

富国天博创新主题股票型证券投资基金

2011 年第 3 季度报告

2011 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

报告送出日期： 2011 年 10 月 26 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 2011 年 10 月 24 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 2011 年 7 月 1 日起至 2011 年 9 月 30 日。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国天博创新股票
基金主代码	519035
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）	8,509,707,721.86
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

## § 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（2011年07月01日-2011年09月30日）
1. 本期已实现收益	-46,642,015.09
2. 本期利润	-988,443,151.58
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1150
4. 期末基金资产净值	6,975,914,999.14
5. 期末基金份额净值	0.8198

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。

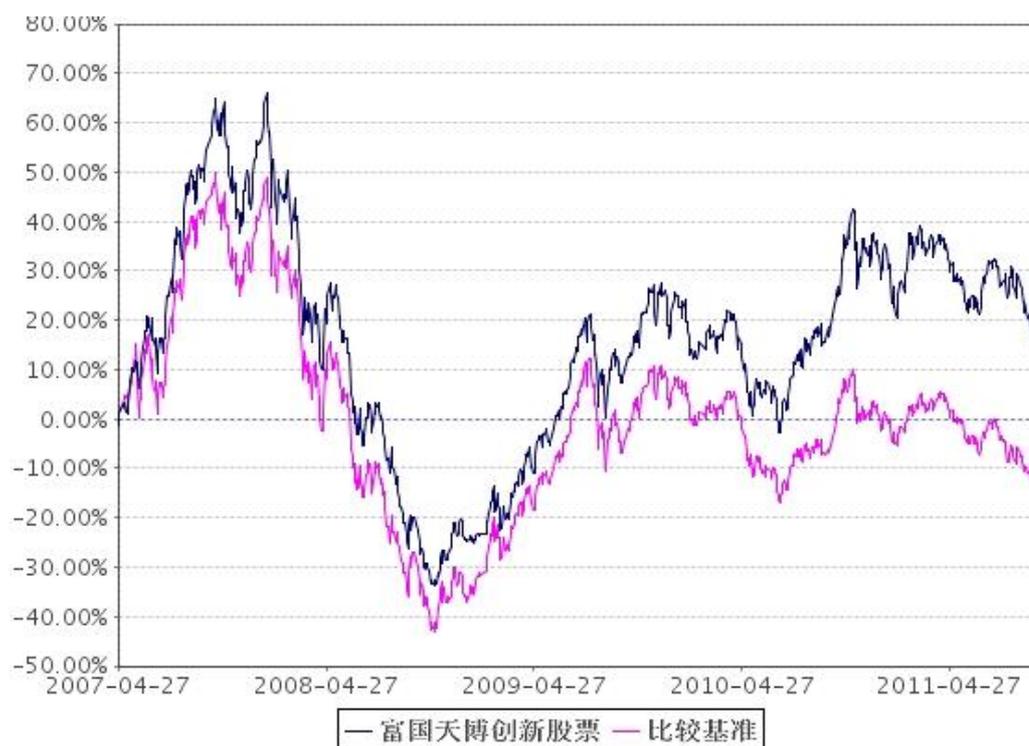
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-12.39%	1.20%	-12.32%	1.06%	-0.07%	0.14%

注:过去三个月指2011年7月1日—2011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2011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	本基金基金经理兼任权益投资副总监	2005-11-26	—	12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经理助理；兴业证券股份有限公司研究员；2002年3月任富国基金管理有限公司行业研究员，2005年11月至今任富国天博基金经理，兼任权益投资副总监。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《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，严格执行交易系统中的公平交易程序，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

公司旗下相似投资风格的开放式基金业绩比较：

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	-11.78%	-14.68%
富国天合稳健优选股票型证券投资基金	-10.95%	-12.32%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	-12.39%	-12.32%
富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金	-12.20%	-12.22%

### 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

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度沪深 300 指数继续下跌 15.2%，同期基金净值下跌 12.39%。

三季度我们整体策略并没有发生太大的变化。由于仓位较高使得组合的净值表现相对较差。行业配置变动不大，仅对部分个股作了调整。

三季度，欧债危机再度深化、地方融资平台悬而未决、温州高利贷泡沫破灭等事件的发生，使得市场再度陷入恐慌。但我们始终认为市场的估值已经充分反应了经济下滑的影响，经济适度放缓，有助于缓解通胀压力，加快国内经济转型。尽管我们无法对市场走势作出准确预判，但我们坚定看好中国经济长期发展潜力。

四季度我们将继续坚持淡化选时、适度均衡、精选个股的投资策略，积极为明年投资机会作准备。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率为-12.39%，业绩比较基准收益率为-12.32%。

## § 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	6,589,439,591.01	93.74
	其中：股票	6,589,439,591.01	93.74
2	固定收益投资	372,858,346.10	5.30
	其中：债券	372,858,346.10	5.30
	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	18,722,923.46	0.27
6	其他资产	48,292,190.64	0.69
7	合计	7,029,313,051.21	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	363,294,217.28	5.21
C	制造业	2,893,990,672.93	41.49
C0	食品、饮料	568,852,744.00	8.15
C1	纺织、服装、皮毛	45,200,000.00	0.65
C2	木材、家具	8,210,080.56	0.12
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	175,561,098.54	2.52
C5	电子	23,986,070.91	0.34
C6	金属、非金属	307,785,030.75	4.41
C7	机械、设备、仪表	1,501,685,648.17	21.53
C8	医药、生物制品	262,710,000.00	3.77
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	55,573,776.72	0.80
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	780,216,558.25	11.18
H	批发和零售贸易	491,336,039.50	7.04
I	金融、保险业	1,209,169,751.01	17.33
J	房地产业	747,258,575.32	10.71
K	社会服务业	48,600,000.00	0.70
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	6,589,439,591.01	94.46

## 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	000581	威孚高科	18,989,869	619,449,526.78	8.88
2	600271	航天信息	19,817,823	535,279,399.23	7.67
3	600519	贵州茅台	2,600,000	495,534,000.00	7.10
4	002024	苏宁电器	43,500,000	452,835,000.00	6.49
5	600031	三一重工	30,000,000	432,300,000.00	6.20
6	000718	苏宁环球	60,000,000	414,000,000.00	5.93
7	601166	兴业银行	30,000,000	371,700,000.00	5.33

8	600036	招商银行	21,000,000	232,260,000.00	3.33
9	000338	潍柴动力	5,800,000	216,108,000.00	3.10
10	601601	中国太保	10,000,076	184,901,405.24	2.65

#### 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	164,041,744.60	2.35
2	央行票据	202,937,000.00	2.91
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	5,879,601.50	0.08
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	372,858,346.10	5.34

#### 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	010112	21 国债(12)	1,637,470	164,041,744.60	2.35
2	1101016	11 央行票据 16	1,100,000	106,337,000.00	1.52
3	1101022	11 央行票据 22	1,000,000	96,600,000.00	1.38
4	122883	10 楚雄债	76,210	5,879,601.50	0.08

#### 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。

报告期内本基金投资的前十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	1,402,638.78
2	应收证券清算款	38,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	8,247,370.05
5	应收申购款	642,181.81
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	48,292,190.64

### 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	8,721,514,852.43
报告期期间基金总申购份额	31,308,011.53
减：报告期期间基金总赎回份额	243,115,142.10
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	8,509,707,721.86

## § 7 备查文件目录

### 7.1 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

### 7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

### 7.3 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  
2011 年 10 月 26 日