

# 富国动态平衡证券投资基金 2004 年 3 月公开说明书

## 【重要提示】

本公开说明书是《富国动态平衡证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)的摘要及定期更新,投资人投资本基金应仔细阅读《招募说明书》,但本公开说明书对《招募说明书》的更新部分,以本公开说明书为准。

基金管理人保证本公开说明书的内容真实、准确。本公开说明书已经中国证监会审核同意,但中国证监会对本基金做出的任何决定,均不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

## 【公开说明书摘要】

基金名称:富国动态平衡证券投资基金

基金类型:契约型开放式

批准机关及文号:中国证监会证监基金字[2002]36号

投资目标:本基金的投资目标是尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长。本基金为平衡型证券投资基金,将基金资产按比例投资于股票和债券,在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票,并对基金的投资组合进行主动的管理,从而使投资者在承受相对较小风险的情况下,尽可能获得稳定的投资收益

投资范围:限于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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具

收益分配:在符合基金分红条件的前提下,每年至少一次;投资者可以选择现金分红或红利再投资

基金单位面值:人民币 1.00 元(认购时)

销售渠道:富国基金管理有限公司的直销网点及中国农业银行、上海浦东发展银行、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华夏证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、招商证券有限公司责任公司的代销网点

申购费率:可在申购或赎回时收取,在申购时采用超额累退制,最高档收费不高于申购金额(含申购费)的 1.5%;在赎回时以持有期限分档设置不同费率,最高不超过赎回金额

的 1.8%

赎回费率：赎回费率随基金持有时间的增加而递减，持有 1 年以内（含 1 年）赎回的，费率不高于 0.5%；持有期 1 年以上、2 年以下（含 2 年），费率不高于 0.3%；持有期 2 年以上，免收赎回费用

最低投资额：1,000 元（含申购费）

最低赎回额：1,000 份基金单位

基金发起人：富国基金管理有限公司

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

注册登记机构：富国基金管理有限公司

会计师事务所：安永大华会计师事务所有限责任公司

律师事务所：北京市竞天公诚律师事务所

上述内容仅为公开说明书摘要，详细资料须以本公开说明书正文所载的内容为准。

## 绪言

本公开说明书依据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关法规及《富国动态平衡证券投资基金基金契约》编写。

本基金发起人承诺本公开说明书不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本公开说明书由富国基金管理有限公司解释。本基金发起人没有委托或授权任何其他人提供未在本公开说明书中载明的信息，或对本公开说明书做出任何解释或者说明。

# 第一部分 富国动态平衡证券投资基金概况

## 一、基金的设立

### （一）基金设立的依据

本基金由基金发起人依照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其它有关规定，经中国证监会证监基金字[2002]36 号文批准发起设立。

### （二）基金存续期间及基金类型

#### 1、基金存续期间：不定期

## 2、基金类型：契约型开放式

### （三）基金契约

基金契约是规定基金契约当事人之间基本权利义务的法律文件。基金契约当事人包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金持有人。基金投资者自取得依基金契约发行的基金单位起，即成为基金持有人，其取得和持有基金单位的行为本身即表明其对基金契约的承认和接受，并按照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金持有人的权利和义务，应详细查阅基金契约。

## 二、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

#### 5、购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

### （二）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

### （三）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金单位净值。

#### （四）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### （五）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### （六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金契约有关规定的风险。

#### （七）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

### 三、基金的日常申购与赎回

#### （一）基金投资者范围

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。

#### （二）申购与赎回办理的场

投资者应当在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供其他方式办理基金的申购与赎回。

本基金的销售机构包括富国基金管理有限公司及其委托的代销机构。目前的代销机构为

中国农业银行、上海浦东发展银行、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华夏证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、招商证券有限公司责任公司。

富国基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

### （三）申购与赎回的开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资者办理基金申购、赎回等业务的证券交易所交易日。具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

### （四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算。

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、基金的申购和赎回以书面方式或经基金管理人认可的其他方式进行。

5、基金管理人在不损害基金持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （五）申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金单位余额。

#### 2、申购与赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下投资者可在T+2日通过本公司客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况。

#### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。

投资者赎回款按有关规定自成交确认日起 5 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金契约有关规定处理。

#### （六）申购与赎回的数额限制

1、代销网点每次申购的最低金额为 1,000 元（含申购费）。直销网点首次申购的最低金额为 5,000 元（含申购费），追加申购的最低金额为 1,000 元，已在直销网点有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

2、基金持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1,000 份基金单位。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金单位余额不足 1,000 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人在不损害基金持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （七）本基金的申购费与赎回费

