

## 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

## 【2013】第一季度报告

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:2013年04月22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2013年4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。  
 本报告自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	富国天瑞强势地区精选混合型
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)	7,142,977,001.87

本基金主要投资于强势地区(区域经济发展较快,已经形成一定产业集群且居民购买力较强)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。

本基金主要采用“自上而下”的主动投资管理策略,在充分分析宏观经济状况、资本市场运行特征的前提下,以强势地区内个股、证券的投资价值评估为核心,追求投资组合流动性、赢利性、安全性的中长期有效结合。

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%

本基金是一只主动投资的积极型基金,主要投资于强势地区中符合合理且具有成长潜力的优质股票,属于中风险偏高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(2013年01月01日—2013年03月31日)
1.本期已实现收益	151,395,779.15
2.本期利润	130,756,366.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0186
4.期末基金资产净值	5,715,408,041.10
5.期末基金份额净值	0.8001

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可能会低于所列数字。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本报告期末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 基准②	业绩比较基 收益差③	业绩比较基准 收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.33%	1.31%	-0.72%	0.90%	3.05%	0.41%

注:过去三个月指2013年1月1日至2013年3月31日。

3.2.2本报告期末基金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2013年3月31日。

本基金成立于2005年4月5日,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 任职日期	离任日期	证券从 业年限	说明
贺斌	本基金基金经理 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理	2012-09-08	-	12年	硕士,曾任中国银行云南省分行国际业务部副经理,非银信贷证券分公司分析员;中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员;银基金管理有限公司投资部助理副总监;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部与产品部高级政策研究员。2010年1月起任汇添富证券投资基金经理,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。

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合同》以及其他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基金资产的投资风险,力争实现基金资产的长期稳定增值为基本目标,管理和运用基金资产,无损害基金份额持有人的利益行为,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同约定的投资范围。

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,本基金管理人根据相关法律法规,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场中购、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,并有效执行。

事前控制主要包括: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;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、交易对手和授权范围进行自动化控制。

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.将主动投资组合的每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;对于同一投资组合的,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现6次同方向交易或交易较多的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况,亦未受到监管部门的相关通报。

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(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交易行为进行分析评估,分析对蒙骗公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同类类型(股票型、混合类、债券型)间,不同时间窗口以同一基金经理管理不同合同的交易行为,若发现异常交易行为,监察稽核部情况要求相关当事人做出合理解释,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、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

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。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
 报告期内,本基金管理人根据相关法律法规,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场中购、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,并有效执行。

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析  
 2013年1季度A股市场在房地产调控和规范商业银行理财业务投资运作等政策出台因素的影响下整体呈现震荡调整态势。

2013年1季度,本基金根据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增持了部分业绩增速确定性和相对较高和受益于经济中长期发展主题的行业配置比例。

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报告期内基金的投资表现  
 本报告期,本基金净值增长率为2.33%,业绩比较基准收益率为-0.72%。

1	权益投资	4,754,103,951.37	82.63
	其中:股票	4,754,103,951.37	82.63
2	固定收益投资	50,010,000.00	0.87
	其中:债券	50,010,000.00	0.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	461,001,530.50	8.01
	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	465,595,817.56	8.09
6	其他资产	22,679,301.35	0.39
7	合计	5,753,390,600.78	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	采矿业	54,339,346.63	0.95
C	制造业	2,580,762,331.13	45.15
D	电力、热力、燃气及生产供应业	166,446,466.18	2.56
E	建筑业	16,830,925.12	0.29
F	批发和零售业	470,005,090.64	8.22
G	交通运输、仓储和邮政业	85,698,378.10	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,529,214.19	1.46
J	金融业	612,597,040.44	10.72
K	房地产业	550,828,619.58	9.64
L	租赁和商务服务业	20,731,162.04	0.36
M	科学研究和技术服务业	17,850,792.96	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	114,484,584.36	2.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		4,754,103,951.37	83.18

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	000625	长安汽车	34,555,618	321,367,247.40	5.62
2	600448	保利地产	20,385,077	234,020,685.96	4.09
3	000423	保利阿胶	3,380,270	176,112,067.00	3.08
4	600000	浦发银行	16,784,927	170,031,310.51	2.97
5	600208	新钢中宝	52,029,560	168,575,774.40	2.95
6	601166	兴业银行	9,445,997	163,415,748.10	2.86
7	600887	伊利股份	5,100,854	161,595,054.72	2.83
8	000895	双汇发展	1,942,424	156,947,859.20	2.75
9	000024	招商地产	6,004,554	141,647,428.86	2.48
10	000251	步步高	5,122,212	117,298,654.80	2.05

