# 富国天时货币市场基金

## 2009年第三季度报告

2009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(简称：中国农业银行) 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。

基金托管人中国农业银行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 | 富国天时 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2006年 06 月 05 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,150,618,463.28 | |
| 投资目标 | 在充分重视本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。 | |
| 投资策略 | 本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团(BMO Financial Group)的投资管理经验及技能，结合国内市场的特征，应用"富国 FIPS-MMF 系统(Fixed Income Portfolio System-Money Market Fund)"，构建优质组合。<br>在投资管理过程中，本基金管理人将基于"定性与定量相结合、保守与积极相结合"的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率(税前)。 | |
| 风险收益特征 | 本基金属于风险较低、收益稳定、流动性较高的证券投资基金品种，但并不意味着投资本基金不承担任何风险。 | |
| 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<br>(简称：中国农业银行) | |
| 下属两级基金的简称 | 富国天时 A 级 | 富国天时 B 级 |
| 下属两级基金的交易代码 | 100025 | 100028 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 417,454,473.74 | 733,163,989.54 |

### §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 | A级<br>(2009 年 07 月 01 日到 2009 年 09 月 30 日) | B级<br>(2009 年 07 月 01 日到 2009 年 09 月 30 日) |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,890,637.43 | 2,771,922.56 |
| 2.本期利润 | 1,890,637.43 | 2,771,922.56 |
| 3.期末基金资产净值 | 417,454,473.74 | 733,163,989.54 |

注：所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.基金净值表现

3.2.1.本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1）A 级

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.3418% | 0.0043% | 0.0920% | 0.0000% | 0.2498% | 0.0043% |

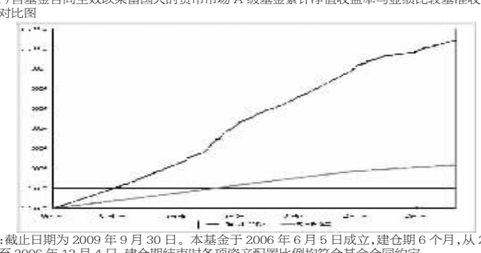
（2）B 级

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.4029% | 0.0043% | 0.0920% | 0.0000% | 0.3109% | 0.0043% |

注：过去三个月指 2009 年 07 月 01 日－2009 年 09 月 30 日

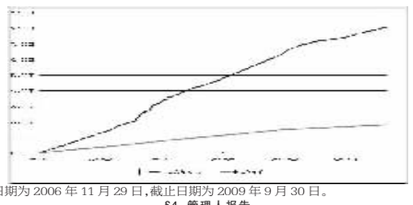
3.2.2.自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（1）自基金合同生效以来富国天时货币市场 A 级基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为 2009 年 9 月 30 日。本基金于 2006 年 6 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2006 年 6 月 5 日至 2006 年 12 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。

（2）自基金分级以来富国天时货币市场 B 级基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：起始日期为 2006 年 11 月 29 日，截止日期为 2009 年 9 月 30 日。

### §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 | | |
| 杨贵宾 | 本基金基金经理兼任富国天利增长债券投资基金基金经理。 | 2009-03-03 | - | 5年 | 博士，2005 年 9 月至今任富国基金管理有限公司债券研究员、策略分析师。现任富国天时基金经理、富国天利基金经理。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时货币市场基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天时货币市场基金基金合同》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

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

三季度市场对经济趋好预期比较明显，同时对通胀的担忧也有所增强。上述两点在货币市场上的突出体现就是一年期央票利率在 7 月初到 8 月上中旬以几乎每周 5 个点的幅度抬升，一直到 8 月下旬才有所企稳，基准利率这种上行态势导致其他货币产品的发行利率、二级市场利率都不断上行；同时，本季度新股开闸也导致回购利率脉冲式的升高和降低。

本季，基金管理人坚持严格按照基金合同进行投资管理，在低利率环境下，为了兼顾基金资产的安全性、流动性和收益性。操作上主要是当央票有所企稳后，主动加大短融的配置，并通过频繁交易不断实现收益；在短融的选择上，坚持收益风险相匹配；在新股申购缴款回购利率脉冲式冲高时，适时进行逆回购操作。