##### 1、申购费率

（1）申购本基金分前、后端两种收费模式，投资人可自行选择。

（2）本基金的前端申购费按申购金额采用超额累退费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

对于单笔金额不超过 100 万元（含 100 万元）的申购申请，前端申购费率为 1.5%；

对于单笔金额超过 100 万元的申购申请，适用以下前端申购费率：

申购金额	申购费率
不超过 100 万元的部分	不高于 1.5%
超过 100 万元至 1000 万元的部分	不高于 1.2%
超过 1000 万元至 1 亿元的部分	不高于 1.0%
超过 1 亿元的部分	0

（3）本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同费率水平：1 年以内（含）1.8%；1~2 年（含）1.5%；2~3 年（含）1.2%；3~4 年（含）1.0%；4~5 年（含）0.5%；5 年以上为 0。

申购费保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，不向投资者收取。

##### 2、赎回费率

赎回费率随基金持有时间的增加而递减，对于采用后端申购模式的投资者及采用前端申

购模式且单笔赎回金额不超过 1000 万元（包括 1000 万元）的赎回申请，适用以下费率：持有 1 年以内（含 1 年）赎回的，费率 0.5%；持有期 1 年以上、2 年以下（含 2 年），费率为 0.3%；持有期 2 年以上，免收赎回费用；

对于采用前端申购模式且单笔赎回金额超过 1000 万元的赎回申请，适用以下费率：持有 1 年以内（含 1 年）赎回的，费率不高于 0.5%；持有期 1 年以上、2 年以下（含 2 年），费率不高于 0.3%；持有期 2 年以上，免收赎回费用；

赎回费保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，不向投资者收取。赎回费作为注册登记费。

### 3、后端申购模式适用的销售网点

本基金后端收费模式适用于富国动态平衡基金的以下直销和代销网点。直销：富国基金管理有限公司上海投资理财中心。代销：上海浦东发展银行、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华夏证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、招商证券有限公司责任公司的所有代销本基金的网点。

4、基金管理人可以调整申购费率和赎回费率，调高申购费率和赎回费率须召开基金份额持有人大会审议，最新的申购费率和赎回费率在公开说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （八）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金单位。投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

在《富国动态平衡证券投资基金基金契约》规定的情形下，基金管理人可拒绝或暂停申购、赎回。具体规定投资人应仔细阅读《富国动态平衡证券投资基金基金契约》。

## 四、基金的投资

### （一）投资目标

本基金的投资目标是尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长。

本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。

## （二）投资范围

1、本基金只投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开募集、上市的股票和债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

2、本基金股票投资部分主要投资于成长型股票和价值型股票，成长型股票和价值型股票按以下原则确定：

### （1）成长型股票，包括三类：

经典成长型：这类公司提供新产品，创造或满足新的市场需求，新产品通常是新技术、新发明的结果；

市场份额成长型：这类公司增长迅速的原因在于它们靠更好的产品质量、形象或服务提高市场占有率；

合并型：这类公司的增长来自于收购大量其他公司，支付合理收购价格并实现融合是其成功的关键因素。

成长型股票具体的量化标准是：1）年度每股收益不低于 0.10 元；2）利润总额连续两年（或预期）增长，并且增长速度不低于同期 GDP 增长速度。

（2）价值型上市公司股票，是指公司经营情况良好，业绩稳定，市盈率较低的上市公司发行的股票。价值型股票具体的量化标准是：每股收益不低于市场平均水平，并且市盈率由低到高排名靠前。

3、本基金债券投资部分将投资于国债、金融债和企业债（包括可转换债）。本基金将在分析宏观经济环境、利率走势、资金供求、债券市场结构的基础上，综合考虑债券的风险收益水平、流动性、期限、发行人资信水平等因素建立债券投资组合。

## （三）投资组合

本基金的投资组合遵循以下规定：

- 1、本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；
- 2、本基金投资于国债的比例不低于基金资产净值的 30%；
- 3、本基金股票投资中，投资于成长型上市公司的基准投资比例为 60%，投资于价值型上市公司的基准投资比例为 40%，上下浮动比例为 10%；
- 4、本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 5%；

5、本基金持有一家上市公司的股票数量不超过该股票流通股的 10%；

6、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

7、遵守中国证监会等监管部门规定的其他比例限制。

由于基金规模或市场变化导致投资组合不符合上述比例规定，允许基金管理人在合理的期限内进行调整，以使投资组合符合上述规定。

#### （四）投资策略

##### 1、投资依据

——国家有关法律、法规和本基金基金契约的有关规定。

——国家宏观经济环境：主要包括国内生产总值、经济增长率、失业率、通货膨胀率、财政收支、国际收支、固定资产投资规模等指标。

——国家货币政策和利率走势：对中长期投资的重要的决策依据。

——国家产业政策：国家产业政策对投资方向具有重要影响。

——各行业发展状况：形成行业投资策略的重要依据。

——上市公司研究：形成投资组合的直接依据。

——证券市场走势：中国属于新兴市场，呈现较大的波动性。针对市场走势的变化调整相应的投资策略是管理好基金极其重要的基本工作。

##### 2、投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

1) 基金经理根据证券市场的趋势、运行的格局和特点，并结合本基金的基金契约、投资风格拟定投资策略报告。

2) 投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的资产分布比例、成长型和价值型股票投资比例和重仓投资品种投资方案。基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、股票资产中的成长型和价值型股票分布比例和个股投资分布方式。

