

富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

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： 中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国天瑞强势混合
基金主代码	100022
交易代码	前端交易代码：100022 后端交易代码：100023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年04月05日
报告期末基金份额总额（单位：份）	7,271,488,062.92
投资目标	本基金主要投资于强势地区（区域经济发展较快、已经形成一定产群规模且居民购买力较强）具有较强竞争力、经营管理稳健、诚信、业绩优良的上市公司的股票。本基金遵循“风险调整后收益最大化”原则，通过“自上而下”的积极投资策略，在合理运用金融工程技术的基础上，动态调整投资组合比例，注重基金资产安全，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判宏观经济状况、资本市场运行特征的前提下，以强势地区内单个证券的投资价值评判为核心，追求投资组合流动性、赢利性、安全性的中长期有效结合。
业绩比较基准	上证A股指数收益率×70%+上证国债指数收益率×25%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于强势地区中定价合理且具有成长潜力的优质股票，属于中度风险的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长，实现较高的超额收益。
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	-23,346,464.11
2. 本期利润	-706,203,032.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0965
4. 期末基金资产净值	5,166,594,567.59
5. 期末基金份额净值	0.7105

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。

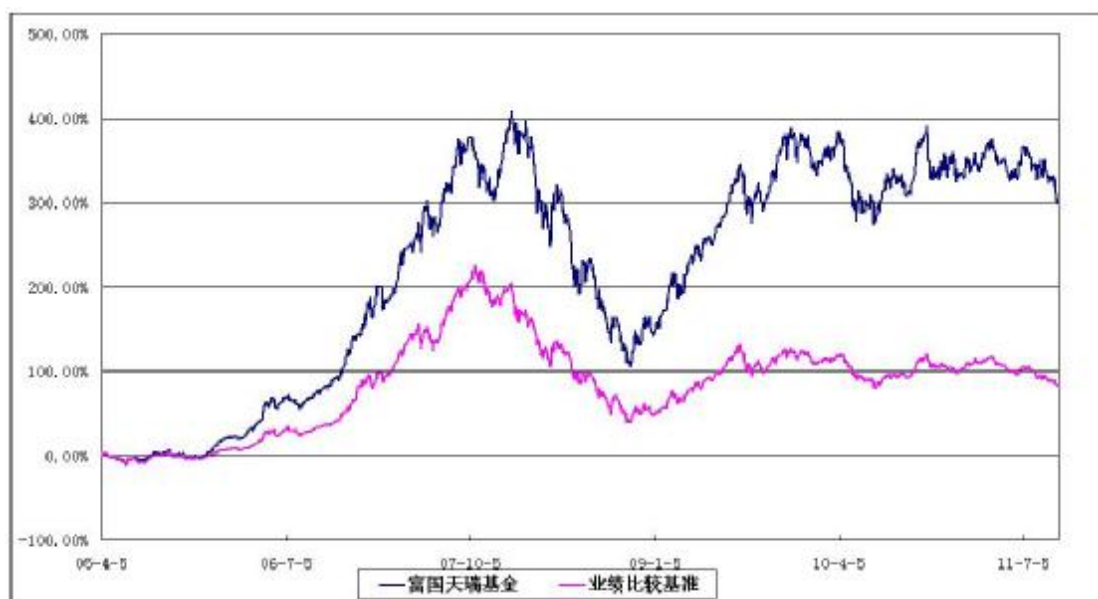
### 3.2 基金净值表现

#### 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3个月	-11.98%	1.30%	-10.14%	0.85%	-1.84%	0.45%

注：过去三个月指2011年7月1日—2011年9月30日

#### 3.2.2 自基金合同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



注：1. 截止日期为 2011 年 9 月 30 日。

2. 本基金于 2005 年 4 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2005 年 4 月 5 日至 2005 年 10 月 4 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 2008 年 1 月 17 日拆分，规模急剧扩大，建仓期 3 个月，从 2008 年 1 月 22 日至 2008 年 4 月 21 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		
宋小龙	本基金基金经理兼任权益投资总监。	2007-06-15	—	13 年	硕士，曾任北京北大青鸟有限责任公司项目经理；1999 年任富国基金管理有限公司信息技术部项目经理、研究部行业研究员、高级研究员，2006 年 11 月至 2008 年 11 月任汉鼎基金经理；2008 年 11 月至 2010 年 1 月任富国天鼎基金经理；2010 年 5 月至 2011 年 8 月任富国通胀通缩主题股票基金经理；2007 年 6 月至今任富国天瑞基金经理；兼任权益投资总监。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瑞强势地区精选混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天瑞强势地区精选混合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
富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金	-11.98%	-10.14%
富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）	-8.55%	-10.70%

