

富国天盈分级债券型证券投资基金

2012 半年度报告摘要

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的交易公平性进行自动化交易...

本报告一、财务报表由下列负责人签署: 富国基金管理有限公司 林松青 雷青松 主管会计工作负责人 会计机构负责人

事项评估及反馈主要包括组合内同一投资标的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估...

根据财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率...

上半年国内通胀水平缓慢回落,同时经济增长出现放缓迹象,中国人民银行在2月-7月下调了两次基准利率...

根据财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税...

年初本基金增加了高收益信用债的仓位,适度投资于中期票据,较少参与转债投资。报告期内,本基金对持仓品种进行了结构性优化...

根据财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税...

截至2012年6月30日,本基金份额净值为1.072元,份额累计净值为1.102元。报告期内,本基金份额净值增长率为7.64%...

根据财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税...

未来,本基金将继续关注通胀水平、经济增长、信贷增长以及货币政策方面的变化对市场可能带来的影响...

根据财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税...

本基金经理人林松青、基金经理人雷青松、基金经理人林松青、基金经理人雷青松、基金经理人林松青、基金经理人雷青松...

根据财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税...

6.4.7有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 本基金本报告期无需要说明的其他事项

7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

7.2期末按行业分类的股票投资组合 注:本基金本报告期末未持有股票投资。

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 注:本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4.1期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额

7.4.2期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额

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

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

7.4.4期末按品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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五名债券投资明细 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张)

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。

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五名权证投资明细 注:本基金本报告期末未持有权证。

7.9投资组合报告附注 7.9.1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...

7.9.2申明本基金投资的前十名股票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。

7.9.3申明本基金投资的前十名债券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。

7.9.4申明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。

7.9.5期末其他各项资产构成 单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.6期末持有的处于转股期的可转换债券明细 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值

7.9.7期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 注:本基金本报告期末未持有股票投资。

7.9.8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。

8 期末基金份额持有人户数及持有人结构 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值

8.1期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 基金份额, 持有份额总(份), 占基金总份额比例(%)

8.2期末本基金管理人的从业机构持有本基金的情况 金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 基金份额, 持有份额总(份), 占基金总份额比例(%)

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金。 2、本基金的基金经理未持有本基金。

9 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 3 columns: 基金合同生效日(2011年05月23日)基金份额, 富国天盈分级债券A, 富国天盈分级债券B

注:本基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

10 重大事件揭示 10.1基金份额持有人大会决议 本报告期本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2基金经理、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变 本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况 本报告期本基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 金额单位:人民币元

Table with 10 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期成交金额比例(%)

注:1、我公司对基金交易单元的选用是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2、本期内本基金租用券商交易单元的变更情况:新增广发证券(上海:36138, 深圳:391616)、国信证券(上海:26178, 深圳:391663);退租中邮证券(深圳:390458)。

富国基金管理有限公司 2012年8月25日

6.1 资产负债表 单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 期末(2012年06月30日), 上年度期末(2011年12月31日)

Table with 2 columns: 负债和所有者权益, 期末(2012年06月30日), 上年度期末(2011年12月31日)

注:报告截止日2012年06月30日, 基金份额净值1.072元, 基金份额总额3,504,641.9307份。

6.2 利润表 单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期(2012年01月01日至2012年06月30日), 上年同期(2011年05月23日至2011年06月30日)

注:本基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下: H=E×0.70%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值

6.4.5.2.3 销售服务费 单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期(2012年01月01日至2012年06月30日), 上年同期(2011年05月23日至2011年06月30日)

注:本基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

10.1 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.2 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.3 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.4 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.5 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.6 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.7 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.8 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.9 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。

10.10 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日经国家工商行政管理总局登记注册成立。