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	-	-		
3	金融债券	50,010,000.00	0.88		
其中：政策性金融债		50,010,000.00	0.88		
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	50,010,000.00	0.88		
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(%)

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6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。

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明  
 5.8.1报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
 注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2本基金投资股指期货的投资政策  
 本基金未投资股指期货,故无相关投资政策。

5.9投资组合报告附注  
 5.9.1报告期内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、处罚的情况。

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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.2明本基金投资的前十名股票中是否有超出基金合同约定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中未有超出备选股票库之外的股票。

序号	股票代码	股票名称	金额(元)
1	存出保证金	-	1,591,298.34
2	应收证券清算款	-	17,020,079.87
3	应收股利	-	-
4	应收利息	-	1,996,203.66
5	应收申购款	-	2,071,719.48
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	22,679,301.35

5.9.3其他资产构成

序号	资产名称	金额(元)
1	存出保证金	1,591,298.34
2	应收证券清算款	17,020,079.87
3	应收股利	-
4	应收利息	1,996,203.66
5	应收申购款	2,071,719.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,679,301.35

5.9.4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。

5.9.5报告期内本基金投资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。

5.9.6投资期间本基金投资的前十名股票中是否有超出基金合同约定的备选股票库。

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 开放式基金净值变动**  
 单位:份

报告期初基金份额总额	7,354,326,021.90
报告期间基金份额申购份额	452,924,220.74
减:报告期间基金份额赎回份额	664,273,240.77
报告期末基金份额总额	7,142,977,001.87

§ 7 备查文件目录	
7.1备查文件目录	单位:份
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	7,354,326,021.90
2.富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金合同	452,924,220.74
3.富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金托管协议	664,273,240.77
4.中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件	7,142,977,001.87
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.报告期内本基金投资的前十名股票的基本情况	-
7.2存放地点	-
上海浦东新区世纪大道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、4008880868 全国统一、免长途费	-
公司网址:http://www.fullgoal.com.cn	-

富国基金管理有限公司	2013年04月22日
------------	-------------

## 富国天益价值证券投资基金

## 【2013】第一季度报告

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:2013年04月22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2013年4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。  
 本报告自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	富国天益价值证券
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)	9,660,787,519.98

本基金属上市价值型基金,主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票,或与同类类型上市公司相比具有较高相对价值的上市公司股票。本基金通过投资组合的动态调整来分散风险,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。

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。本基金基金经理对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,并执行动态资产配置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。

95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数

本基金为价值型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

本基金管理人: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

主要财务指标	报告期(2013年01月01日至2013年03月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	219,867,109.45	
2.本期利润	177,523,312.28	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179	
4.期末基金资产净值	8,334,268,043.39	
5.期末基金份额净值	0.8627	

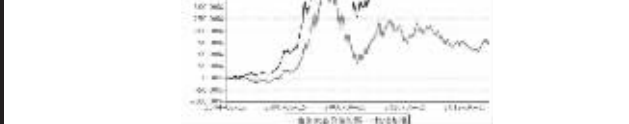
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平可能会低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1本报告期末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 基准②	业绩比较基 收益差③	业绩比较基准 收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.96%	1.86%	-0.46%	1.43%	2.42%	-0.07%

注:过去三个月指2013年1月1日至2013年3月31日。

3.2.2本报告期末基金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2013年3月31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。

2007年1月15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 任职日期	离任日期	证券从 业年限	说明
陈戈	本基金基金经理 助理兼公司副 总经理	2005-04-13	-	17年	硕士,曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员;2006年10月任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管、研究策划助理、总经理助理。2005年4月加入富国基金管理有限公司,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合同》以及其他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,力争实现基金资产的长期稳定增值为基本目标,管理和运用基金资产,无损害基金份额持有人的利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同约定的投资范围。

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,本基金管理人根据相关法律法规,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场中购、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,并有效执行。

事前控制主要包括: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;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、交易对手和授权范围进行自动化控制。

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.将主动投资组合的每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;对于同一投资组合的,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现2次同方向交易或交易较多的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况,亦未受到监管部门的相关通报。