3) 对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

4) 基金经理须每月提交工作报告及工作计划。

##### 3、投资方法

本基金采用主动投资管理模式，投资方法将主要采用自上而下的方法。

首先，对各类资产（股票、债券、现金及其他金融资产）进行动态配比。

其次，确定成长型公司股票和价值型公司股票的投资比例。

第三，构造候选股票池：（1）根据分行业股票评价体系，确定行业内的优选股票；（2）对上述优选股票划分成长型和价值型，确定本基金的候选股票池。

第四，基金经理综合考虑资产配置、成长型和价值型股票的比例、行业状况变化及市场特点等因素，从候选股票池中挑选合适的股票，构造基金资产组合。

#### （五）投资限制

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、将基金资产用于抵押、担保；
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司募集的证券；
- 8、进行内幕交易、操纵市场，通过关联交易损害基金持有人的利益；
- 9、从事任何形式的证券承销业务；
- 10、中国证监会及有关法律法规规定禁止从事的其他行为；
- 11、基金管理人承诺的禁止从事的其他投资，包括：

（1）A股流通股小于1000万股的股票；（2）ST、PT股票，但已在证监会指定报刊公告基本面发生正面重大变动的除外；（3）因涉嫌违规而接受证监会或其他主管部门调查的公司的股票；（4）截止投资日为止前一年涨幅超过200%的股票；（5）信用评级低于AAA级的企业债券，应禁止纳入组合。

#### （六）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

## 五、基金资产估值

每个交易日，基金管理人按照基金契约的规定对基金资产进行估值，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人负责公告。

## 六、基金费用与税收

### （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、证券交易费用；
- 4、基金信息披露费用；
- 5、基金持有人大会费用；
- 6、与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。
- 2、基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。
- 3、本条第（一）款第 3 至第 7 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金持有人大会。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 七、基金收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；

- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；
- 4、其他收入。

#### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### （三）收益分配原则

- 1、每份基金单位享有同等分配权；
- 2、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 3、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；
- 5、本基金收益分配采用现金形式。基金管理人为持有人提供红利再投资服务。投资者选择红利再投资服务的，其分红资金按除息日的基金单位净值转成相应的基金单位；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案须载明基金收益的范围、基金净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后5个工作日内公告，请投资者留意本基金指定的信息披露媒体。

#### （六）收益分配中发生的费用

- 1、投资者选择红利再投资服务的，免收再投资的费用；
- 2、本基金管理人可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在公开说明书中规定。

### 八、基金的会计与审计

基金的会计政策详见《富国动态平衡证券投资基金基金契约》。

### 九、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》、本基金基金契约及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项须在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （一）招募说明书

基金发起人按照《暂行办法》、《试点办法》编制并公告招募说明书。

#### （二）发行公告

基金发起人按照《暂行办法》及其实施细则、《试点办法》编制并公告发行公告。

#### （三）定期报告

本基金定期报告包括中期报告、年度报告、基金投资组合公告、基金净值公告及公开说明书，由基金管理人和基金托管人按照《暂行办法》、《试点办法》的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件进行编制，并在中国证监会指定的信息披露媒体公告，同时报中国证监会备案。

1、中期报告：基金中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后 60 日内公告。

2、年度报告：基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后 90 日内公告。

3、基金投资组合公告：基金投资组合公告每季度公布一次，于截止日后 15 个工作日内公告。

4、基金净值公告：本基金的基金资产净值在每个开放日次日公告。

5、公开说明书：本基金成立后，基金管理人将于每 6 个月结束后 30 日内公告。公开说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后一日。

公开说明书应该包括下述内容：

（1）基金概要；

（2）最近 6 个月的经营业绩和持续经营业绩简介；

（3）所有重要变更事项；

（4）其他应披露事项。

#### （四）临时报告与公告

在本基金运作过程中发生如下可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件时，将按照《暂行办法》、实施准则第五号《证券投资基金信息披露指引》及中国证监会的有关规定及时公告。