本季基金资产主要配置在短期融资券上，为基金持有人获取稳定收益。

### §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 | 固定收益投资 | 308,779,503.29 | 26.78 |
| | 其中：债券 | 308,779,503.29 | 26.78 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 151,700,000.00 | 13.16 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 691,180,528.90 | 59.95 |
| 4 | 其他资产 | 1,216,906.60 | 0.11 |
| 5 | 合计 | 1,152,876,938.79 | 100.00 |

5.2.报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：本基金本报告期未进行债券回购融资。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本基金本报告期未进行债券回购融资。

5.3.基金投资组合平均剩余期限

5.3.1.投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 82 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 124 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 31 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。

5.3.2.报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 73.25 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60 天 | 1.75 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90 天 | 1.68 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.68 | - |
| 4 | 90天(含)—180 天 | 1.68 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.68 | - |
| 5 | 180天(含)—397 天(含) | 21.73 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 100.09 | - |

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 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 38,721,954.77 | 3.37 |
| 5 | 企业短期融资券 | 270,057,548.52 | 23.47 |
| 6 | 其他 | - | - |
| 7 | 合计 | 308,779,503.29 | 26.84 |
| 8 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 38,721,954.77 | 3.37 |

5.5.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 0981179 | 09大亚 CP01 | 500,000.00 | 50,000,000.00 | 4.35 |
| 2 | 0981174 | 09宏旺 CP01 | 500,000.00 | 49,950,812.90 | 4.34 |
| 3 | 0981159 | 09天音 CP02 | 300,000.00 | 30,009,865.38 | 2.61 |
| 4 | 0981161 | 09超声 CP01 | 300,000.00 | 30,008,830.18 | 2.61 |
| 5 | 0981172 | 09铁二投 CP02 | 300,000.00 | 30,002,243.18 | 2.61 |
| 6 | 0981180 | 09外高桥 CP01 | 300,000.00 | 30,000,000.00 | 2.61 |
| 7 | 0881237 | 08华侨城 CP02 | 200,000.00 | 20,080,593.06 | 1.75 |
| 8 | 0981163 | 09太极 CP01 | 200,000.00 | 20,005,203.82 | 1.74 |
| 9 | 068007 | 06首都机场债 | 200,000.00 | 19,371,410.92 | 1.68 |
| 10 | 058031 | 05中信债 1 | 200,000.00 | 19,350,543.85 | 1.68 |

5.6.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1075% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0243% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0678% |

注：以上数据按工作日统计

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。

5.8.投资组合报告附注

5.8.1.基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

5.8.2.本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的声明

本报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20％的情况。

5.8.3.声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。

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4.其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 1,216,906.60 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,216,906.60 |

5.8.5.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

| 项目 | A级 | B级 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 829,110,620.52 | 773,383,918.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,091,707,684.69 | 1,660,150,900.52 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 1,503,363,831.47 | 1,700,370,829.35 |
| 报告期期末基金份额总额 | 417,454,473.74 | 733,163,989.54 |

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

### §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时货币市场基金的文件

2、富国天时货币市场基金基金合同

3、富国天时货币市场基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国天时货币市场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

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 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

2009 年 10 月 28 日

# 富国天益价值证券投资基金

## 2009年第三季度报告

2009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：交通银行股份有限公司 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。

基金托管人交通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 | 富国天益价值股票 |
| 交易代码 | 前端交易代码：100020<br>后端交易代码：100021 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年 06 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额(单位：份) | 14,202,931,771.76 |
| 投资目标 | 本基金属价值型基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票，或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的投资策略，本基金在大类资产配置和行业配置层面，遵循自上而下的积极策略，个股选择层面，遵循自下而上的积极策略，根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断，决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响，最大限度地确保基金资产的安全，本基金的股票选择，主要采取价值型选股策略，以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种，并确保基金的股票组合满足以下条件：<br>(1)市净率 P/B 低于市场平均水平；<br>(2)组合中 70%以上的个股的动态市盈率低于市场平均水平。 |
| 业绩比较基准 | 95%的中信标普 300 指数+5%的中信国债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为价值型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

