

富国天博创新主题股票型证券投资基金

2012 年第 2 季度报告

2012 年 06 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： 2012 年 07 月 20 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 2012 年 7 月 18 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 2012 年 4 月 1 日起至 2012 年 6 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）	8,183,920,248.78
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（2012年04月01日-2012年06月30日）
1. 本期已实现收益	-9,435,122.82
2. 本期利润	153,157,567.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0186
4. 期末基金资产净值	6,384,048,011.43
5. 期末基金份额净值	0.7801

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。

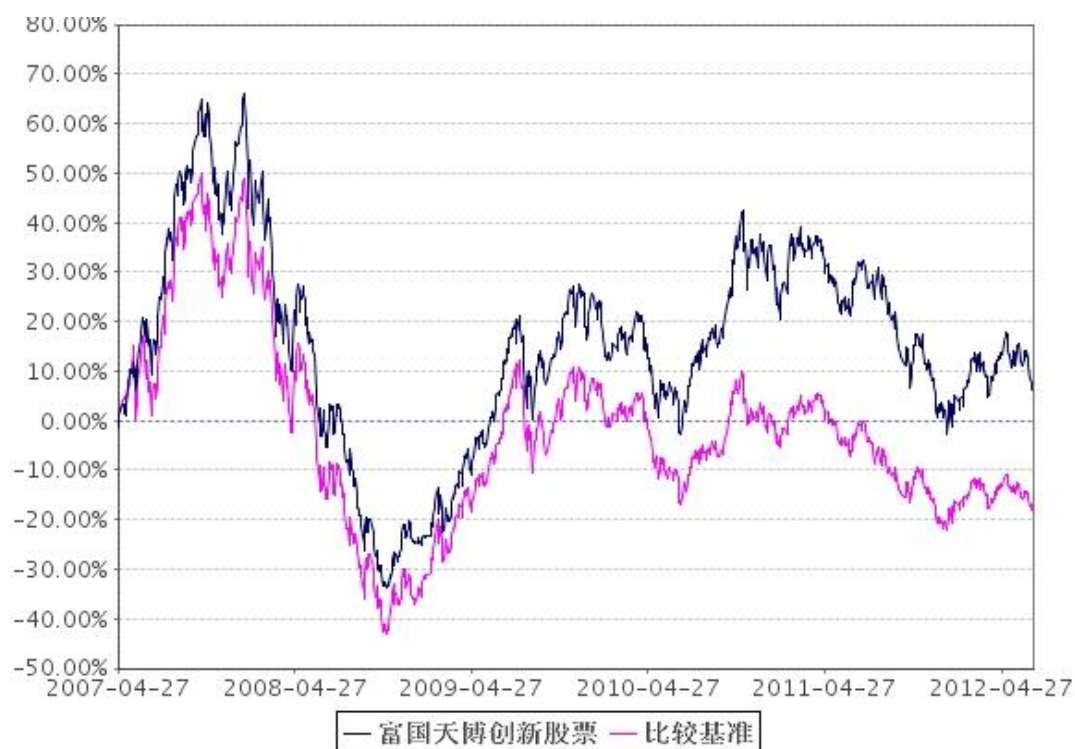
3.2 基金净值表现

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	2.36%	1.17%	0.53%	0.87%	1.83%	0.30%

注:过去三个月指2012年4月1日-2012年6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2012年6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	—	13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，确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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限

进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 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。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

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

二季度股市冲高回落。尽管二季度经济低于市场预期，但稳增长政策推出的时机和力度也超市场预期，沪深 300 指数最高涨幅达 10.4%。而随后欧债危机的再度来袭，对于国家政策力度不够可能导致硬着陆的担心又起，指数最终仅上涨 0.27%。同期基金净值上涨 2.36%。

整个二季度我们继续维持前期策略，行业配置和个股变化不大。但重仓个股表现差异较大，组合收益表现相对同类基金表现一般。

虽然上半年经济运行实际情况低于预期，我们对下半年的经济并不悲观，继续看好股市表现。主要原因在于目前CPI快速下滑，加大了政府稳增长的空间。房地产行业回暖，表明市场刚性需求旺盛，中国经济潜力巨大。

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2.36%，业绩比较基准收益率为0.53%。

§ 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	5,983,237,983.06	93.52
	其中：股票	5,983,237,983.06	93.52
2	固定收益投资	387,596,000.00	6.06
	其中：债券	387,596,000.00	6.06
	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	16,058,742.40	0.25
6	其他资产	10,957,371.69	0.17
7	合计	6,397,850,097.15	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	333,640,240.49	5.23
C	制造业	2,831,283,018.37	44.35
C0	食品、饮料	623,793,266.00	9.77
C1	纺织、服装、皮毛	45,500,000.00	0.71
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	29,814,807.37	0.47
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	400,087,913.70	6.27
C7	机械、设备、仪表	1,541,493,171.59	24.15
C8	医药、生物制品	190,593,859.71	2.99

C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	370,350.00	0.01
F	交通运输、仓储业	25,305,548.29	0.40
G	信息技术业	349,391,666.50	5.47
H	批发和零售贸易	456,689,216.92	7.15
I	金融、保险业	966,969,491.66	15.15
J	房地产业	972,265,329.79	15.23
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	37,993,932.75	0.60
M	综合类	9,329,188.29	0.15
	合计	5,983,237,983.06	93.72

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	2,600,000	621,790,000.00	9.74
2	000581	威孚高科	21,600,000	591,840,000.00	9.27
3	000718	苏宁环球	61,807,000	500,636,700.00	7.84
4	600031	三一重工	32,049,996	446,135,944.32	6.99
5	002024	苏宁电器	50,000,000	419,500,000.00	6.57
6	601166	兴业银行	30,000,000	389,400,000.00	6.10
7	000024	招商地产	10,011,118	245,572,724.54	3.85
8	601318	中国平安	5,000,000	228,700,000.00	3.58
9	600271	航天信息	11,800,000	223,138,000.00	3.50
10	600036	招商银行	15,000,000	163,800,000.00	2.57

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	149,620,000.00	2.34
2	央行票据	58,146,000.00	0.91
3	金融债券	150,415,000.00	2.36
	其中：政策性金融债	150,415,000.00	2.36
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	29,415,000.00	0.46
8	其他	—	—
9	合计	387,596,000.00	6.07

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	019120	11 国债 20	1,000,000	100,500,000.00	1.57
2	110414	11 农发 14	1,000,000	100,180,000.00	1.57
3	1101088	11 央行票据 88	600,000	58,146,000.00	0.91
4	120405	12 农发 05	500,000	50,235,000.00	0.79
5	020051	12 贴债 01	500,000	49,120,000.00	0.77

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。

本期，本基金持有的苏宁环球于 2011 年 12 月 27 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，因公司涉嫌信息披露违规被立案调查。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余九名证券的发行主体本期未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。

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	787,800.60
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	1,228,500.00
4	应收利息	8,639,106.65
5	应收申购款	301,964.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	10,957,371.69
---	----	---------------

5.8.4 报告期末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	113001	中行转债	19,424,000.00	0.30
2	110015	石化转债	9,991,000.00	0.16

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	8,292,273,207.86
报告期期间基金总申购份额	46,099,142.00
减：报告期期间基金总赎回份额	154,452,101.08
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	8,183,920,248.78

§ 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
2012 年 07 月 20 日