1、基金持有人大会决议；

2、基金管理人或基金托管人变更；

3、基金管理人或基金托管人的高级管理人员变动；

4、基金经理变更；

5、基金管理人或基金托管部主要业务人员一年内变更超过 30%；

- 6、基金管理人或基金托管人及其董事、监事和高级管理人员受到重大处罚；
- 7、重大诉讼、仲裁事项；
- 8、基金提前终止；
- 9、重大关联交易；
- 10、发生巨额赎回并延期支付；
- 11、基金暂停申购和赎回；
- 12、基金成立、开始或重新开始申购、赎回等一项或多项业务的办理；
- 13、基金投资限额的调整；
- 14、基金费用的调整；
- 15、增加或减少代销机构；
- 16、申购、赎回时间调整；
- 17、基金净值计算出现错误；
- 18、基金或为基金提供服务的相关机构出现有关事项，可能影响投资人对基金风险和未来表现的评估。

19、其他重大事项。

#### （五）信息披露媒体

本基金管理人旗下基金的信息披露媒体为中国证监会指定的信息披露媒体中的至少一种媒体，请投资者注意本基金的信息披露。

#### （六）信息披露文件的存放与查阅

本基金半年报告、年度报告、基金投资组合公告、公开说明书、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人所在地，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

### 十、基金的终止与清算

基金的终止、清算事宜详见《富国动态平衡证券投资基金基金契约》

### 十一、基金持有人和基金持有人大会

每份基金单位代表同等的权利和义务。

#### （一）基金持有人的权利

- 1、出席或者委派代表出席基金持有人大会，并行使表决权；
- 2、取得基金收益；

- 3、监督基金经营情况，按基金契约的规定获取基金业务及财务状况的资料；
- 4、按基金契约的规定赎回、申请基金转托管并在规定的时间取得有效申请的款项或基金单位；
- 5、取得基金清算后的剩余资产；
- 6、知悉基金契约规定的有关信息披露内容；
- 7、提请基金管理人或基金托管人履行按本契约规定应尽的义务；
- 8、因基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构的过错导致利益受到损害，有要求赔偿的权利；
- 9、法律法规及基金契约规定的其他权利。

#### (二) 基金持有人的义务

- 1、遵守基金契约；
- 2、缴纳基金认购、申购款项，承担规定的费用；
- 3、承担基金亏损或者终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损本基金及本基金的其他当事人利益的活动；
- 5、法律法规及基金契约规定的其他义务。

#### (三) 基金持有人大会

##### 1、召开事由

有以下情形之一的，应召开基金持有人大会：

- (1) 修改基金契约；
- (2) 因无法满足契约规定的条件而终止基金；
- (3) 更换基金管理人；
- (4) 更换基金托管人；
- (5) 变更基金类型；
- (6) 单独或合并代表基金总份额 10%（不含 10%）以上的基金持有人就同一事项书面要求召开基金持有人大会；
- (7) 基金管理人或基金托管人要求召开基金持有人大会；
- (8) 中国证监会规定的其他情形；
- (9) 《暂行办法》、《试点办法》及其它有关规定确定的其它事项。

2、基金持有人大会的其他有关事宜详见《富国动态平衡证券投资基金基金契约》。

## 十二、对基金持有人的服务

基金管理人承诺为基金持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

#### （一）资料寄送

##### 1、帐户卡

在开户确认后的一个月内向投资者寄送帐户卡。

##### 2、基金投资者对账单

每季度结束后 15 个工作日内，向本季度末所有持有本基金单位的投资者，或在本季度有交易、季末基金单位余额为零的投资者寄送交易对账单。由于地址不详或地址不正确等原因导致无法寄达而被退回的对账单，我公司将在保存 3 个月而后予以统一销毁，没有收到对账单的客户可与公司客户服务部门联系，随时要求补寄或补办。

##### 3、其他相关的信息资料

#### （二）红利再投资

本基金收益分配时，基金持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，注册登记机构将其所获红利按除息日的基金单位净值自动转为基金单位。红利再投资免收申购费用。基金持有人可以选择和更改基金分红方式。

#### （三）资讯服务

##### 1、呼叫中心提供的服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打富国基金管理有限公司如下 24 小时语音服务电话：

呼叫中心：021-53594678，该电话在工作时间内可转人工坐席。

传真：021-63410899

##### 2、互联网站

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

电子信箱：[public@fullgoal.com.cn](mailto:public@fullgoal.com.cn)

### 十三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

本基金基金管理人为富国基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 13、14 层

法定代表人：陈敏

总经理：李建国

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：(021) 63410666

传真：(021) 63410015

## （二）发展概况

富国基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1999]11 号文批准设立的证券投资基金管理公司，成立时由海通证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、华泰证券有限责任公司、福建国际信托投资公司和山东省国际信托投资公司等额出资组建而成，注册资本 1 亿元人民币，5 家股东各占股份的 20%。2003 年 5 月 20 日经中国证券监督管理委员会批准，加拿大蒙特利尔银行（BMO）正式参股富国基金，公司注册资金增加为 1.2 亿元人民币，6 家股东各占股份的 16.67%。