### §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(2009 年 7 月 1 日到 2009 年 9 月 30 日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -346,534,654.32 |
| 2.本期利润 | 206,090,116.93 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0140 |
| 4.期末基金资产净值 | 11,951,258,153.57 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.8415 |

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。

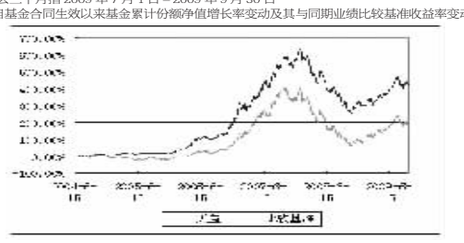
3.2 基金净值表现

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 | 1.35% | 1.66% | -4.46% | 2.28% | 5.81% | -0.62% |

注：过去三个月指 2009 年 7 月 1 日－2009 年 9 月 30 日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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。

### §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 | | |
| 陈戈 | 本基金基金经理兼任公司副总经理、权益投资部总经理。 | 2005-04-13 | - | 13年 | 硕士，曾任君安证券(深圳)资深研究员；2000.10 至今任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管、研究策划部经理、总经理助理。现任公司副总经理兼任权益投资部总经理、富国天益基金经理。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

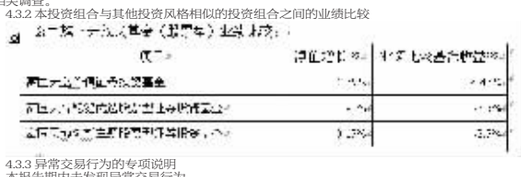
本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天益价值证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天益价值证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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



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，A 股市场出现一轮深幅回调。我们认为，经过上半年市场的单边大幅上扬之后，市场投机气氛高涨，非理性泡沫在积累到一定程度后，市场出现调整是正常的，也是健康的。在中国经济复苏形势已经比较明朗的大背景下，市场下跌空间有限。

展望未来，我们认为，全球经济正在逐步企稳回升，中国宏观经济的快速复苏趋势将会持续，A 股市场在经过震荡调整之后，仍将保持上升趋势。但市场风格可能将会有所转变，行业和个股的上涨将逐步由流动性推动和预期推动逐步向业绩趋动转变。

展望未来，经过一轮下跌和调整，市场风险得到了较大释放。我们将积极通过精选个股，优化组合，为投资者获取更好的回报。

### §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 | 9,514,338,493.96 | 79.10 |
| | 其中：股票 | 9,514,338,493.96 | 79.10 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,104,530,969.80 | 9.18 |
| | 其中：债券 | 1,104,530,969.80 | 9.18 |
| | 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 | 1,383,673,015.88 | 11.50 |
| 6 | 其他资产 | 26,237,160.28 | 0.22 |
| 7 | 合计 | 12,028,779,639.92 | 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 | 554,710,309.59 | 4.64 |
| C | 制造业 | 4,036,463,351.62 | 33.77 |
| C0 | 食品、饮料 | 1,581,310,815.92 | 13.23 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 3,584,595.84 | 0.03 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 889,148.16 | 0.01 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 477,934,042.24 | 4.00 |
| C5 | 电子 | 57,163,270.35 | 0.48 |
| C6 | 金属、非金属 | 465,168,462.72 | 3.89 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 766,632,707.23 | 6.41 |
| C8 | 医药、生物制品 | 664,719,294.52 | 5.56 |
| C99 | 其他制造业 | 19,061,014.64 | 0.16 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 110,904,037.88 | 0.93 |
| E | 建筑业 | 52,364,669.28 | 0.44 |
| F | 交通运输、仓储业 | 131,582,243.89 | 1.10 |
| G | 信息技术业 | 1,161,576,060.26 | 9.72 |
| H | 批发和零售贸易 | 1,280,171,052.29 | 10.71 |
| I | 金融、保险业 | 1,641,457,716.31 | 13.73 |
| J | 房地产业 | 238,764,751.37 | 2.00 |
| K | 社会服务业 | 48,586,669.01 | 0.41 |
| L | 传播与文化产业 | 18,918.00 | 0.00 |
| M | 综合类 | 257,738,714.46 | 2.16 |
| 合计 | | 9,514,338,493.96 | 79.61 |

