富国天益价值证券投资基金

2014 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：	交通银行股份有限公司
报告送出日期：	2014年07月18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2014年7月16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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天益价值股票
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)	6,853,201,682.86
投资目标	本基金属价值型基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票，或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，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。
投资策略	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。根据基金经理对股票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，并进行动态配比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。
业绩比较基准	95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
风险收益特征	本基金为价值型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	-111,052,318.38
2.本期利润	161,700,822.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0232
4.期末基金资产净值	5,959,648,582.24
5.期末基金份额净值	0.8696

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。

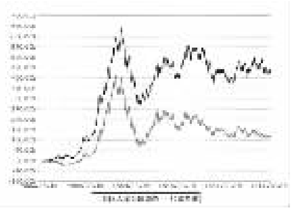
3.2 基金净值表现

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

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	2.75%	0.80%	1.04%	0.81%	1.71%	-0.01%

注：过去三个月指2014年4月1日－2014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2014年6月30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。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大，建仓期3个月，从2007年11月5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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓铭	本基金基金经理兼任富国天源平衡混合型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金基金经理	2014-04-15	-	10年	硕士，曾任华富基金管理有限公司行业研究员，2006年4月至2009年10月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，富国天博创新主题股票型证券投资基金基金经理助理，2009年10月至今任富国天源基金经理，2011年8月起任富国低碳环保股票型证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国天益价值证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
陈戈	本基金前任基金经理	2005-04-13	2014-04-15	18年	硕士，曾任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员；2000年10月任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管，研究策划部经理，总经理助理。2005年4月至2014年4月任富国天益基金经理，现任公司总经理。具有基金从业资格。

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、力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，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、交易对手库及授权管理，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，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现3次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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季度宏观经济开始略有下滑，但是政府很快及时出台微刺激政策进行了对冲，市场对经济的预期也在季度内发生了较大的变化，市场开始增强了对今年经济实现7.5%的信心，市场窄幅波动。

鉴于本基金规模因素，2季度我们重点调整方向在基金的持股集中度，在坚持本基金的投资理念基础上，对个股适度进行分散投资，以获得更大的信息比率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为2.75%，同期业绩比较基准收益率为1.04%。

§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	5,400,076,771.23	90.25
	其中：股票	5,400,076,771.23	90.25
2	固定收益投资	150,609,245.20	2.52
	其中：债券	150,609,245.20	2.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	158,600,557.90	2.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	267,126,596.14	4.46
7	其他资产	7,379,419.86	0.12
8	合计	5,983,792,590.33	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	162,599,420.34	2.73
B	采矿业	33,367,444.35	0.56
C	制造业	3,327,220,170.28	55.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	29,325,225.12	0.49
F	批发和零售业	427,703,012.42	7.18
G	交通运输、仓储和邮政业	18,486,512.70	0.31
H	住宿和餐饮业	18,966,628.77	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	673,453,932.60	11.30
J	金融业	349,585,846.82	5.87
K	房地产业	201,758,471.53	3.39
L	租赁和商务服务业	34,249,485.60	0.57
M	科学研究和技术服务业	41,614,954.50	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,384,994.25	0.02
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	80,360,671.95	1.35
S	综合	-	-
	合计	5,400,076,771.23	90.61

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	002153	石基信息	10,149,976	520,693,768.80	8.74
2	000581	威孚高科	13,600,000	366,792,000.00	6.15
3	600519	贵州茅台	2,540,915	360,759,111.70	6.05
4	600309	万华化学	14,991,004	227,263,620.64	3.81
5	000423	东阿阿胶	6,000,000	199,920,000.00	3.35
6	002422	科伦药业	4,800,000	191,280,000.00	3.21
7	000895	双汇发展	4,600,000	164,634,000.00	2.76
8	000712	锦龙股份	10,667,876	159,271,388.68	2.67
9	600208	新湖中宝	52,000,000	151,840,000.00	2.55
10	002271	东方雨虹	5,901,331	146,648,075.35	2.46

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	0.84
	其中：政策性金融债	50,010,000.00	0.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	100,599,245.20	1.69
8	其他	-	-
9	合计	150,609,245.20	2.53

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

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	110023	民生转债	850,000	78,880,000.00	1.32
2	130236	13国开36	500,000	50,010,000.00	0.84
3	110015	石化转债	201,160	21,719,245.20	0.36

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。

5.7 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

本基金持有的科伦药业于2014年6月5日公告其于2014年6月3日收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2014]49号），中国证监会已查明科伦药业信息披露违法事实并决定实施行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,189,119.00
2	应收证券清算款	3,744,117.35
3	应收股利	-
4	应收利息	2,232,838.45
5	应收申购款	213,345.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,379,419.86

