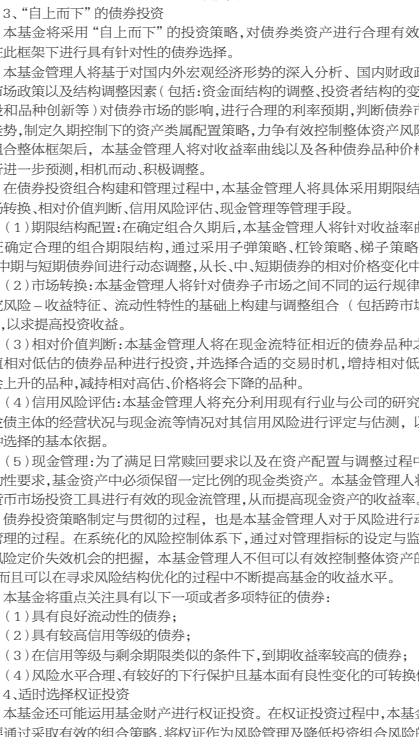


图 本基金资产配置示意图

【2】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:

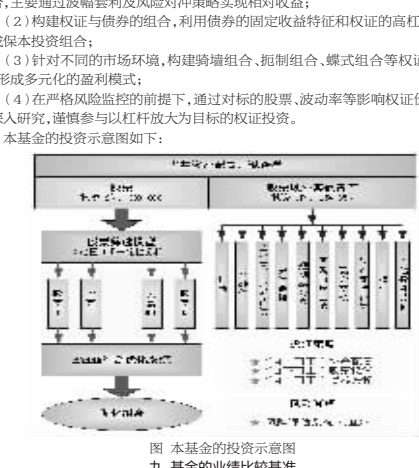


图 本基金资产配置示意图

【2】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:

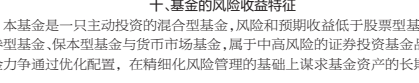


图 本基金资产配置示意图

【2】“上市公司综合素质评估模型”的运用  
本基金将基于“定性定量分析相结合, 动态跟踪指标相结合”的原则, 运用“上市公司综合素质评估模型”对基本股票库中的股票进行二次筛选, 选出运营状况健康、治理结构完善、经营稳健的上市公司股票, 构建核心股票库。  
【2】“上市公司综合素质评估模型”由定性评估模型和定量评估模型两部分构成。本基金管理人将通过运用(定量的)财务分析模型和资产估值模型, 重点关注上市公司资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价格等方面; 通过运用(定性的)上市公司质量评估模型, 重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。其中, 对于红利型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其分红的历史、分红的潜力、分红的意愿等因素; 对于稳健成长型上市公司, 本基金管理人还将侧重考量其历史成长、成长可持续性、成长能力、成长动力来源等因素。  
上市公司综合素质评估模型的示意图如下:



图 本基金资产配置示意图

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,063,293,796.41	70.33
	其中: 股票	4,063,293,796.41	70.33
2	固定收益投资	963,021,759.20	16.67
	其中: 债券	862,311,759.20	14.93
3	贵金属投资	109,280,000.00	1.74
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	523,298,491.88	9.06
7	其他资产	227,726,606.14	3.94
8	合计	5,777,340,653.63	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	-	-
B	采矿业	47,934,456.32	0.84
C	制造业	1,596,613,266.06	34.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,084,923.25	0.98
E	建筑业	75,277,943.34	0.13
F	交通运输、仓储和邮政业	251,763,296.66	4.39
G	交通运输、仓储和邮政业	44,800,014.00	0.78
H	住宿和餐饮业	123,241,445.48	0.21
I	信息技术、软件和信息技术服务业	582,506,078.62	10.16
J	金融业	656,442,642.88	11.45
K	房地产业	189,184,261.55	3.39
L	租赁和商务服务业	102,818,968.27	1.70
M	科学研究和技术服务业	11,481,718.10	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	30,442,769.62	0.53
P	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Q	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	75,352,201.23	1.31
S	综合	-	-
合计		4,063,293,796.41	70.87

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	601166	兴业银行	8,177,268	150,134,640.86	2.62
2	601601	中国太保	3,276,270	111,065,553.03	1.94
3	601318	中国平安	1,394,792	109,128,226.08	1.90
4	300253	卫宁软件	662,459	108,047,062.50	1.88
5	601988	中国银行	25,125,127	103,351,857.88	1.77
6	600133	石化油服	852,246	100,330,406.40	1.75
7	300287	飞翔鸟	1,863,890	96,383,529.50	1.68
8	000628	长安汽车	3,991,121	80,799,845.09	1.41
9	300133	华策影视	1,983,477	75,352,201.23	1.31
10	002450	康得新	1,939,961	74,059,512.15	1.29

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	399,980,000.00	6.98
	其中: 政策性金融债	309,998,000.00	6.45
4	企业债券	14,538,740.40	0.25
5	企业短期融资券	260,115,000.00	4.54
6	中期票据	40,545,000.00	0.71
7	可转债	18,227,327.80	0.32
8	其他	-	-
9	合计	862,311,759.20	15.05

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	140213	14附息13	900,000	90,000,000.00	1.57
2	140212	14附息12	600,000	60,012,000.00	1.05
3	04164005	14附息05	500,000	50,120,000.00	0.87
4	140443	14附息43	500,000	50,200,000.00	0.87
5	140219	14附息29	500,000	50,015,000.00	0.87

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1409914	14附息14A	1,000,000	100,200,000.00	1.75

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------