

富国天益价值证券投资基金 2006年年度报告摘要

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。

基金托管人交通银行股份有限公司(简称：交通银行)根据本基金合同规定，于2007年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

基金名称：富国天益价值证券投资基金
基金简称：富国天益价值
基金代码：100020
运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004年6月15日
报告期末基金份额总额：3,913,982,500.89份
(二) 投资目标：本基金属价值型投资基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票、或与内同类上市公司相比具有更高价值的上市公司的股票。

投资策略：本基金在大类资产配置和行业配置层面，遵循自上而下的积极策略，个股选择层面，遵循自下而上的积极策略。根据基金经理对股票市场变动趋势的判断，决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响。

业绩比较基准：95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
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。

(三) 基金管理人：富国基金管理有限公司
注册地址：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦13.14层
办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5.6层

(四) 基金托管人：交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

(五) 基金选用的信息披露报刊：中国证券报、证券时报
登载年度报告正文的互联网网址：www.fundol.com.cn
基金年度报告备置地点：富国基金管理有限公司上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5.6层

Table with 5 columns: 指标名称, 2006年, 2006年, 2004-6-15至2004-12-31, 2006年. Rows include 1. 基金本期净收益, 2. 期末可供分配基金份额收益, etc.

Table with 5 columns: 期间, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 净值增长率标准差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效以来.



注：截止日期为2006年12月31日。

注：截止日期为2006年12月31日。

注：2004年按实际存续期计算。

Table with 5 columns: 年份, 每10份基金份额分红(元), 备注. Rows include 2004, 2005, 2006, 合计.

三、管理人报告
(一) 基金管理人及基金经理小组情况
1. 基金管理人
富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册。

(二) 基金经理
陈先生，1972年出生，硕士，9年证券从业经历，曾就职于君安证券研究所任研究员。2000年10月加入富国基金管理有限公司，历任研究员、规划部研究员、研究规划部副经理，现兼任总经理助理、研究规划部副经理。

(三) 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释
本基金在报告期内净值增长率为16.75%，同期10份基金份额净值增长1.20元。按照晨星分类，报告期内本基金在79只可比基金中排名第4。

2006年A股市场出现了大幅上行行情，市场热点分散，个股表现活跃。在经历的市场调整后，本基金依旧保持了一贯的积极风格，坚持既定投资策略和严格的选股标准。

(四) 宏观经济、证券市场及行业走势的展望
2007年我们预计市场仍将保持活跃，投资者将面临众多投资机会，但是投资风险也将相伴而生。只有那些能够持续创造股东价值的企业才能在本轮牛市中长期胜出。

四、托管人报告
2006年，交通银行作为富国天益价值证券投资基金的托管人，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议，依法安全保管了基金资产。

基金资产净值和费用计算上进行了认真复核，未发现基金管理人有关基金持有人的利益行为。
2006年，由富国天益价值证券投资基金管理人——富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国天益价值证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

Table with 5 columns: 年初余额, 本年计提, 本年支付, 年末余额. Rows include 年初余额, 本年计提, 本年支付, 年末余额.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 银行存款, 清算备付金, 交易保证金, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 应收股利, 应收利息, 应收申购款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 股票投资市值, 其中: 股权投资成本, 债券投资市值, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 资产合计, 负债及基金持有人权益, 应付证券清算款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 应付赎回款, 应付赎回费, 应付管理人报酬, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 应付托管费, 应付利息, 未交税金, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 卖出回购证券款, 短期融资款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 预提费用, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 基金持有人权益, 未实现利得, 未实现利得, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

Table with 3 columns: 资产, 期末数, 年初数. Rows include 其他应付款, 其他应付款, 其他应付款, etc.

H=0.25%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
B为前一日基金资产净值

B. 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月两个工作日内从基金资产中一次性支取。

Table with 5 columns: 年初余额, 本年计提, 本年支付, 年末余额. Rows include 年初余额, 本年计提, 本年支付, 年末余额.

由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入
本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，并按银行同期利率计息。

Table with 3 columns: 项目, 2006-12-31, 2005-12-31. Rows include 银行存款余额, 项目, 银行存款余额.

(5) 关联方持有基金份额
A. 基金管理人持有的基金份额
本基金的基金管理人于2006年度及2005年度均未持有本基金。

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票名称, 数量(股), 投资成本(元), 期末公允价值(元). Rows include 00086, 582, 200, etc.

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%).