富国优化增强债券型证券投资基金

2012年06月30日

【2012】第二季度报告

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日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国优化增强债券	
基金主代码	100035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年06月10日	
报告期末基金份额总额(单位:份)	635,586,568.11	
投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置，在债券投资过程中突出主动性的投资管理。 本基金通过对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势的客观判断，合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等，加以对国家债券等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取各类债券的超额投资收益。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	富国优化增强债券A/B级	富国优化增强债券C级
下属两级基金的交易代码	100035	100037
报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份)	298,068,286.83	337,518,281.28

§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/B级 报告期(2012年04月01日-2012年06月30日)	C级 报告期(2012年04月01日-2012年06月30日)
1.本期已实现收益	3,695,800.41	3,659,012.69
2.本期利润	7,164,007.02	7,363,487.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0227	0.0211
4.期末基金资产净值	301,386,747.84	336,589,466.34
5.期末基金份额净值	1.011	0.997

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

①A/B级

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	2.12%	0.27%	1.97%	0.11%	0.15%	0.16%

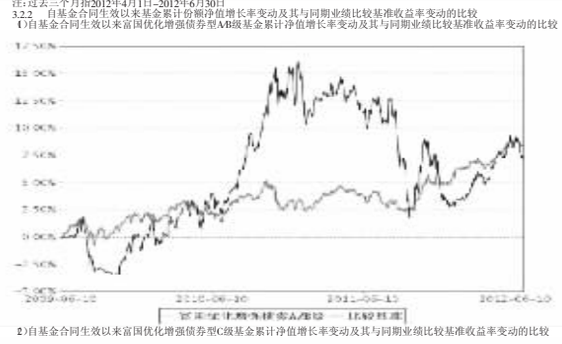
②C级

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	2.05%	0.28%	1.97%	0.11%	0.08%	0.17%

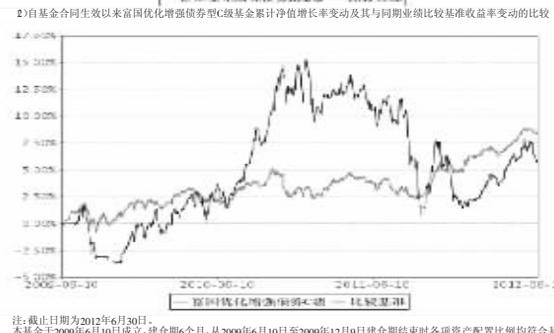
注：过去三个月指2012年4月1日-2012年6月30日

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

①自基金合同生效以来富国优化增强债券型A/B级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



②自基金合同生效以来富国优化增强债券型C级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2012年6月30日。

本基金于2009年6月10日成立，建仓期6个月，从2009年6月10日至2009年12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		
钟智伦	本基金基金经理兼任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、富国产业债债券型证券投资基金基金经理、固定收益投资副总监	2009-06-10	-	19年	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2009年3月任富国天时基金经理，2008年10月至今任富国天丰基金经理；2009年6月至今任富国优化增强债券基金基金经理；2011年12月至今任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；兼任固定收益投资副总监。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优化增强债券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》、《富国优化增强债券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、交易对于库及授权管理，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

2季度经济增速和物价水平回落超过市场一致预期，同时债券市场流动性改善，债券投资需求特别是对信用产品的需求显著增加，报告期内信用债券出现明显的上涨，沪深300指数则先升后跌，涨幅0.27%。

报告期内本基金债券投资坚持以信用产品为基本配置，同时增加了对可转债的配置；股票投资维续持在较低比例。

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A/B级2.12%、C级2.05%；业绩比较基准收益率A/B级1.97%、C级1.97%。

§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	54,466,445.22	5.27
	其中：股票	54,466,445.22	5.27
2	固定收益投资	895,595,584.30	86.62
	其中：债券	895,595,584.30	86.62
	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	76,332,370.61	7.38
6	其他资产	7,503,105.20	0.73
7	合计	1,033,897,505.33	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	3,124,328.50	0.49
C	制造业	25,258,788.82	3.96
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	10,675,694.80	1.67
C7	机械、设备、仪表	14,583,094.02	2.29
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	26,083,327.90	4.09
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	54,466,445.22	8.54