### 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

2011年第三季度，国内货币政策进入观察期，但紧缩态势依然维持；国际主权债务危机则是愈演愈烈，对中国经济的实质性影响姑且不论，但对“胸怀天下”的中国股票投资者心理产生了极其巨大的负面影响。内忧外困，风雨飘摇，中国股票市场全面调整。本基金战略性配置地产、金融等大市值行业，受整体市场下跌的影响，净值表现差强人意。

本基金感谢投资者的信任和支持，我们将勤勉尽责，坚持价值投资理念，努力把握行业、公司和市场机会，争取为投资者创造更大的收益。

#### 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-11.98%，业绩比较基准收益率为-10.14%。

### § 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	4,853,602,491.43	93.68
	其中：股票	4,853,602,491.43	93.68
2	固定收益投资	302,038,000.00	5.83
	其中：债券	302,038,000.00	5.83
	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	13,362,904.34	0.26
6	其他资产	12,063,314.15	0.23
7	合计	5,181,066,709.92	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	238,734,631.35	4.62
C	制造业	990,284,244.04	19.17
C0	食品、饮料	4,192,032.48	0.08
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	48,843,214.20	0.95
C5	电子	2,979,669.18	0.06
C6	金属、非金属	244,642,624.00	4.74
C7	机械、设备、仪表	628,641,849.73	12.17
C8	医药、生物制品	8,106,446.35	0.16
C99	其他制造业	52,878,408.10	1.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,455,825.15	0.03
E	建筑业	64,460,061.00	1.25
F	交通运输、仓储业	14,014,543.35	0.27
G	信息技术业	319,134,861.35	6.18
H	批发和零售贸易	164,598,357.78	3.19
I	金融、保险业	1,022,091,747.14	19.78

J	房地产业	1,823,328,836.48	35.29
K	社会服务业	215,499,383.79	4.17
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	4,853,602,491.43	93.94

### 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	000001	深发展A	30,591,494	490,687,563.76	9.50
2	600048	保利地产	48,812,771	451,518,131.75	8.74
3	000625	长安汽车	79,961,848	344,635,564.88	6.67
4	000002	万科A	44,431,248	321,682,235.52	6.23
5	600383	金地集团	63,348,535	308,507,365.45	5.97
6	000024	招商地产	17,099,671	286,248,492.54	5.54
7	600271	航天信息	10,567,635	285,431,821.35	5.52
8	601601	中国太保	10,721,990	198,249,595.10	3.84
9	601001	大同煤业	10,642,021	173,358,522.09	3.36
10	600686	金龙汽车	22,015,734	162,916,431.60	3.15

### 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	199,320,000.00	3.86
2	央行票据	48,840,000.00	0.95
3	金融债券	50,005,000.00	0.97
	其中：政策性金融债	50,005,000.00	0.97
4	企业债券	3,873,000.00	0.07
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	302,038,000.00	5.85

### 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	110009	11 付息国债 09	2,000,000	199,320,000.00	3.86
2	010215	01 国开 15	500,000	50,005,000.00	0.97
3	1001092	10 央行票据 92	500,000	48,840,000.00	0.95
4	122875	10 红投 02	50,000	3,873,000.00	0.07

### 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	2,892,605.83
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	125,581.22
4	应收利息	5,998,308.91
5	应收申购款	3,046,818.19
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,063,314.15

### 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	7,254,521,816.52
报告期期间基金总申购份额	385,820,262.78
减：报告期期间基金总赎回份额	368,854,016.38
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	7,271,488,062.92

## § 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富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金的文件
- 2、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金合同
- 3、富国天瑞强势地区精选混合型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、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、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