

# 富国天博创新主题股票型证券投资基金

## (原汉博证券投资基金转型)

### 2007 年第 3 季度报告

#### 一、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 2007 年 10 月 22 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。

基金季度财务报告未经审计。

#### 二、基金产品概况

##### (一) 富国天博创新主题股票型证券投资基金

基金简称：富国天博

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007 年 4 月 27 日

报告期末基金份额总额：13,306,821,437.75 份

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（简称中国建设银行）

### 三、主要财务指标和基金净值表现

#### （一）主要财务指标

单位：人民币元

1	本期利润	2,641,120,442.78
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,029,069,706.16
3	加权平均基金份额本期利润	0.2922
4	期末基金资产净值	14,887,034,114.77
5	期末基金份额净值	1.1188

提示：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。

2007 年 7 月 1 日基金实施新会计准则后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期净收益”=第 2 项/（第 1 项/第 3 项）。

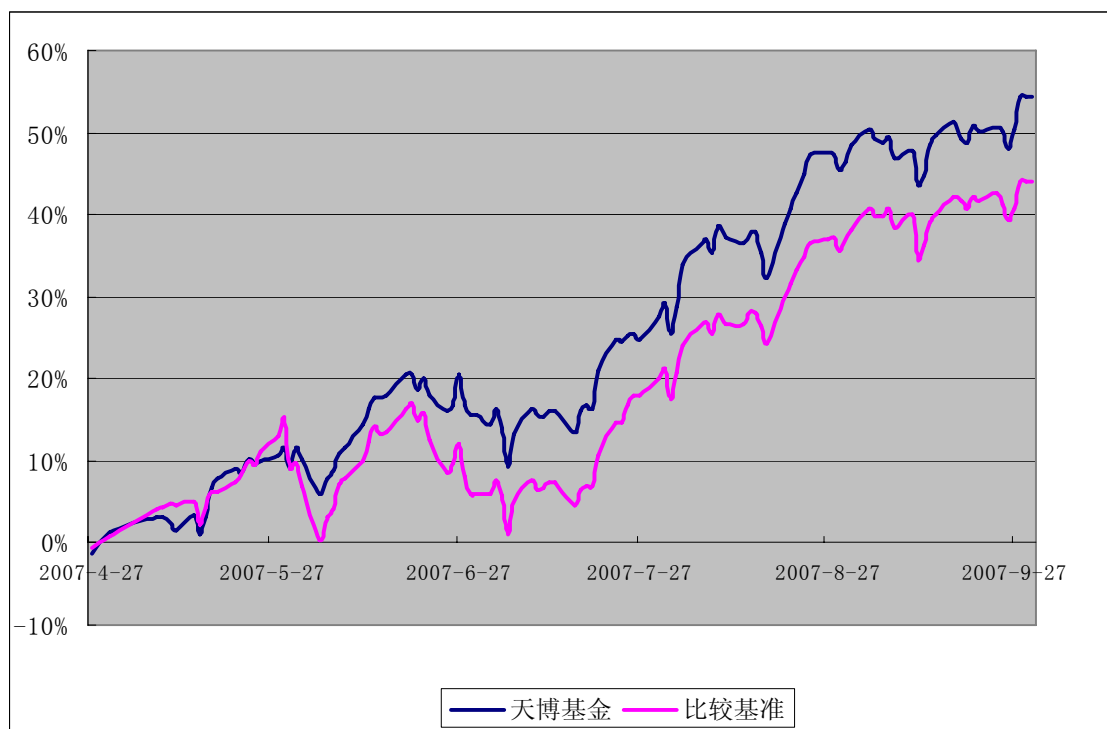
#### （二）富国天博创新主题股票型证券投资基金净值表现

##### 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	33.62%	1.77%	35.87%	1.69%	-2.25%	0.08%

注：过去三个月指 2007 年 7 月 1 日—2007 年 9 月 30 日。

2、自基金合同生效以来富国天博创新主题股票型证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图（2007 年 4 月 27 日至 2007 年 9 月 30 日，自合同生效日至截止日不足一年）



注：截止日期为 2007 年 9 月 30 日。

## 四、管理人报告

### （一）基金经理

毕天宇先生，生于 1971 年，工商管理硕士，自 2000 年开始从事证券行业工作，曾任中国北方工业上海公司内贸处销售员、兴业证券股份有限公司研究发展中心研究员、富国基金管理公司研究策划部研究员。

### （二）遵规守信说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为汉博证券投资基金（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《基金法》、《证券法》、《汉博证券投资基金基金合同》（《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。

### （三）运作情况说明

在经历了 2 季度宽幅震荡，市场心态趋于谨慎的时候，特别是在美国经济受次级债影响，导致周边股市大幅震荡的背景下，3 季度沪深股市却戏剧性地走

出了单边上扬走势。究其原因，宏观经济强劲增长，上市公司中报业绩超预期是关键。

期间，天博基金按照适度均衡配置的建仓策略进行组合构建，前 10 大重仓股的权重基本稳定在 35% 左右。从期初行业配置表现来看，重点配置的金融、地产行业表现较好，但化工新材料和重卡行业表现一般。另外，我们还适度增持了煤炭、钢铁和有色行业，并取得了不错的收益。

为了回馈投资者，我们在 8 月 17 日和 9 月 13 日分别进行了两次分红。由于第一次分红后，基金申购踊跃，导致基金规模短期迅速扩大。为构建组合需要，维护投资者利益，我们短期暂停了基金申购。