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	600030	中信证券	1,000,000	12,630,000.00	1.98
2	601388	怡球资源	635,080	10,675,694.80	1.67
3	601318	中国平安	200,000	9,148,000.00	1.43
4	600066	宇通客车	394,137	8,852,317.02	1.39
5	600816	安信信托	259,045	4,305,327.90	0.67
6	000968	煤气化	204,874	3,124,328.50	0.49
7	000157	中联重科	289,900	2,907,697.00	0.46
8	000625	长安汽车	578,500	2,823,080.00	0.44

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	48,480,000.00	7.60
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	392,524,952.30	61.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	454,590,632.00	71.26
8	其他	-	-
9	合计	895,595,584.30	140.38

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	113001	中行转债	2,050,000	199,096,000.00	31.21
2	110015	石化转债	1,750,000	174,842,500.00	27.41
3	113002	工行转债	696,000	75,857,040.00	11.89
4	0980100	09常高新债	500,000	49,305,000.00	7.73
5	1101094	11央行票据94	500,000	48,480,000.00	7.60

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	253,605.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,164,962.32
5	应收申购款	84,537.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,503,105.20

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	199,096,000.00	31.21
2	110015	石化转债	174,842,500.00	27.41
3	113002	工行转债	75,857,040.00	11.89

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601388	怡球资源	10,675,694.80	1.67	新股认购

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

项目	A/B级	C级
报告期期初基金份额总额	329,906,255.90	364,157,927.26
报告期期间基金总申购份额	27,186,786.81	26,165,442.82
减：报告期期间基金总赎回份额	59,024,755.88	52,805,088.80
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	298,068,286.83	337,518,281.28

§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优化增强债券型证券投资基金的文件

2、富国优化增强债券型证券投资基金基金合同

3、富国优化增强债券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、富国优化增强债券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07月20日

富国中证红利指数增强型证券投资基金

2012年06月30日

【2012】第二季度报告

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。

基金托管人中国工商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日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国中证红利指数增强
基金主代码	100032
交易代码	前端交易代码：100032 后端交易代码：100033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月20日
报告期末基金份额总额(单位:份)	882,491,557.20
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，其在遵循"程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理"原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。
投资策略	本基金将采用"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略，在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益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04月01日-2012年06月30日)
1.本期已实现收益	22,804,982.16
2.本期利润	854,958.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0010
4.期末基金资产净值	873,772,747.47
5.期末基金份额净值	0.990

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富国中证红利指数增强型证券投资基金净值表现

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	0.10%	1.02%	-2.44%	0.96%	2.54%	0.06%

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6月30日。本基金于2008年11月20日成立，建仓期6个月，即从2008年11月20日至2009年5月19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		
徐幼华	本基金基金经理兼任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理	2011-05-13	-	8年	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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中证红利指数增强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》、《富国中证红利指数增强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、交易对于库及授权管理，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

回顾2012年二季度，欧债危机随着希腊第二次大选失败而愈演愈烈，全球经济再次陷入二次深度衰退的风险之中，尽管国内通货膨胀率从高位回落，货币政策也进一步放松，但是市场的悲观情绪在6月份再度攀升，二季度市场仍然呈现先升后降走势，6月份指数出现较大幅度调整，整个季度中证红利指数下跌2.83%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，量化增强策略获得了较好的表现，报告期内，本基金的超额收益为2.55%。本基金在报告期内遇到多次申购赎回，在一定程度上增加了本基金的交易成本。

展望2012年三季度，宏观政策可能进一步放松，通胀企稳，海外经济已经从底部开始复苏。目前市场点位仍然有较大的安全边际，部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。综合来看，三季度市场可能呈现震荡上行走势。