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 | 7,205,600 | 1,187,915,216.00 | 9.94 |
| 2 | 002024 | 苏宁电器 | 67,017,736 | 1,098,420,693.04 | 9.19 |
| 3 | 002028 | 思源电气 | 21,061,862 | 513,488,195.56 | 4.30 |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 69,799,897 | 443,229,345.95 | 3.71 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 7,980,000 | 404,586,000.00 | 3.39 |
| 6 | 600271 | 航天信息 | 19,756,192 | 306,813,661.76 | 2.57 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 9,000,000 | 304,110,000.00 | 2.54 |
| 8 | 002153 | 石基信息 | 9,240,950 | 281,848,975.00 | 2.36 |
| 9 | 601169 | 北京银行 | 15,780,000 | 271,889,400.00 | 2.27 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 10,580,000 | 235,616,600.00 | 1.97 |

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 | 325,820,239.20 | 2.73 |
| 2 | 央行票据 | 398,430,000.00 | 3.33 |
| 3 | 金融债券 | 376,461,000.00 | 3.15 |
| | 其中：政策性金融债 | 376,461,000.00 | 3.15 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 3,819,730.60 | 0.03 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,104,530,969.80 | 9.24 |

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 | 070422 | 07农发 22 | 2,000,000 | 211,960,000.00 | 1.77 |
| 2 | 010203 | 02国债(3) | 2,020,080 | 204,533,100.00 | 1.71 |
| 3 | 0901038 | 09央行票据 38 | 2,000,000 | 196,580,000.00 | 1.64 |
| 4 | 010004 | 20国债(4) | 1,192,330 | 121,128,804.70 | 1.01 |
| 5 | 0801035 | 08央行票据 35 | 1,000,000 | 103,570,000.00 | 0.87 |

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基金合同规定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 | 1,272,654.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 428,400.00 |
| 4 | 应收利息 | 17,346,893.23 |
| 5 | 应收申购款 | 7,189,212.79 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,237,160.28 |

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 | 15,543,516,855.33 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 665,946,985.99 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 2,006,532,069.56 |
| 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 | 14,202,931,771.76 |

### §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富国天益价值证券投资基金的文件

2、富国天益价值证券投资基金基金合同

3、富国天益价值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、富国天益价值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

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

# 汉盛证券投资基金

## 2009年第三季度报告

2009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：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。

基金托管人中国农业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 | 富国汉盛封闭 |
| 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(2009 年 7 月 1 日到 2009 年 9 月 30 日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 63,598,187.97 |
| 2.本期利润 | 106,813,129.50 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0534 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,300,607,288.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.65033 |

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。

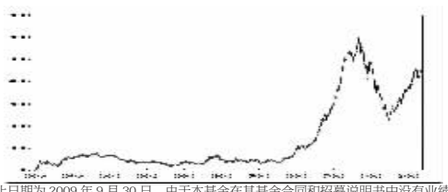
3.2 基金净值表现

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 | 3.34% | 2.11% | - | - | - | - |

注：过去三个月指 2009 年 7 月 1 日－2009 年 9 月 30 日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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。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 | | |
| 朱少醒 | 本基金基金经理兼任研究部总经理，富国天惠精选成长混合型证券投资基金基金经理。 | 2008-11-05 | - | 10年 | 博士，曾先后担任华夏证券研究所分析师、富国基金研究策划部分析师、富国基金产品开发主管，2004 年 6 月至 2005 年 8 月任富国天益价值基金经理助理，2005 年 11 月至今任富国天惠精选成长基金经理，2008 年 11 月起同时担任汉盛基金经理，现兼任富国基金研究部总经理。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《基金法》、《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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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

三季度沪深 300 指数下跌 5.1%。7 月份市场加速上扬后，8、9 两月进入调整。引发市场调整的一个重要导火索是宏观政策出现的信贷微调的系列举措。随后的大量融资计划则延长了调整的时间。

三季度的投资机会从"复苏憧憬"回归基本面选择。在经济触底回复的初期，市场的追逐的是"逻辑上"基本面改善弹性最大的投资标的，基本面的趋势主导了投资主题。当经济的复苏逐渐明确，投资者开始能更明确计算对应