如今站在 5500 点之上谈论 4 季度市场，相信每一个市场参与者都会有一种高处不胜寒的感觉，市场分歧正逐步加大，这既是风险也是机会。

回顾三季度，两次加息、发行特别国债、提高准备金率、提高第二套住房的首付比例等宏观经济调控政策的不断出台，一方面表明管理层对中国经济过热的担心，有调控的必要，但另一方面也说明中国经济的强劲增长。

从股市来看，建设银行、中国神华等大盘蓝筹股的密集发行，市场并没有出现太多恐慌。而申购资金不断创出历史新高，也表明流动性过剩是短期难以回避的现实。因此，我们并不太在意市场指数的短期高低，只要影响我们投资信心的关键因素没有发生改变，我们将继续坚定看好中国的股市。

## 五、投资组合报告（未经审计）

### （一）报告期末基金资产组合情况

截至 2007 年 9 月 30 日，富国天博创新主题股票型证券投资基金资产净值为 14,887,034,114.77 元，基金份额净值为 1.1188 元，基金份额累计净值为 3.6845 元。其资产组合情况如下：

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例
1	股票	13,114,944,466.29	87.20%
2	债券	673,235,569.70	4.48%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款及结算备付金	1,203,024,910.94	8.00%
5	其他资产	48,859,354.38	0.32%
	合计	15,040,064,301.31	100.00%

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	证券板块名称	市 值 （元）	市值占基金资产净值比例
1	A 农、林、牧、渔业	18,224,830.08	0.12%
2	B 采掘业	1,269,567,922.41	8.53%
3	C 制造业	4,796,131,665.53	32.22%
	C0 食品、饮料	628,912,774.94	4.22%
	C1 纺织、服装、皮毛	429,826.40	0.00%
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	52,776,328.88	0.35%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	808,754,896.55	5.43%
	C5 电子	13,184,075.37	0.09%
	C6 金属、非金属	2,202,553,225.05	14.80%
	C7 机械、设备、仪表	870,650,195.17	5.85%
	C8 医药、生物制品	217,193,892.65	1.46%
	C9 其他制造业	1,676,450.52	0.01%
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	202,425,918.24	1.36%
5	E 建筑业	408,427.11	0.00%
6	F 交通运输、仓储业	887,766,181.76	5.96%
7	G 信息技术业	546,089,252.31	3.67%
8	H 批发和零售贸易	767,543,025.02	5.16%
9	I 金融、保险业	3,548,081,465.19	23.83%
10	J 房地产业	973,596,249.42	6.54%
11	K 社会服务业	105,109,529.22	0.71%
12	L 传播与文化产业		
13	M 综合类		
	合计：	13,114,944,466.29	88.10%

## (三) 报告期末股票投资的前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	市 值 （元）	市值占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	27,070,103.00	1,035,972,841.81	6.96%
2	600030	中信证券	6,757,062.00	653,475,466.02	4.39%
3	002024	苏宁电器	9,252,529.00	634,908,539.98	4.26%
4	601318	中国平安	4,433,617.00	598,316,614.15	4.02%
5	600019	宝钢股份	32,454,618.00	590,349,501.42	3.97%
6	600519	贵州茅台	2,871,091.00	432,013,062.77	2.90%
7	000983	西山煤电	5,485,635.00	392,168,046.15	2.63%
8	000002	万 科A	10,865,892.00	328,149,938.40	2.20%
9	600000	浦发银行	6,152,593.00	323,011,132.50	2.17%
10	601628	中国人寿	5,037,081.00	314,364,225.21	2.11%

## (四) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	市值 (元)	市值占基金资产净值比例
1	国家债券	100,888,569.70	0.68%
2	央行票据	572,347,000.00	3.84%
	合计	673,235,569.70	4.52%

## (五) 报告期末债券投资的前五名债券明细

序号	债券名称	市值 (元)	市值占基金资产净值比例
1	07 央行票据 25	194,100,000.00	1.30%
2	06 央行票据 87	145,890,000.00	0.98%
3	07 央行票据 91	145,170,000.00	0.98%
4	21 国债(3)	60,036,420.00	0.40%
5	07 央行票据 81	48,415,000.00	0.33%

## (六) 组合报告附注

(1) 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。

(2) 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。

(3) 截至 2007 年 9 月 30 日, 本基金的其他资产项目构成如下:

序号	其他资产项目	金额 (元)
1	存出保证金	2,149,136.41
2	应收利息	9,261,863.99
3	应收股利	
4	应收证券交易清算款	
5	其他应收款	
6	应收申购款	37,448,353.98
7	待摊费用	
	其他资产项目合计	48,859,354.38

(4) 截至 2007 年 9 月 30 日, 本基金未持有处于转股期的可转债。

(5) 本基金本报告期内及本报告期末均不持有资产支持证券。

(6) 本基金本报告期末主动投资权证, 未获得因股权分置改革而产生的权证。

(7) 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。

(8) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目名称	基金份额 (份)
------	----------

报告期期初持有基金份额	58,617,697.00
报告期内买入基金份额	0
报告期内卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	58,617,697.00

## 六、开放式基金份额变动(富国天博创新主题

### 股票型证券投资基金 单位：份)

本报告期初基金份额总额	6,827,015,586.36
本报告期间基金总申购份额	9,564,591,032.81
本报告期间基金总赎回份额	3,084,785,181.42
本报告期末基金份额总额	13,306,821,437.75

## 七、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

查阅地点：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

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

二〇〇七年十月二十四日