# 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9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<br>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。

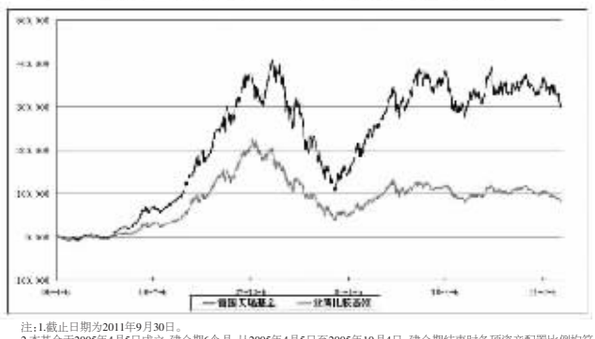
3.2 基金净值表现

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遵规守信情况说明

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) | -8.56% | -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附息国债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报告期未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

# 汉盛证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9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 | 富国汉盛封闭 |
| 基金主代码 | 500005 |
| 交易代码 | 500005 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999年05月10日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 2,000,000,000.00 |
| 投资目标 | 为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | "精选品种、组合投资、长线持有、波段操作",通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴,同时依据"顺势而为"的原则进行一些短线操作。 |
| 业绩比较基准 | 无 |
| 风险收益特征 | 无 |
| 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 | 31,173,279.18 |
| 2.本期利润 | -193,021,402.00 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0965 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,192,370,951.08 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0962 |

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,封闭式基金交易佣金等),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。

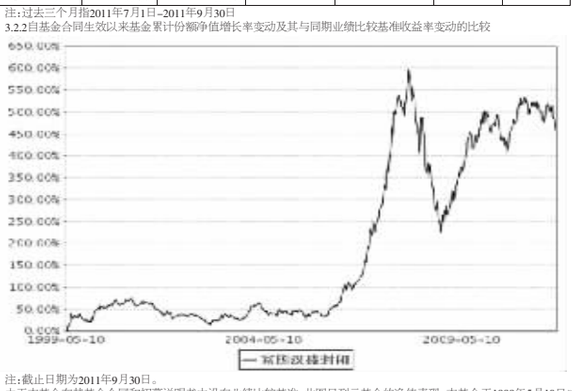
3.2 基金净值表现

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 | -8.09% | 1.61% | - | - | - | - |

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:截止日期为2011年9月30日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此图只列示基金的净值表现。本基金于1999年5月10日成立,建仓期6个月,从1999年5月10日至1999年11月9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 | | |
| 贺轶 | 本基金基金经理 | 2010-01-13 | - | 10年 | 硕士,曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员;中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员;中银基金管理有限公司投资部助理副总裁;汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理、基金经理;富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师;2010年1月至今任汉盛基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。 |

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为汉盛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》、《汉盛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,无损害基金份额持有人利益的行为,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

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

-

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3季度A股市场在国外债务危机冲击和国内经济下滑、通胀高企、政策放松预期落空等因素的影响下继续向下调整。

2011年3季度,本基金根据宏观经济和市场状况对权益类资产的配置比例进行了动态调整,行业配置方面的操作主要是加大了业绩增长受经济下滑的影响相对较小、增长稳定和具有相对估值优势的行业,降低了受需求下滑负面影响较大的行业的配置比例。展望未来,本基金将继续以城镇化和经济结构转型等作为未来的投资主线。

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-8.09%。

### §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 | 1,590,997,451.84 | 72.33 |
| | 其中:股票 | 1,590,997,451.84 | 72.33 |
| 2 | 固定收益投资 | 508,437,860.57 | 23.11 |
| | 其中:债券 | 508,437,860.57 | 23.11 |
| | 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 | 93,534,293.64 | 4.25 |
| 6 | 其他资产 | 6,778,601.14 | 0.31 |
| 7 | 合计 | 2,199,748,207.19 | 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 | 18,308,127.80 | 0.84 |
| B | 采掘业 | 68,795,717.86 | 3.14 |
| C | 制造业 | 689,443,854.79 | 31.45 |
| C0 | 食品、饮料 | 202,189,507.30 | 9.22 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 47,597,112.66 | 2.17 |
| C2 | 木材、家具 | 7,589,336.00 | 0.35 |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 54,303,192.51 | 2.48 |
| C5 | 电子 | 28,145,833.77 | 1.28 |
| C6 | 金属、非金属 | 42,507,705.60 | 1.94 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 216,737,269.78 | 9.89 |
| C8 | 医药、生物制品 | 90,373,897.17 | 4.12 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 19,089,983.40 | 0.87 |
| E | 建筑业 | 54,106,893.54 | 2.47 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 153,127,647.06 | 6.98 |
| H | 批发和零售贸易 | 141,284,652.99 | 6.44 |
| I | 金融、保险业 | 242,135,302.77 | 11.04 |
| J | 房地产业 | 163,337,551.33 | 7.45 |
| K | 社会服务业 | 19,087,320.30 | 0.87 |
| L | 传播与文化产业 | 22,280,400.00 | 1.02 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,590,997,451.84 | 72.57 |

