

# 信息披露 disclosure

## 富国天益价值混合型证券投资基金

### 2017年第四季度报告

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2018年01月20日

**§1 重要提示**

富国基金管理有限公司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。

基金管理人交通银行股份有限公司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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告日期为2017年12月31日起至2017年12月31日止。

#### §2 基金产品概况

基金简称	富国天益价值混合
基金代码	100020
交易代码	前端交易代码：100020 后端交易代码：100021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月15日
报告期末基金资产净值(单位：元)	2,276,153,480.89
投资目标	本基金属价值型基金，主要投资于在价值被低估的上市公司的股票、或同时投资于上市公司相比其具有更高折价价值的上市公司股票。
投资策略	本基金通过投资具有良好成长性的股票，在追求基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×90%+中国债券综合指数收益率×10%
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。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2017年10月01日-2017年12月31日)
--------	------------------------------

1.本期已实现收益	372,387,671.32
2.本期利润	360,674,640.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0394
4.期末基金资产净值	3,718,569,332.94
5.期末基金份额净值	1.0227

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实现的收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

2.本基金于2004年6月15日成立，建仓期3个月，从2004年6月15日起至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1月16日步入封闭运作期。

3.2.2 自基金成立生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

注：1.截止日期为2017年12月31日。

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
----	----	-------------	--------	----

注：1.上述任职日期为根据公司公告确定的聘任日期，离任日期为根据公司公告确定的解聘日期；前任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业年限是指从事与证券行业相关工作的人员资格管理办法的相关规定。

4.2 报告期内本基金基金经理变动情况

按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天益价值混合型证券投资基金合同》及其他有关法律法规的规定，本基金经理在报告期内，勤勉尽责地履行了基金合同约定的职责，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.4 异常交易行为的专项说明

4.3.5 异常交易行为的专项说明

4.3.6 异常交易行为的专项说明

4.3.7 异常交易行为的专项说明

4.3.8 异常交易行为的专项说明

4.3.9 异常交易行为的专项说明

4.3.10 异常交易行为的专项说明

4.3.11 异常交易行为的专项说明

4.3.12 异常交易行为的专项说明

4.3.13 异常交易行为的专项说明

4.3.14 异常交易行为的专项说明

4.3.15 异常交易行为的专项说明

4.3.16 异常交易行为的专项说明

4.3.17 异常交易行为的专项说明

4.3.18 异常交易行为的专项说明

4.3.19 异常交易行为的专项说明

4.3.20 异常交易行为的专项说明

4.3.21 异常交易行为的专项说明

4.3.22 异常交易行为的专项说明

4.3.23 异常交易行为的专项说明

4.3.24 异常交易行为的专项说明

4.3.25 异常交易行为的专项说明

4.3.26 异常交易行为的专项说明

4.3.27 异常交易行为的专项说明

4.3.28 异常交易行为的专项说明

4.3.29 异常交易行为的专项说明

4.3.30 异常交易行为的专项说明

4.3.31 异常交易行为的专项说明

4.3.32 异常交易行为的专项说明

4.3.33 异常交易行为的专项说明

4.3.34 异常交易行为的专项说明

4.3.35 异常交易行为的专项说明

4.3.36 异常交易行为的专项说明

4.3.37 异常交易行为的专项说明

4.3.38 异常交易行为的专项说明

4.3.39 异常交易行为的专项说明

4.3.40 异常交易行为的专项说明

4.3.41 异常交易行为的专项说明

4.3.42 异常交易行为的专项说明

4.3.43 异常交易行为的专项说明

4.3.44 异常交易行为的专项说明

4.3.45 异常交易行为的专项说明

4.3.46 异常交易行为的专项说明

4.3.47 异常交易行为的专项说明

4.3.48 异常交易行为的专项说明

4.3.49 异常交易行为的专项说明

4.3.50 异常交易行为的专项说明

4.3.51 异常交易行为的专项说明

4.3.52 异常交易行为的专项说明

4.3.53 异常交易行为的专项说明

4.3.54 异常交易行为的专项说明

4.3.55 异常交易行为的专项说明

4.3.56 异常交易行为的专项说明

4.3.57 异常交易行为的专项说明

4.3.58 异常交易行为的专项说明

4.3.59 异常交易行为的专项说明

4.3.60 异常交易行为的专项说明

4.3.61 异常交易行为的专项说明

4.3.62 异常交易行为的专项说明

4.3.63 异常交易行为的专项说明

4.3.64 异常交易行为的专项说明

4.3.65 异常交易行为的专项说明

4.3.66 异常交易行为的专项说明

4.3.67 异常交易行为的专项说明

4.3.68 异常交易行为的专项说明

4.3.69 异常交易行为的专项说明

4.3.70 异常交易行为的专项说明

4.3.71 异常交易行为的专项说明

4.3.72 异常交易行为的专项说明

4.3.73 异常交易行为的专项说明

4.3.7