5.11.4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	110023	民生转债	78,880,000.00	1.32
2	110015	石化转债	21,719,245.20	0.36

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6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	7,087,197,972.90
报告期期间基金总申购份额	36,357,025.64
减：报告期期间基金总赎回份额	270,353,315.68
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	6,853,201,682.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国天益价值证券投资基金的文件
2、富国天益价值证券投资基金基金合同
3、富国天益价值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、富国天益价值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

8.2 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

8.3 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
2014年07月18日

富国天盈债券型证券投资基金（LOF）

2014 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：	2014年07月18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2014年7月16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。

根据《基金合同》的有关规定，富国天盈分级债券型证券投资基金在《基金合同》生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会，已自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称已变更为"富国天盈债券型证券投资基金(LOF)"，天盈A、天盈B的基金份额已转换为上市开放式基金(LOF)份额。

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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天盈债券(LOF)(场内简称：富国天盈)
基金主代码	161015
交易代码	161015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年05月23日
报告期末基金份额总额(单位：份)	2,958,356,679.22
投资目标	在追求基金资产长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用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。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
业绩比较基准	中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，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，其预期风险与预期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	中国工商银行股份有限公司

注：根据《基金合同》的有关规定，富国天盈分级债券型证券投资基金在《基金合同》生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会，已自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称已变更为"富国天盈债券型证券投资基金（LOF）"，天盈A、天盈B的基金份额已转换为上市开放式基金（LOF）份额。

§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(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	11,169,828.91
2.本期利润	67,749,753.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0311
4.期末基金资产净值	2,391,942,703.16
5.期末基金份额净值	0.809

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。

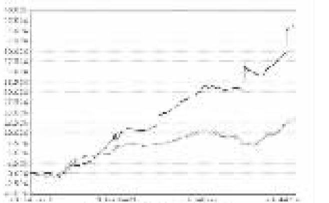
3.2基金净值表现

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

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	7.63%	0.58%	3.28%	0.08%	4.35%	0.50%

注：过去三个月指2014年4月1日－2014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2014年6月30日。

本基金合同生效日为2011年5月23日，本基金建仓期6个月，即从2011年5月23日起至2011年11月22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		
饶刚	本基金基金经理兼任固定收益投资部总经理、富国资产管理(上海)有限公司总经理、富国天利增长债券投资基金基金经理、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金经理、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理、富国目标收益两年期纯债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	2014-03-26	-	16年	硕士，曾任职兴业证券股份有限公司研究部职员、投资银行部职员；2003年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，2006年1月至今任富国天利基金经理，2008年10月起兼任富国天丰基金经理，2010年9月至2013年9月兼任富国汇利分级债券基金经理，2013年9月起兼任富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金经理，2013年6月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2013年9月起任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2014年3月起任富国天盈分级债券型证券投资基金(2014年5月更名为富国天盈债券型证券投资基金(LOF))基金经理，2014年6月起任富国产业债债券型证券投资基金基金经理。兼任固定收益投资部总经理和富国资产管理(上海)有限公司总经理。。具有基金从业资格。

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盈债券型证券投资基金（LOF）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》、《富国天盈分级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、交易对手库及授权管理，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，报告期内本组合与其他投资组合之间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。

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

二季度货币市场保持充裕的流动性，债市进一步走牛，城投债和长久期利率债涨幅较大。信用风险溢价整体回落，但部分产业和个体企业的信用担忧仍然较大。城投债继产业债之后，也开始呈现信用分化的局面。本基金5月后转为开放式运作方式，期间平衡了流动性和组合收益的目标，在平稳过渡的情况下分享市场上涨的收益。

未来，本基金将继续以"信用优先"为前提，通过更深入的研究和实地调研，挖掘各类板块和个券的投资机会，力争为投资者带来长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为7.63%，同期业绩比较基准收益率为3.28%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,831,400,993.77	92.92
	其中：债券	2,831,400,993.77	92.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	151,669,715.18	4.98
7	其他资产	64,190,650.67	2.11
8	合计	3,047,261,359.62	100.00

5.2 报告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。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	120,036,000.00	5.02
	其中：政策性金融债	120,036,000.00	5.02
4	企业债券	2,225,148,005.37	93.03
5	企业短期融资券	59,910,000.00	2.50
6	中期票据	281,136,000.00	11.75
7	可转债	145,170,988.40	6.07
8	其他	-	-
9	合计	2,831,400,993.77	118.37