截止至 2003 年末，公司共管理基金汉盛、基金汉兴、基金汉鼎、基金汉博 4 只封闭式证券投资基金和富国动态平衡证券投资基金、富国天利增长债券投资基金 2 只开放式基金。

## （三）本基金基金管理组简介

基金经理：陈继武先生，工学硕士，38 岁，10 年证券从业经历，曾任浙江农行信托证券部职员、中信银行杭州分行计财处主管、浙江国际信托投行部副经理、南方基金管理公司基金金元、基金隆元基金经理、中国人寿资金运用中心基金投资部投资总监，现任富国基金管理有限公司投资总监。

基金经理助理：赖晶铭先生，31 岁，经济学硕士，7 年金融、证券从业经历，曾就职于中国租赁有限责任公司第三业务部、大鹏证券北京投资银行部、海通证券北京投资银行部、富国基金管理有限公司研究策划部、汉鼎基金经理助理。

基金经理助理：丁加波先生，29 岁，经济学硕士，4 年证券从业经历。曾任大鹏证券投资银行总部项目经理、富国基金管理有限公司行业分析师、汉博基金经理助理。

## （四）基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

- （1）依法运用基金资产；
- （2）依本基金契约规定获得基金管理人报酬；
- （3）代表基金对所投资公司行使股东权利；
- （4）决定基金收益分配方案；

- (5) 销售基金单位，获取认购（申购）费；
- (6) 选择和更换代销机构，并对其销售代理行为进行必要的监督；
- (7) 基金契约规定的情形出现时，决定拒绝或暂停受理基金单位的申购、暂停受理基金单位的赎回；
- (8) 监督基金托管人，如认为基金托管人违反基金契约或有关法律法规的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (9) 《暂行办法》、基金契约以及有关法律、法规规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

- (1) 遵守基金契约；
- (2) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
- (4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (5) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定外，不委托其他人运作基金资产；
- (7) 接受基金托管人依法进行的监督；
- (8) 按规定计算并公告基金单位净值；
- (9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《证券投资基金信息披露指引》、基金契约及其他有关规定，履行信息披露及报告义务，编制并公告季度报告、中期报告、年度报告等定期报告及临时报告；
- (10) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规、基金契约及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不向他人泄露；
- (11) 依据基金契约决定基金收益分配方案，按规定向基金持有人分配基金收益；
- (12) 依据《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定召集基金持有人大会；
- (13) 负责基金注册登记。基金管理人应严格按照有关法律法规及基金契约，办理或委托其他机构办理本基金的注册登记业务；
- (14) 按照法律法规和基金契约的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

- (15) 保管基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- (16) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (17) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (18) 因过错导致基金资产的损失，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (19) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；
- (20) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；
- (21) 保证投资人能够按照基金契约规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- (22) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- (23) 法律法规及基金契约规定的其他义务。

#### (五) 基金管理人的更换

基金管理人更换的有关规定详见《富国动态平衡证券投资基金基金契约》。

### 十四、基金托管人

#### (一) 基金托管人概况

本基金基金托管人为中国农业银行，基本信息如下：

注册地址：北京市复兴路甲 23 号

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦 7—8 层。

法定代表人：杨明生

成立时间：1979 年 2 月 23 日

电话：(010) 68424199

#### (二) 基金托管人的权利与义务

##### 1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金资产；
- (2) 依法监督基金管理人的投资运作，如果基金管理人违反了本基金契约及国家有关法律法规，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (3) 获取基金托管费；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (5) 法律法规及基金契约规定的其他权利。

##### 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金契约；
- (2) 自基金成立之日起，根据基金契约和托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；
- (3) 采取适当、合理的措施，使基金单位的认购、申购、赎回等事项符合基金契约等有关法律文件的规定；
- (4) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (6) 除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；
- (7) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (8) 以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；
- (9) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值；
- (11) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金契约的规定进行；如果基金管理人未执行基金契约规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施，并报中国证监会和中国人民银行；
- (12) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定支付基金持有人的收益和赎回款项；
- (15) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (16) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
- (17) 因过错导致基金资产的损失，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(19) 不从事任何有损本基金及本基金其他当事人利益的活动；

(20) 法律法规及基金契约规定的其他义务。

## 十五、基金代销机构

1、本基金目前由中国农业银行、上海浦东发展银行、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华夏证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、招商证券有限公司责任公司代销。

