

富国天博创新主题股票型证券投资基金

2009 年第 3 季度报告

2009 年 09 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司（简称  
中国建设银行）

报告送出日期： 2009 年 10 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国天博创新股票
交易代码	前端交易代码：519035 后端交易代码：519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年04月27日
报告期末基金份额总额（单位：份）	11,266,663,625.53
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司，在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上，力争实现资本的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行)

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2009年7月1日到2009年9月30日）
1. 本期已实现收益	646,412,875.89
2. 本期利润	40,064,030.67
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0035
4. 期末基金资产净值	8,858,189,037.29
5. 期末基金份额净值	0.7862

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动

收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.15%	1.86%	-3.50%	1.92%	3.65%	-0.06%

注:过去三个月指2009年7月1日-2009年9月30日

#### 3.2.2 自基金转型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



注:截止日期为2009年9月30日。

本基金于2007年4月27日由原汉博证券投资基金转型而成,建仓期6个月,从2007年4月27日至2007年10月26日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毕天宇	本基金基金经理	2005-11-26	—	10年	硕士，曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理；中国北方工业上海公司处长助理；兴业证券研究员；2002.3至今任富国基金管理有限公司行业研究员，现任富国天博基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统内的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

公司旗下开放式基金（股票型）业绩比较：

项目	净值增长率	业绩比较基准收益率
富国天益价值证券投资基金	1.35%	-4.46%
富国天合稳健优选股票型证券投资基金	1.90%	-3.5%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	0.15%	-3.5%

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009年三季度沪深300指数走出了巨幅振荡的行情，指数从高点3803点一度跌至2795点，振幅高达26%，季度指数下跌5.1%。国家重申严格二套房贷政策，银监会对银行资本充足率的进一步严格要求，宽松宏观经济政策可能将逐步微调的预期，使得市场从季度初期的亢奋逐步走向理性回归。

基于政策面的变化，三季度我们对房地产行业作了适度减持，在3700到3800点附近逐步降低了仓位。由于组合整体偏防守，在医药、食品饮料等行业配置比例偏高，且行业季度表现较好，我们的净值在三季度上涨了0.15%。不过，市场暴涨暴跌和政策面的变化，使得我们没能完成二季度制定的“对部分行业和个股的配置权重过高进行调整”的策略。

我们认为，三季度的调整是对市场短期上涨幅度较大的正常修正，今年年底或明年年初宏观经济政策可能出现的调整也是对宽松经济政策的必要调整，政策变化的出现一定是在经济出现明显好转的前提之下。尽管经济复苏的过程从来都不是一帆风顺的，但我们对经济处于复苏上升通道中是有信心的。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,611,249,556.36	85.70
	其中：股票	7,611,249,556.36	85.70
2	固定收益投资	509,874,268.00	5.74

	其中：债券	509,874,268.00	5.74
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	748,273,922.27	8.43
6	其他资产	11,627,850.54	0.13
7	合计	8,881,025,597.17	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	152,462,945.52	1.72
C	制造业	3,762,845,364.13	42.48
C0	食品、饮料	853,643,301.56	9.64
C1	纺织、服装、皮毛	3,006,891.24	0.03
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	34,050,373.82	0.38
C4	石油、化学、塑胶、塑料	362,925,806.04	4.10
C5	电子	77,703,106.72	0.88
C6	金属、非金属	564,517,886.13	6.37
C7	机械、设备、仪表	1,223,813,622.87	13.82
C8	医药、生物制品	578,525,460.11	6.53
C99	其他制造业	64,658,915.64	0.73
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	34,121,173.76	0.39
F	交通运输、仓储业	2,868,106.06	0.03
G	信息技术业	605,263,800.00	6.83
H	批发和零售贸易	1,016,638,940.03	11.48
I	金融、保险业	1,580,024,861.52	17.84
J	房地产业	356,773,605.96	4.03
K	社会服务业	1,543,886.80	0.02
L	传播与文化产业	72,206,985.72	0.82
M	综合类	26,499,886.86	0.30
	合计	7,611,249,556.36	85.92

## 5.3 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

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	600519	贵州茅台	4,800,000	791,328,000.00	8.93
2	002024	苏宁电器	47,000,000	770,330,000.00	8.70

3	601166	兴业银行	15,000,000	506,850,000.00	5.72
4	000338	潍柴动力	5,808,830	291,603,266.00	3.29
5	601318	中国平安	5,000,000	253,500,000.00	2.86
6	600196	复星医药	15,044,907	239,665,368.51	2.71
7	600585	海螺水泥	5,500,000	236,665,000.00	2.67
8	002007	华兰生物	4,000,000	208,000,000.00	2.35
9	000001	深发展 A	10,000,000	200,100,000.00	2.26
10	000063	中兴通讯	5,000,000	190,900,000.00	2.16

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	60,009,000.00	0.68
2	央行票据	196,580,000.00	2.22
3	金融债券	202,680,000.00	2.29
	其中：政策性金融债	202,680,000.00	2.29
4	企业债券	48,761,000.00	0.55
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	1,844,268.00	0.02
7	其他	—	—
8	合计	509,874,268.00	5.76

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	080404	08 农发 04	1,000,000	100,360,000.00	1.13
2	0901038	09 央行票据 38	1,000,000	98,290,000.00	1.11
3	0901040	09 央行票据 40	1,000,000	98,290,000.00	1.11
4	080308	08 进出 08	500,000	51,400,000.00	0.58
5	020206	02 国开 06	500,000	50,920,000.00	0.57

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.8 投资组合报告附注

##### 5.8.1 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。

根据 2008 年 10 月 7 日中兴通讯股份有限公司（下称中兴通讯）《关于财政

部驻深圳财政监察专员办事处 2007 年会计信息质量检查结论和处理决定的公告》，财政部驻深圳财政监察专员办事处就会计信息质量检查中发现的问题对中兴通讯进行了行政处罚，行政处罚金额为人民币 16 万元整，及要求其公司补缴企业所得税人民币 380 万元整。中兴通讯对 2007 年重要财务指标进行了调整。本基金管理人在投资该股票前严格执行了对该上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等的相关投资决策流程。该处罚事件发生后，经过与该公司沟通其处罚事件的过程、性质，并经进一步的分析、研究，本基金管理人认为，中兴通讯在会计核算方面的问题虽对该公司财务指标产生影响，但未从根本上影响对该公司的投资价值判断。故本基金将继续持有该股票，并对该股票进行持续跟踪、研究。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 5.8.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,559,023.81
2	应收证券清算款	7,003,681.43
3	应收股利	—
4	应收利息	2,420,635.40
5	应收申购款	644,509.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,627,850.54

#### 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	11,803,421,131.21
报告期期间基金总申购份额	53,406,970.53
报告期期间基金总赎回份额	590,164,476.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	11,266,663,625.53

## § 7 影响投资者决策的其他重要信息

根据《证券投资基金法》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》和《创业板市场投资者适当性管理暂行规定》其配套文件及中国证监会基金部函【2009】636号《关于证券投资基金投资创业板上市证券的说明》的相关规定，本基金将参与创业板上市的股票和可转换债券的投资，并严格按照公司制度流程规定进行投资决策和风险管理，同时于2009年9月23日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上做相关公告。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉博证券投资基金的文件
- 2、汉博证券投资基金基金合同
- 3、汉博证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》

- 6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同
- 7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议
- 8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注
- 9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## **8.2 存放地点**

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

## **8.3 查阅方式**

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司  
2009 年 10 月 28 日