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

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	130418	13农发18	1,200,000	120,036,000.00	5.02
2	1480209	14雨花城投债	700,000	71,687,000.00	3.00
3	101454029	14淄博城运MTN002	700,000	70,035,000.00	2.93
4	124840	14漳九龙	600,000	60,000,000.00	2.51
5	041461039	14华信资产CP001	600,000	59,910,000.00	2.50

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。

5.7 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

本基金持有的平安转债发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司于2013年10月15日公告控股子公司平安证券近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48号），中国证监会决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入，并处罚款，暂停其保荐业务许可3个月。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余九名证券的发行主体本期未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。

5.11.2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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	216,940.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,976,663.67
5	应收申购款	5,997,046.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,190,650.67

5.11.4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	113005	平安转债	45,932,600.00	1.92
2	110018	国电转债	31,046,056.40	1.30
3	110020	南山转债	26,001,043.20	1.09
4	113001	中行转债	10,179,000.00	0.43
5	113003	重工转债	10,149,992.80	0.42
6	110023	民生转债	4,640,000.00	0.19

5.11.5报告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。

5.11.6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	1,829,581,720.29
报告期期间基金总申购份额	2,677,925,092.23
减：报告期期间基金总赎回份额	1,934,763,896.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	385,613,763.19
报告期期末基金份额总额	2,958,356,679.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国天盈分级债券型证券投资基金的文件
2、富国天盈分级债券型证券投资基金基金合同
3、富国天盈分级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、富国天盈分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注
6、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注
7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 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

8.3 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
2014年07月18日

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金
(原汉盛证券投资基金转型)

2014 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：	2014年07月18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2014年7月16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。

自2014年4月30日汉盛证券投资基金终止上市日起，原汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。原汉盛证券投资基金报告期为2014年4月1日至2014年4月29日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金报告期为2014年4月30日至2014年6月30日。

§2 基金产品概况

2.1 原富国汉盛封闭

基金简称	富国汉盛封闭
基金主代码	500005
交易代码	500005
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年05月10日
报告期末基金份额总额(单位：份)	2,000,000,000.00
投资目标	为投资者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的投资收益。
投资策略	"精选品种、组合投资、长线持有、波段操作"，通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴，同时依据"顺势而为"的原则进行一些短线操作。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
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

2.2 富国天盛灵活配置混合

基金简称	富国天盛灵活配置混合
基金主代码	000634
交易代码	000634
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年04月30日
报告期末基金份额总额(单位：份)	1,653,976,030.52
投资目标	本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择，实现基金资产较高的长期回报。
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、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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	转型前(2014年4月1日到2014年4月29日)	转型后(2014年4月30日到2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-406,585.85	12,916,339.07
2.本期利润	-31,274,047.51	95,511,820.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0156	0.0525
4.期末基金资产净值	2,016,141,643.57	1,740,375,823.65
5.期末基金份额净值	1.0081	1.052

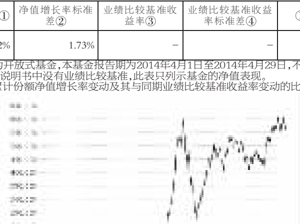
3.2 原富国汉盛封闭基金净值表现

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
自基金合同生效日起至今	-1.52%	1.73%	-	-	-	-

注：本基金于2014年4月30日转型为开放式基金，本基金报告期为2014年4月1日至2014年4月29日，不足一季。由于基金汉盛在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表只列示基金的净值表现。

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：本图中所示时间区间为1999年5月10日至2014年4月29日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。

本基金于1999年5月10日成立，建仓期6个月，从1999年5月10日至1999年11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。

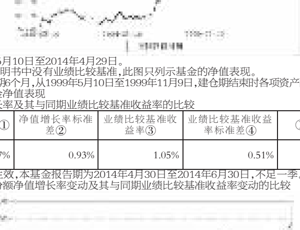
3.3 富国天盛灵活配置混合基金净值表现

3.3.1 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
自基金合同生效日起至今	6.77%	0.93%	1.05%	0.51%	5.72%	0.42%

注：本基金合同于2014年4月30日生效，本基金报告期为2014年4月30日至2014年6月30日，不足一季。

3.3.2 自基金转型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：1、本图中所示时间区间为2014年4月30日至2014年6月30日，本基金自基金转型日至图表截止日不足一年。

2、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金由汉盛证券投资基金转型而成。基金转型经2014年3月6日至2014年4月8日汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案（证券基金机构监管部部函[2014]67号）。自2014年4月30日起，汉盛证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、富国基金管理有限公司以2014年6月4日为份额折算基准日对投资者持有的原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算操作。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为1.015元，精确到小数点后第9位为1.014909401元（第10位舍去），本基金管理人按照1.014909401的折算比例对原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为1.000元，折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用循环进位法保留到小数点后两位，折算后基金份额总额为1，834，804，944.82份。