2、条件成熟时，本基金管理人还将选择其他商业银行、证券公司和其他符合条件的机构作为基金代销机构并及时公告。

## 第二部分 基金经营业绩

### 一、经营业绩

最近三个会计期间主要经营业绩数据：

#### (一) 总净值 (金额单位：人民币元)

项目	2002-8-16 至 2002-12-31	2003-1-1 至 2003-12-31	2004-1-1 至 2003-2-29
最高	4,618,661,614.51	3,658,758,405.65	1,696,825,934.33
最低	3,599,408,318.65	1,659,813,735.59	1,525,457,130.54
期末	3,599,408,318.65	1,659,813,735.59	1,588,247,057.81

#### (二) 单位净值

项目	2002-8-16 至 2002-12-31	2003-1-1 至 2003-12-31	2004-1-1 至 2003-2-29
最高	1.0004	1.0887	1.1597
最低	0.9228	0.9090	1.0887
期末	0.9228	1.0781	1.1563

#### (三) 主要财务指标

项目	2002-8-16 至 2002-12-31	2003-1-1 至 2003-12-31	2004-1-1 至 2003-2-29
1 加权平均单位基金本期净收益	-0.0104	0.0083	0.0724
2 期末可供分配基金收益	-301,005,485.23	34,130,534.74	102,221,807.59
3 期末可供分配单位基金收益	-0.0772	0.0222	0.0744
4 期末单位基金资产净值	0.9228	1.0781	1.1563
5 基金加权平均净值收益率	-1.08%	0.85%	6.39%
6 本期单位基金净值增长率	-7.74%	16.83%	9.15%
7 单位基金累计净值增长率	-7.74%	7.79%	17.65%

## 二、财务报表

### (一) 截止 2004 年 2 月 29 日会计报表 (未经审计)

#### 1、2004 年 2 月 29 日资产负债表 (未经审计)

金额单位：人民币元

资 产	期初数	期末数
银行存款	43,828,048.35	48,623,215.59
清算备付金	1,500,757.42	9,493,305.23
交易保证金	1,500,000.00	1,500,000.00
应收证券交易清算款	14,226,709.43	12,084,399.91
应收股利	0	0
应收利息	5,512,364.30	6,181,171.62
应收申购款	130,035,657.00	0
其他应收款	547.03	547.03
股票投资市值	1,106,670,733.80	1,044,652,552.70
其中：股票投资成本	983,198,016.44	879,252,602.19
债券投资市值	538,091,954.11	535,988,174.01
其中：债券投资成本	542,798,258.46	539,960,822.85
配股权证	0	0
买入返售证券	0	0
待摊费用	0	0
其他资产		
资产合计	<b>1,841,366,771.44</b>	<b>1,658,523,366.09</b>
负债及基金持有人权益		
应付证券清算款	8,053,237.27	10,421,876.27
应付赎回款	168,997,675.45	5,360,968.66
应付赎回费	84,235.11	16,264.09
应付管理人报酬	2,490,806.89	1,865,926.86
应付托管费	415,134.48	310,987.82
应付佣金	1,156,036.65	1,783,622.91
应付利息	0	101,088.27
应付收益	0	0
未交税金	0	0
其他应付款	250,000.00	250,000.00
卖出回购证券款	0	50,000,000.00
短期借款	0	0
预提费用	105,910.00	165,573.40
其他负债		
负债合计	<b>181,553,035.85</b>	<b>70,276,308.28</b>

基金持有人权益		
实收基金	1,539,534,747.37	1,373,594,443.47
未实现利得	86,148,453.48	112,430,806.75
未分配收益	34,130,534.74	102,221,807.59
持有人权益合计	1,659,813,735.59	1,588,247,057.81
负债与持有人权益总计	<b>1,841,366,771.44</b>	<b>1,658,523,366.09</b>

注：本表中，期初数为 2003 年 12 月 31 日的数据，期末数为 2004 年 2 月 29 日的数据。

2、2004 年 2 月 29 日经营业绩表（未经审计） 金额单位：人民币元

项 目	本期数
一、收入	106,662,257.36
1、股票差价收入	104,830,458.88
2、债券差价收入	-752,836.67
3、债券利息收入	2,305,018.50
4、存款利息收入	255,984.25
5、股利收入	0
6、买入返售证券收入	0
7、其他收入	23,632.40
二、费用	4,980,135.59
1、基金管理人报酬	3,908,419.04
2、基金托管费	651,403.20
3、卖出回购证券支出	346,384.28
4、利息支出	0
5、其他费用	73,929.07
其中：	
上市年费	
信息披露费	49,180.20
审计费用	16,393.20
三、基金净收益	101,682,121.77
加：未实现利得	42,660,888.66
四、基金经营业绩	144,343,010.43

