

富国天利增长债券投资基金

2012 半年度报告摘要

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
送出日期：2012年08月25日

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2012年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。
本报告中文财务资料未经审计。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name (富国天利增长债券), code (100018), and other details.

2.2 基金产品说明

本基金为主动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基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。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Name and Address. Lists the fund manager (富国基金管理有限公司) and custodian (中国工商银行股份有限公司).

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the reporting period.

3.2 基金净值表现

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。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the reporting period.

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金公司之一。

4.1.2 基金经理 或基金经理小组简介
姓名 职务 在基金基金经理任期 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: Name, Position, Tenure, Years, and Description. Lists fund managers and their details.

注：1、上述表格内基金经理的任职日期、离任日期指公司作出决定并公告披露之日。
2、本公司于2012年6月20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，杨贵宾先生不再担任本基金基金经理，饶刚先生继续担任本基金基金经理。

4.2 管理人报告期内基金运作遵规守信情况的说明
本报告期，富国基金管理有限公司严格按照《富国天利增长债券投资基金合同》及相关法律法规的规定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
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律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

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。
4.3.3 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.4 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.5 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.6 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.7 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.8 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.9 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.10 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.11 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.12 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

4.3.13 公平交易专项说明
本基金管理人根据相关法律法规，并结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易的相关研究分析、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。

6.4.2 会计差错更正的说明

本基金本期未发生重大会计差错，无需更正。
6.4.3 事项
1.印花稅
经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花稅税率，由原先的3‰调整为1‰。

2.营业税、企业所得税
根据财政部、国家税务总局财税[2004]178号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

3.个人所得税
根据财政部、国家税务总局财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税问题的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

4.7 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
本公司按照相关法律法规的规定建立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程等方面的业务骨干以及相关业务经理，所有相关成员均具有丰富的估值基金行业从业经验。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况的说明
2012年上半年，本基金托管人在对富国天利增长债券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
2012年上半年，富国天利增长债券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国天利增长债券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国天利增长债券投资基金2012年上半年度中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6.1 资产状况

Table with 2 columns: Item and Value. Shows asset status for the reporting period.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows liability and equity status for the reporting period.

6.2 利润表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows profit and loss statement for the reporting period.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows changes in equity for the reporting period.

6.4 现金流量表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows cash flow statement for the reporting period.

6.5 关联方关系

6.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况
本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方
富国基金管理有限公司 与本基金的关系
富国基金管理有限公司 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

6.5.3 本报告期及上年度可比期间内本基金均未与关联方进行关联交易。
6.5.3.1 债券交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方进行债券交易的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows bond trading with related parties.

6.5.3.2 回购交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方进行回购交易的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows repurchase trading with related parties.

6.5.3.3 支付关联方的佣金
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方支付佣金的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows commission payments to related parties.

6.5.3.4 关联方报酬
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方支付报酬的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows remuneration to related parties.

6.5.3.5 关联方交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方交易的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows transactions with related parties.

6.5.3.6 关联方交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方交易的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows transactions with related parties.

6.5.3.7 关联方交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方交易的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows transactions with related parties.

6.5.3.8 关联方交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方交易的情况如下：

Table with 2 columns: Item and Value. Shows transactions with related parties.

6.5.3.9 关联方交易
富国天利增长债券投资基金 本期(2012年01月01日至2012年06月30日) 与关联方交易的情况如下：

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: Code, Industry, and Value. Shows stock portfolio by industry.

7.3 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 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 10 stocks by value.

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 20 stocks bought.

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 20 stocks sold.

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位：人民币元
买入股票成本(成交)总额 135,450,433.25
卖出股票收入(成交)总额 158,281,360.85

7.4.4 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
序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: No., Code, Name, Value. Lists top 5 bonds by value.

7.4.5 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
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(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 10 asset-backed securities.

7.4.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 5 warrants.

7.4.7 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：本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.4.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

7.5 投资组合报告附注
7.5.1 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、处罚的情形。

7.5.2 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。

7.5.3 报告期内本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库。

7.5.4 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.5 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.6 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.7 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.8 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.9 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.10 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.11 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.12 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.13 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.14 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.15 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.16 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.17 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.18 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.19 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.20 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.21 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: Code, Industry, and Value. Shows stock portfolio by industry.

7.3 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 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 10 stocks by value.

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 20 stocks bought.

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 20 stocks sold.

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位：人民币元
买入股票成本(成交)总额 135,450,433.25
卖出股票收入(成交)总额 158,281,360.85

7.4.4 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
序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: No., Code, Name, Value. Lists top 5 bonds by value.

7.4.5 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
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(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 10 asset-backed securities.

7.4.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: No., Code, Name, Qty, Value. Lists top 5 warrants.

7.4.7 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：本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.4.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

7.5 投资组合报告附注
7.5.1 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、处罚的情形。

7.5.2 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。

7.5.3 报告期内本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库。

7.5.4 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.5 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.6 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.7 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.8 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.9 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.10 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.11 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.12 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.13 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.14 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.15 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.16 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.17 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.18 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.19 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.20 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。

7.5.21 报告期内本基金投资的前十名股票中未持有在备选股票库之外的。