4、本基金于2014年4月30日由原汉盛证券投资基金转型而成，建仓期6个月，截止至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§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		
袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-04-30	-	8年	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师、首席策略分析师；2011年3月至今任富国基金管理有限公司首席经济学家，2011年3月至2012年10月任基金经理助理，2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：袁宜先生自2012年10月12日起担任汉盛证券投资基金基金经理；2014年4月30日汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金，袁宜先生继续担任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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自2014年4月1日至2014年4月29日作为原汉盛证券投资基金的管理人、自2014年4月30日至2014年6月30日作为转型后的富国天盛灵活配置混合型证券投资基金的管理人，分别按照转型前后的《汉盛证券投资基金基金合同》、《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，并严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》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、力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，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、交易对手库及授权管理，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

（1）自2014年4月1日至2014年4月29日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，报告期内汉盛证券投资基金与其他投资组合之间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。

（2）自2014年4月30日至2014年6月30日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，报告期内富国天盛灵活配置混合型证券投资基金与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现4次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

今年二季度，中国的房地产市场呈现量价齐跌态势，拖累房地产投资增速下行，同时，政府加强了宏观政策的对冲力度，持续预调微调，财政货币政策偏于宽松。综合正反两方面因素的影响，中国经济在二季度表现基本平稳。

在此背景下，A股市场的表现也基本平稳，波幅几乎创下历史最低。而沪港通、新股发行等事件，曾给市场带来阶段性的冲击。

汉盛证券投资基金在4月底走完了15年的历程，转型为开放式的富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。在度过了5月份集中申购期后，本基金逐步加仓，6月集中配置了成长股板块。展望未来，在经济同比增速回升以前，看好流动性宽松对成长股的推动；随着经济同比增速的回升以及沪港通的兑现，蓝筹板块值得配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年4月1日至2014年4月29日，汉盛证券投资基金净值增长率为-1.52%；2014年4月30日至2014年6月30日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金净值增长率6.77%，同期业绩比较基准收益率1.05%。

§5 原富国汉盛封闭投资组合报告

5.1 转型前最后一日基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,007,692,357.13	49.59
	其中：股票	1,007,692,357.13	49.59
2	固定收益投资	810,581,433.30	39.89
	其中：债券	810,581,433.30	39.89
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	192,775,453.60	9.49
7	其他资产	21,002,028.29	1.03
8	合计	2,032,051,272.32	100.00

5.2 转型前最后一日按行业分类的股票投资组合

5.3 转型前最后一日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	600703	三安光电	7,832,593	186,259,061.54	9.24
2	000712	锦龙股份	2,839,429	76,068,302.91	3.77
3	300085	银之杰	5,065,222	74,712,024.50	3.71
4	002520	日发精机	2,082,214	55,053,738.16	2.73
5	600340	华夏幸福	1,599,376	40,640,144.16	2.02
6	002405	四维图新	2,546,738	39,296,167.34	1.95
7	300129	泰胜风能	3,078,818	37,869,461.40	1.88
8	600584	长电科技	4,880,428	36,310,384.32	1.80
9	002415	海康威视	1,813,110	33,433,748.40	1.66
10	000961	中南建设	4,755,172	32,144,962.72	1.59

5.4 转型前最后一日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	8,791,200.00	0.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	783,906,000.00	38.88
	其中：政策性金融债	783,906,000.00	38.88
4	企业债券	17,679,941.10	0.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	204,292.20	0.01
8	其他	-	-
9	合计	810,581,433.30	40.20

5.5 转型前最后一日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	140317	14进出17	1,000,000	99,880,000.00	4.95
2	130227	13国开27	800,000	79,976,000.00	3.97
3	090304	09进出04	700,000	69,944,000.00	3.47
4	130236	13国开36	600,000	60,042,000.00	2.98
5	130428	13农发28	500,000	50,110,000.00	2.49

5.6 转型前最后一日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 转型前最后一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 转型前最后一日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 转型前最后一日本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 转型前最后一日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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 转型前最后一日本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2转型前最后一日本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,972,773.43
2	应收证券清算款	3,055,795.96
3	应收股利	-
4	应收利息	15,973,458.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,002,028.29

5.11.4 转型前最后一日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	113003	重工转债	9,510.30	0.00
2	110015	石化转债	3,078.30	0.00

