富国天益价值证券投资基金

2012年09月30日

【2012】第三季度报告

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：2012年10月25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2012年10月23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7月1日起至2012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
基金主代码	100020
交易代码	前端交易代码：100020 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)	9,873,379,285.03
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。
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(2012年07月01日-2012年09月30日)
1.本期已实现收益	-380,593,738.64
2.本期利润	-435,309,096.66
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0440
4.期末基金资产净值	7,797,009,437.13
5.期末基金份额净值	0.7897

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	-5.27%	0.93%	-6.27%	1.11%	1.00%	-0.18%

注：过去三个月指2012年7月1日-2012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2012年9月30日。

本基金于2004年6月15日成立，建仓期6个月，从2004年6月15日至2004年12月14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2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大，建仓期3个月，从2007年11月5日至2008年2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。

§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	2005-04-13	-	16年	硕士，曾任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员；2000年10月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。2005年4月至今任富国天益基金经理，兼任公司副总经理。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富国天益价值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。

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，报告期内本组合与其他投资组合之间，出现2次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，原因是与本组合构成同日反向交易的对应的投资组合采用指数化投资策略，本基金投资属于正常的投资行为。

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

2012年三季度A股市场呈现小盘、高成长、题材股大幅上涨的特征，而大盘蓝筹股则一路下跌走势，投资者对中国经济前景的担忧是主因。周期性行业跌幅明显，稳定增长性行业表现相对较好。三季度本基金对部分重仓股根据基本面变化做出了一定调整，持仓结构发生一定变化，股票仓位有所下降。

三季度，本基金仍将保持乐观态度应对市场变化，耐心寻找投资机会，同时做好中长期的投资布局。

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-5.27%，业绩比较基准收益率为-6.27%。

§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	5,900,536,578.93	73.51
	其中：股票	5,900,536,578.93	73.51
2	固定收益投资	748,168,141.70	9.32
	其中：债券	748,168,141.70	9.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	776,802,045.20	9.68
	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	592,021,521.98	7.38
6	其他资产	9,714,670.67	0.12
7	合计	8,027,242,958.48	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	293,279,496.08	3.76
C	制造业	3,406,719,941.19	43.69
C0	食品、饮料	975,375,120.10	12.51
C1	纺织、服装、皮毛	7,161,514.23	0.09
C2	木材、家具	28,208,956.38	0.36
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	303,935,105.66	3.90
C5	电子	39,717,348.18	0.51
C6	金属、非金属	285,761,349.17	3.67
C7	机械、设备、仪表	764,699,615.21	9.81
C8	医药、生物制品	1,000,441,589.96	12.83
C99	其他制造业	1,419,342.30	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,072,745.28	0.13
E	建筑业	148,234,350.01	1.90
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	603,691,870.46	7.74
H	批发和零售贸易	253,626,092.86	3.25
I	金融、保险业	809,342,075.79	10.38
J	房地产业	338,619,220.15	4.34
K	社会服务业	30,337,188.32	0.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,613,598.79	0.08
	合计	5,900,536,578.93	75.68

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	3,156,351	775,831,075.80	9.95
2	002422	科伦药业	10,853,285	541,578,921.50	6.95
3	002153	石基信息	13,236,216	281,931,400.80	3.62
4	600271	航天信息	16,821,049	261,399,101.46	3.35
5	000423	东阿阿胶	5,605,338	217,038,687.36	2.78
6	000581	威孚高科	7,868,490	195,689,346.30	2.51
7	600585	海螺水泥	11,133,012	177,905,531.76	2.28
8	000718	苏宁环球	28,713,993	167,402,579.19	2.15
9	601318	中国平安	3,829,230	160,597,906.20	2.06
10	600016	民生银行	27,980,484	158,089,734.60	2.03

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	298,733,600.00	3.83
2	央行票据	96,710,000.00	1.24
3	金融债券	207,636,000.00	2.66
	其中：政策性金融债	207,636,000.00	2.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	145,088,541.70	1.86
8	其他	-	-
9	合计	748,168,141.70	9.60

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	120228	12国开28	1,000,000	99,680,000.00	1.28
2	019214	12国债14	1,000,000	99,488,600.00	1.28
3	020054	12贴现国债04	1,000,000	99,150,000.00	1.27
4	1101096	11央行票据96	1,000,000	96,710,000.00	1.24
5	120412	12农发12	800,000	78,328,000.00	1.00

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	1,123,614.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	516,946.05
4	应收利息	7,579,980.49
5	应收申购款	494,129.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,714,670.67

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	113002	工行转债	40,400,000.00	0.52
2	113001	中行转债	28,848,000.00	0.37
3	110015	石化转债	7,194,362.00	0.09

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	9,876,873,766.59
报告期期间基金总申购份额	166,272,743.80
减：报告期期间基金总赎回份额	169,767,225.36
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	9,873,379,285.03