(二) 2003 年会计报表（已审计）

1、2003 年 12 月 31 日资产负债表（已审计） 金额单位：人民币元

资 产	年初数	年末数
银行存款	701,873,904.80	43,828,048.35
清算备付金	8,371,891.43	1,500,757.42
交易保证金	1,000,000.00	1,500,000.00

应收证券清算款	237,088.07	14,226,709.43
应收股利		
应收利息	15,176,310.52	5,512,364.30
应收申购款	10,835.00	130,035,657.00
其他应收款		547.03
股票投资市值	1,366,884,062.63	1,106,670,733.80
其中：股票投资成本	1,651,329,579.26	983,198,016.44
债券投资市值	1,567,454,644.60	538,091,954.11
其中：债券投资成本	1,572,663,669.21	542,798,258.46
配股权证		
买入返售证券	-	-
待摊费用	-	-
其他资产		
<b>资产合计</b>	<b>3,661,008,737.05</b>	<b>1,841,366,771.44</b>

负债及基金持有人权益	年初数	期末数
应付证券清算款		8,053,237.27
应付赎回款	54,648,238.09	168,997,675.45
应付赎回费	274,613.83	84,235.11
应付管理人报酬	4,761,390.22	2,490,806.89
应付托管费	793,565.04	415,134.48
应付佣金	374,611.22	1,156,036.65
应付利息		
应付收益		
未交税金		
其他应付款	340,000.00	250,000.00
卖出回购证券款		
短期借款		
预提费用	408,000.00	105,910.00
其他负债		
<b>负债合计</b>	<b>61,600,418.40</b>	<b>181,553,035.85</b>
<b>基金持有人权益</b>		
实收基金	3,900,413,803.88	1,539,534,747.37
未实现利得	-258,473,528.54	86,148,453.48
未分配收益	-42,531,956.69	34,130,534.74
持有人权益合计	3,599,408,318.65	1,659,813,735.59
<b>负债与持有人权益总计</b>	<b>3,661,008,737.05</b>	<b>1,841,366,771.44</b>

## 2、2003 年度经营业绩表（已审计）

金额单位：人民币元

项 目	本年数	上年数
一、收入	75,581,424.79	-15,900,614.75
1、股票差价收入	8,055,373.54	-39,825,859.35
2、债券差价收入	7,803,448.15	-1,254,252.71
3、债券利息收入	33,029,898.66	11,332,162.32
4、存款利息收入	3,800,329.82	10,692,376.14
5、股利收入	22,551,225.06	706,831.56
6、买入返售证券收入		1,522,184.00
7、其他收入	341,149.56	925,943.29
二、费用	51,840,732.93	29,107,404.49
1、基金管理人报酬	42,007,985.34	23,539,426.15
2、基金托管费	7,001,330.84	3,923,237.65
3、卖出回购证券支出	2,674,709.10	1,083,298.66
4、利息支出		
5、其他费用	156,707.65	561,442.03
其中：		
上市年费		
信息披露费		300,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
三、基金净收益	23,740,691.86	-45,008,019.24
加：未实现利得	408,420,954.25	-289,654,541.24
四、基金经营业绩	432,161,646.11	-334,662,560.48

## 3、2003 年度基金净值变动表（已审计）

金额单位：人民币元

项目	本年数	上年数
一、期初基金净值	3,599,408,318.65	4,616,913,656.00
二、本期经营活动：		
基金净收益	23,740,691.86	-45,008,019.24
未实现利得	408,420,954.25	-289,654,541.24
经营活动产生的基金净值变动数	432,161,646.11	-334,662,560.48
三、本期基金单位交易：		
基金申购款	193,855,974.18	31,044,526.83
基金赎回款	2,565,612,203.35	713,887,303.70
基金单位交易产生的基金净值变动数	-2,371,756,229.17	-682,842,776.87
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		

五、期末基金净值

1,659,813,735.59      3,599,408,318.65

4、2003 年度基金收益分配表（已审计）

金额单位：人民币元

项目	本年数	上年数
本期基金净收益	23,740,691.86	-45,008,019.24
加：期初基金净收益	-42,531,956.69	
加：本期损益平准金	52,921,799.57	2,476,062.55
可供分配基金净收益	34,130,534.74	-42,531,956.69
减：本期已分配基金净收益		
期末基金净收益	34,130,534.74	-42,531,956.69