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 | 343,600 | 65,486,724.00 | 2.99 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 6,782,860 | 57,925,624.40 | 2.64 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 9,660,000 | 53,323,200.00 | 2.43 |
| 4 | 601669 | 中国水电 | 10,313,610 | 46,411,245.00 | 2.12 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 4,183,924 | 46,274,199.44 | 2.11 |
| 6 | 000002 | 万 科A | 6,277,834 | 45,451,518.16 | 2.07 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 4,817,961 | 44,566,139.25 | 2.03 |
| 8 | 600271 | 航天信息 | 1,612,500 | 43,553,625.00 | 1.99 |
| 9 | 600132 | 重庆啤酒 | 676,231 | 42,467,306.80 | 1.94 |
| 10 | 000656 | 金科股份 | 3,283,238 | 40,055,503.60 | 1.83 |

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 | 238,801,061.40 | 10.89 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 267,221,000.00 | 12.19 |
| | 其中:政策性金融债 | 267,221,000.00 | 12.19 |
| 4 | 企业债券 | 947,511.00 | 0.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 1,468,288.17 | 0.07 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 508,437,860.57 | 23.19 |

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 | 010203 | 02国债(3) | 1,070,000 | 107,267,500.00 | 4.89 |
| 2 | 110242 | 11国开42 | 1,000,000 | 99,970,000.00 | 4.56 |
| 3 | 019118 | 11国债18 | 700,000 | 70,000,000.00 | 3.19 |
| 4 | 110234 | 11国开34 | 700,000 | 69,321,000.00 | 3.16 |
| 5 | 010112 | 21国债(2) | 614,230 | 61,533,561.40 | 2.81 |

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 | 572,590.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,374,660.04 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 24.36 |
| 7 | 待摊费用 | 831,326.03 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,778,601.14 |

5.8.4报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 1,194,894.70 | 0.05 |
| 2 | 126729 | 燕京转债 | 273,393.47 | 0.01 |

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601669 | 中国水电 | 46,411,245.00 | 2.12 | 新股认购 |

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 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的封闭式基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入总份额 | - |
| 报告期期间卖出总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的封闭式基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%) | 0.50 |

### §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盛基金的文件

2、汉盛证券投资基金基金合同

3、汉盛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、汉盛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

# 富国天盈分级债券型证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30日

**基金管理人:富国基金管理有限公司**
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国工商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日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 富国天盈分级债券 | |
| 基金主代码 | 161015 | |
| 基金运作方式 | 契约型基金。本基金(《基金合同》)生效之日起3年内,天盈A自(《基金合同》)生效之日起每满6个月开放一次,天盈B封闭运作并上市交易;本基金(《基金合同》)生效后3年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。 | |
| 基金合同生效日 | 2011年05月23日 | |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 3,504,716,032.32 | |
| 投资目标 | 在追求基金资产长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。 | |
| 业绩比较基准 | 中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。 | |
| 风险收益特征 | 从基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 富国天盈分级债券A | 富国天盈分级债券封闭B |
| 下属两级基金的交易代码 | 161016 | 150041 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份) | 2,453,236,683.91 | 1,051,479,348.41 |
| 下属两级基金的风险收益特征 | 天盈A份额表现出低风险、收益相对稳定的特征 | 天盈B份额表现出较高风险、收益相对较高的特征。 |

### §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 | 28,340,894.41 |
| 2.本期利润 | -19,524,128.14 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0056 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,496,773,848.50 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.998 |

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 | -0.50% | 0.13% | 0.31% | 0.09% | -0.81% | 0.04% |

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:截止日期为2011年9月30日。

本基金合同生效日为2011年5月23日,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月,即从2011年5月23日起至2011年11月22日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

3.3 其他指标

单位:人民币元

| 其他指标 | 报告期末(2011年09月30日) |
|---|---|
| 富国天盈分级债券A与富国天盈分级债券封闭B基金份额配比 | 7:3 |
| 期末富国天盈分级债券A份额参考净值 | 1.016 |
| 期末富国天盈分级债券A份额累计参考净值 | 1.016 |
| 期末富国天盈分级债券封闭B份额参考净值 | 0.955 |
| 期末富国天盈分级债券封闭B份额累计参考净值 | 0.955 |
| 富国天盈分级债券A的预计年收益率 | 4.55% |

### §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 | | |
| 刁羽 | 本基金基金经理兼任富国天时货币市场基金基金经理、富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理 | 2011-05-23 | - | 5年 | 博士,曾任国泰君安证券股份有限公司固定收益部研究员、交易员,浦银安盛基金管理有限公司基金经理助理,2009年6月任富国基金管理有限公司富国天时货币市场基金基金经理助理,2010年6月至今任富国天时货币市场基金基金经理,2010年11月起兼任富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理,2011年5月起兼任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。 |
| 赵恒毅 | 本基金基金经理 | 2011-05-24 | - | 7年 | 硕士,曾任通用技术集团投资管理有限公司研究员,2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司固定收益部研究员,2011年5月至今任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。 |

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国天盈分级债券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》、《富国天盈分级债券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