§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

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10月25日

富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

2012年09月30日

【2012】第三季度报告

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：2012年10月25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2012年10月23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7月1日起至2012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)	7,433,332,259.12
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(2012年07月01日-2012年09月30日)
1.本期已实现收益	-447,663,873.76
2.本期利润	-750,256,272.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0989
4.期末基金资产净值	5,311,886,418.72
5.期末基金份额净值	0.7146

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	-12.10%	1.18%	-4.15%	0.71%	-7.95%	0.47%

注：过去三个月指2012年7月1日-2012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2012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		
贺轶	本基金基金经理兼任汉盛证券投资基金基金经理	2012-09-08	-	11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月起任汉盛证券投资基金基金经理，2012年9月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
宋小龙	本基金前任基金经理	2007-06-15	2012-09-26	14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月任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；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2012年9月任富国天瑞基金经理；兼任权益投资部总经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：本公司于2012年9月8日、9月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，聘任贺轶先生担任本基金基金经理，宋小龙先生不再担任本基金基金经理。

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。

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，报告期内本组合与其他投资组合之间，出现2次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，原因是与本组合构成同日反向交易的对应的投资组合采用指数化投资策略，本基金投资属于正常的投资行为。

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

2012年3季度A股市场在国内经济和企业盈利增速下滑、政策放松力度低于预期等负面因素的影响下整体向下调整。

2012年3季度，本基金根据宏观经济和市场状况适当降低了权益类资产的配置比例，行业配置方面的操作主要是适当降低了行业基本面超预期概率降低且受政策预期扰动影响加大的地产行业的配置比例，适当增加了部分业绩增长受经济下滑冲击风险较小且受益于中长期发展主题的消费和成长类行业的配置比例。

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-12.1%，业绩比较基准收益率为-4.15%。

§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	4,347,347,145.42	81.15
	其中：股票	4,347,347,145.42	81.15
2	固定收益投资	243,395,000.00	4.54
	其中：债券	243,395,000.00	4.54
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	619,001,488.50	11.55
	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	136,192,300.64	2.54
6	其他资产	11,432,457.97	0.21
7	合计	5,357,368,392.53	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	260,601,042.14	4.91
C	制造业	1,498,555,765.82	28.21
C0	食品、饮料	187,477,775.71	3.53
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	19,815,572.07	0.37
C4	石油、化学、塑胶、塑料	120,038,829.96	2.26
C5	电子	106,367,417.63	2.00
C6	金属、非金属	208,313,837.29	3.92
C7	机械、设备、仪表	495,271,363.14	9.32
C8	医药、生物制品	290,300,480.92	5.47
C99	其他制造业	70,970,489.10	1.34
D	电力、煤气及水的生产和供应业	125,982,045.18	2.37
E	建筑业	35,825,406.45	0.67
F	交通运输、仓储业	16,698,981.18	0.31
G	信息技术业	227,730,134.16	4.29
H	批发和零售贸易	432,434,444.93	8.14
I	金融、保险业	589,585,697.29	11.10
J	房地产业	897,501,904.06	16.90
K	社会服务业	221,380,736.67	4.17
L	传播与文化产业	41,050,987.54	0.77
M	综合类	-	-
	合计	4,347,347,145.42	81.84

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	600048	保利地产	25,365,077	272,928,228.52	5.14
2	000625	长安汽车	50,385,352	267,042,365.60	5.03
3	600208	新湖中宝	70,115,597	242,599,965.62	4.57
4	002251	步步高	8,250,699	175,327,353.75	3.30
5	000024	招商地产	7,704,124	160,245,779.20	3.02
6	600383	金地集团	27,603,473	138,845,469.19	2.61
7	000001	平安银行	10,238,260	134,428,353.80	2.53
8	601318	中国平安	3,116,801	130,718,633.94	2.46
9	600098	广州发展	20,028,942	125,982,045.18	2.37
10	000501	鄂武商A	10,492,194	124,017,733.08	2.33

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	-	-
2	央行票据	193,340,000.00	3.64
3	金融债券	50,055,000.00	0.94
	其中：政策性金融债	50,055,000.00	0.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	243,395,000.00	4.58

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	1101088	11央行票据88	2,000,000	193,340,000.00	3.64
2	120405	12农发05	500,000	50,055,000.00	0.94

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	3,127,837.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	538,774.59
4	应收利息	7,069,502.36
5	应收申购款	696,343.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,432,457.97

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	7,555,381,056.87
报告期期间基金总申购份额	939,463,459.03
减：报告期期间基金总赎回份额	1,061,512,256.78
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	7,433,332,259.12

§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
2012年10月25日

富国天利增长债券投资基金

2012年09月30日

【2012】第三季度报告

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：2012年10月25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2012年10月23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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止

§2 基金产品概况

基金简称	富国天利增长债券
基金主代码	100018
交易代码	前端交易代码：100018 后端交易代码：100019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月02日
报告期末基金份额总额(单位：份)	1,694,462,342.09
投资目标	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，投资目标是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。
投资策略	久期控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，属于低风险的基金品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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07月01日-2012年09月30日)
1.本期已实现收益	35,021,202.22
2.本期利润	-14,554,297.66
3.加权平均基