### 第三部分 基金投资组合（2003 年第四季度）

#### 一、重要提示

本基金托管人中国农业银行已于 2004 年 1 月 16 日复核了本公告。

截止 2003 年 12 月 31 日，富国动态平衡证券投资基金资产净值 1,659,813,735.59 元, 单位净值为 1.0781 元。

#### 二、基金投资组合

##### （一）按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值 （元）	占净值比例（%）
1	A 农、林、牧、渔业	12,284,130.00	0.74
2	B 采掘业	34,650,000.00	2.09
3	C 制造业	506,847,208.90	30.54
	C0 食品、饮料		
	C1 纺织、服装、皮毛		
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	31,320,000.00	1.89
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	44,290,303.37	2.67
	C5 电子	15,429,766.04	0.93
	C6 金属、非金属	174,830,145.23	10.53
	C7 机械、设备、仪表	216,171,994.26	13.02
	C8 医药、生物制品	24,805,000.00	1.49
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	179,571,948.41	10.82
5	E 建筑业		

6	F 交通运输、仓储业	231,650,616.76	13.96
7	G 信息技术业	63,169,566.33	3.81
8	H 批发和零售贸易	21,961,710.31	1.32
9	I 金融、保险业	47,322,015.80	2.85
10	J 房地产业		
11	K 社会服务业		
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类	9,213,537.29	0.56
	合 计	1,106,670,733.80	66.67

#### (二) 国债及货币资金合计

截止 2003 年 12 月 31 日,基金持有的国债及货币资金合计为 562,321,513.64 元,占基金资产净值的 33.88%。

#### (三) 可转换债券投资合计

截止 2003 年 12 月 31 日,基金持有的可转换债券投资合计为 27,272,718.40 元,占基金资产净值的 1.64%。

### 三、基金投资前十名股票明细

序号	股票名称	市 值(元)	占净值比例(%)
1	上海汽车	75,798,906.57	4.57
2	赣粤高速	73,805,000.00	4.45
3	中国联通	63,169,566.33	3.81
4	宝钢股份	62,640,200.00	3.77
5	盐田港 A	58,145,760.00	3.50
6	国电电力	54,095,188.56	3.26
7	申能股份	50,645,000.00	3.05
8	华能国际	46,244,250.00	2.79
9	上海机场	44,320,301.76	2.67
10	鞍钢新轧	39,263,000.00	2.37
	合计	568,127,173.22	34.23

### 四、报告附注

#### (一) 报告项目的计价方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日的收盘价计算,已发行未上市股票采用成本价计算。

(二) 本基金不存在购入成本、期末市值已超过基金资产净值 5%的股票。

(三) 本基金应收交易保证金、应收银行存款利息、应收备付金利息、应收债券利息、应收申购款等应收款项与应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、应付赎回款、预提费用等应付款项合计轧差为贷方余额 36,451,230.25 元,与股票市值 1,106,670,733.80 元、国债及货币资金 562,321,513.64 元,可转换债券投资 27,272,718.40 元相抵减后等于基金资产净值。

(四) 关于报告中股票投资组合的行业分类方法遵照中国证监会于 2001 年 4 月颁布的上市公司行业分类指引执行。

## 第四部分 重要提示事项

一、本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

二、最近 3 年基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。

三、2004 年 1 月 2 日,本公司在有关证券报刊上发布了《富国动态平衡证券投资基金分红预告》,2004 年 1 月 12 日,本公司在有关证券报刊上发布了《富国动态平衡证券投资基金分红公告》,对富国动态平衡证券投资基金持有人分配红利每 10 份基金单位 0.20 元。

四、2004 年 1 月 9 日,本公司在有关证券报刊上发布了《富国基金管理有限公司关于更换基金经理的公告》,更换富国动态平衡证券投资基金基金经理。

五、2003 年 12 月 25 日,本公司关于变更董事长的申请报告经证监会审核通过,并于 2004 年 1 月 14 日在有关证券报刊上发布了《富国基金管理有限公司董事长变更公告》。

六、2004 年 1 月 29 日,本公司迁往新地址办公,并于 2004 年 1 月 30 日在有关证券报刊上发布了《富国基金管理有限公司迁址公告》。

七、《招募说明书》和本公开说明书内容若有不一致之处,以本公开说明书为准。本公开说明书未尽事宜,请查阅《招募说明书》。

特此公告

富国基金管理有限公司  
二 00 四年三月十五日

附：销售机构联系方式

一、富国基金管理有限公司客户服务中心：(021) 53594678。

二、直销机构：本公司的直销机构包括上海投资理财中心和北京投资理财中心。

1、上海投资理财中心地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 13 层 邮政编码：200001  
传真：021 - 63410899 电话：021 - 63410899

2、北京投资理财中心地址：北京市建国门外大街 1 号国贸中心西楼 601 邮政编码：  
100004 传真：010 - 65055977 电话：010 - 65055975

三、代销机构：

代销机构为中国农业银行、上海浦东发展银行、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、华夏证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、招商证券有限公司责任公司。投资者欲知详情请登录公司网站或致电富国客户服务中心。