5.11.5 转型前最后一日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	000712	锦龙股份	76,068,302.91	3.77	问题核查
2	300085	银之杰	74,712,024.50	3.71	筹划重大事项
3	002520	日发精机	55,053,738.16	2.73	筹划重大事项
4	002405	四维图新	39,296,167.34	1.95	筹划重大事项

5.11.6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 富国天盛灵活配置混合投资组合报告

6.1 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	1,522,465,854.29	86.97
	其中：股票	1,522,465,854.29	86.97
2	固定收益投资	101,544,589.50	5.80
	其中：债券	101,544,589.50	5.80
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	90,322,585.11	5.16
7	其他资产	36,213,738.96	2.07
8	合计	1,750,546,767.86	100.00

6.2 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	19,946,067.62	1.15
B	采矿业	12,863,031.80	0.74
C	制造业	785,977,907.56	45.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,218,456.03	0.30
F	批发和零售业	7,394,978.80	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	30,562,298.54	1.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	396,955,728.81	22.81
J	金融业	64,289,322.60	3.69
K	房地产业	123,223,618.87	7.08
L	租赁和商务服务业	9,116,330.76	0.52
M	科学研究和技术服务业	895,215.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	26,187,962.10	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,006,910.30	0.86
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	24,828,025.50	1.43
S	综合	-	-
	合计	1,522,465,854.29	87.48

6.3 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	600703	三安光电	2,949,364	69,103,598.52	3.97
2	300129	泰胜风能	4,198,036	56,883,387.80	3.27
3	300085	银之杰	3,168,776	54,851,512.56	3.15
4	000712	锦龙股份	3,533,426	52,754,050.18	3.03
5	600340	华夏幸福	1,898,929	47,796,042.93	2.75
6	000671	阳光城	5,429,270	47,723,283.30	2.74
7	002153	石基信息	888,313	45,570,456.90	2.62
8	300170	汉得信息	3,143,468	40,550,737.20	2.33
9	002085	万丰奥威	1,695,442	36,045,096.92	2.07
10	002475	立讯精密	1,019,389	33,415,571.42	1.92

6.4 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	8,870,400.00	0.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	78,096,000.00	4.49
	其中：政策性金融债	78,096,000.00	4.49
4	企业债券	14,578,189.50	0.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	101,544,589.50	5.83

6.5 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	140316	14进出16	500,000	48,960,000.00	2.81
2	110226	11国开26	300,000	29,136,000.00	1.67
3	122009	08新湖债	144,410	14,578,189.50	0.84
4	010107	21国债(7)	88,000	8,870,400.00	0.51

6.6 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。

6.7 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

6.8 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。

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.9.1 报告期末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。

6.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.10.1本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

6.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

6.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1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。

6.11.2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。

6.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,472,673.64
2	应收证券清算款	32,536,078.02
3	应收股利	-
4	应收利息	2,096,087.69
5	应收申购款	100,985.22
6	其他应收款	7,914.39
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,213,738.96

6.11.4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。

6.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6.11.6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。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日基金份额总额	2,000,000,000.00
基金转型日至报告期末基金总申购份额	112,578,741.36
基金转型日至报告期末基金总赎回份额	484,513,881.62
基金转型日至报告期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)(份额减少以"-"填列)	25,911,170.78
报告期期末基金份额总额	1,653,976,030.52

注：基金转型日为2014年4月30日。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

8.1.1 原富国汉盛封闭基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.50

注：原汉盛证券投资基金报告期为2014年4月1日至2014年4月29日。

8.1.2 富国天盛灵活配置混合基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	149,094.02
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,149,094.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.61

注：1、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金报告期为2014年4月30日至2014年6月30日。

2、以2014年6月4日为份额折算基准日进行基金份额折算后，基金管理人持有本基金份额增至10，149，094.02份。上表中"报告期期间买入/申购总份额"一栏所示的份额数系折算所得，基金管理人并未运用固有资金申赎及买卖富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：2014年4月1日至2014年4月29日未运用固有资金申赎及买卖汉盛证券投资基金，2014年4月30日至2014年6月30日本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金由汉盛证券投资基金转型而成。基金转型经2014年3月6日至2014年4月8日汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案（证券基金机构监管部部函[2014]67号）。自2014年4月30日起，由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《汉盛证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立汉盛证券投资基金的文件
2、汉盛证券投资基金基金合同
3、汉盛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、汉盛证券投资基金财务报表及报表附注
6、中国证监会《关于汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》
7、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同
8、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金托管协议
9、富国天盛灵活配置混合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

10.2 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

10.3 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
2014年07月18日