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0.1%，业绩比较基准收益率为-2.44%。

§5 富国中证红利指数增强型证券投资基金投资组合报告

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	791,600,176.04	90.20
	其中：股票	791,600,176.04	90.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	84,019,550.49	9.57
6	其他资产	2,020,125.44	0.23
7	合计	877,639,851.97	100.00

5.2 报告期末积极投资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	209,256.82	0.02
B	采掘业	9,313,653.35	1.07
C	制造业	60,791,326.68	6.96
C0	食品、饮料	10,480,425.83	1.20
C1	纺织、服装、皮毛	2,622.00	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,208,951.75	0.14
C5	电子	1,968,049.48	0.23
C6	金属、非金属	9,244,466.26	1.06
C7	机械、设备、仪表	33,741,252.87	3.86
C8	医药、生物制品	4,145,558.49	0.47
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,263,663.87	0.83
E	建筑业	8,522,724.76	0.98
F	交通运输、仓储业	3,063,573.99	0.35
G	信息技术业	163,302.00	0.02
H	批发和零售贸易	2,381,546.23	0.27
I	金融、保险业	56,220,690.41	6.43
J	房地产业	175,390.30	0.02
K	社会服务业	109,545.95	0.01
L	传播与文化产业	126,285.30	0.01
M	综合类	5,800.00	0.00
	合计	148,346,759.66	16.98

5.3报告期末指数投资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	104,875,979.32	12.00
C	制造业	127,530,770.93	14.60
C0	食品、饮料	33,363,084.74	3.82
C1	纺织、服装、皮毛	6,973,266.90	0.80
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	54,083.12	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,679,482.10	0.88
C5	电子	152,111.68	0.02
C6	金属、非金属	36,553,911.45	4.18
C7	机械、设备、仪表	30,401,814.52	3.48
C8	医药、生物制品	12,232,502.30	1.40
C99	其他制造业	120,514.12	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	33,414,680.60	3.82
E	建筑业	22,651,059.30	2.59
F	交通运输、仓储业	33,408,592.97	3.82
G	信息技术业	16,896,051.64	1.93
H	批发和零售贸易	38,600,881.84	4.42
I	金融、保险业	246,791,275.23	28.24
J	房地产业	9,984,329.83	1.14
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	9,099,794.72	1.04
	合计	643,253,416.38	73.62

5.4报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1报告期末指数投资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	600036	招商银行	7,206,989	78,700,319.88	9.01
2	601166	兴业银行	5,507,305	71,484,818.90	8.18
3	600030	中信证券	4,942,430	62,422,890.90	7.14
4	601088	中国神华	2,518,948	56,625,951.04	6.48
5	000568	泸州老窖	781,238	33,054,179.78	3.78
6	600028	中国石化	4,878,178	30,732,521.40	3.52
7	600019	宝钢股份	6,529,277	28,206,476.64	3.23
8	600153	建发股份	2,894,896	20,727,455.36	2.37
9	600741	华域汽车	2,276,473	20,419,962.81	2.34
10	600500	中化国际	2,643,998	17,873,426.48	2.05

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600015	华夏银行	1,590,955	15,066,343.85	1.72
2	600000	浦发银行	1,439,680	11,704,598.40	1.34
3	600104	上汽集团	813,855	11,629,987.95	1.33
4	600016	民生银行	1,884,400	11,287,556.00	1.29
5	000666	经纬纺机	848,104	10,363,830.88	1.19

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1 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。

本报告期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。

5.9.2 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。

本报告期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。

5.9.3 报告期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,377,048.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	481,527.90
4	应收利息	15,416.37
5	应收申购款	146,133.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,020,125.44

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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.5.1期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.5.2期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 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	887,960,934.59
报告期期间基金总申购份额	36,559,521.83
减：报告期期间基金总赎回份额	42,028,899.22
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	882,491,557.20

§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源平衡混合型证券投资基金的文件

2、富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同

3、富国天源平衡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、富国天源平衡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07月20日

富国天源平衡混合型证券投资基金

2012年06月30日

【2012】第二季度报告

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。

基金托管人中国农业银行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