富国天利增长债券投资基金

2012 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：	2013年03月26日

§1 重要提示及目录

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2013年3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	富国天利增长债券
基金主代码	100018
交易代码	前端交易代码：100018 后端交易代码：100019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月02日
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
报告期末基金份额总额	1,515,936,499.48份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金为主要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本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。
投资策略	久期控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，属于低风险的基金品种。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟娉	赵会军
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686，4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	112,507,603.30	26,404,345.97	281,279,012.99
本期利润	193,485,573.32	-95,937,321.62	276,581,733.82
加权平均基金份额本期利润	0.1086	-0.0415	0.0974
本期基金份额净值增长率	9.74%	-3.45%	7.99%
3.1.2期末数据和指标	2012年12月31日	2011年12月31日	2010年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0252	-0.0132	0.0312
期末基金资产净值	1,877,014,087.27	2,337,697,567.84	3,048,899,292.71
期末基金份额净值	1.2382	1.1517	1.2427

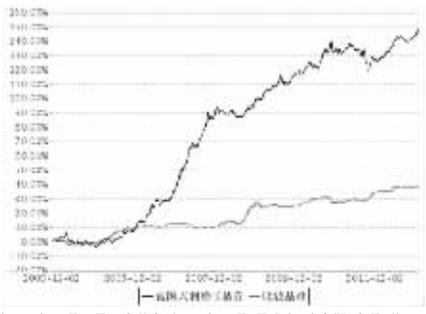
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

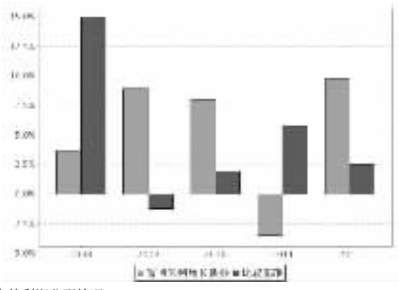
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.63%	0.12%	0.56%	0.03%	3.07%	0.09%
过去六个月	2.93%	0.11%	0.16%	0.05%	2.77%	0.06%
过去一年	9.74%	0.14%	2.51%	0.07%	7.23%	0.07%
过去三年	14.42%	0.24%	10.46%	0.09%	3.96%	0.15%
过去五年	29.20%	0.23%	25.32%	0.13%	3.88%	0.10%
自基金合同生效日起至今	148.69%	0.29%	38.58%	0.17%	110.11%	0.12%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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12月31日。本基金于2003年12月2日成立，建仓期6个月，从2003年12月2日至2004年6月1日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本图所示时间区间为2003年12月2日起至2012年12月31日止。

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	0.250	21,425,156.22	22,257,657.89	43,682,814.11	2次分红
2011年	0.500	53,046,433.51	67,655,029.83	120,701,463.34	3次分红
2010年	1.250	169,600,273.52	160,126,154.29	329,726,427.81	5次分红
合计	2.000	244,071,863.25	250,038,842.01	494,110,705.26	10次分红

§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管理公司之一，公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止2012年12月31日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金三十二只证券投资基金。

4.1.2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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
饶刚	本基金基金经理兼任公司总经理助理、固定收益部总经理、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理	2006-01-12	-	14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月起兼任富国汇利分级债券基金经理。兼任富国基金公司总经理助理、固定收益部总经理。具有基金从业资格，中国国籍。
陈曙亮	本基金基金经理兼任富国可转换债券证券投资基金基金经理、富国优化增强债券基金基金经理	2012-07-02	-	5年	硕士，2008年6月至2012年1月任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员；2012年2月至4月任富国基金管理有限公司年金投资经理，2012年7月任富国天利增长债券投资基金基金经理、富国可转换债券证券投资基金基金经理；2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
杨贵宾	本基金前任基金经理。	2009-09-01	2012-06-20	8年	博士，2005年9月任富国基金管理有限公司债券研究员、策略分析师；2009年3月至2010年6月任富国天时基金经理；2009年9月至2012年6月任富国天利基金经理；2010年12月至2012年6月任富国可转债基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、本公司分别于2012年6月20日、7月2日在中国证券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，增聘陈曙亮先生担任本基金基金经理，与饶刚先生共同管理本基金。

4.2管理人对报告期内本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作为富国天利增长债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》、《富国天利增长债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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3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管理人对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

2012年，天利的表现相对较好。这主要受益于自去年伊始的信用债行情，年中虽然受流动性和供给的影响，债券收益率出现小幅上升，但通过仓位适时的调整，规避风险，增强了组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为1.2382元，份额累计净值为2.0632元。报告期内，本基金份额净值增长率为9.74%，同期业绩比较基准收益率为2.51%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2013年国内经济企稳，缓慢复苏。GDP同比增速略有回升但幅度不大。通胀水平仍然保持相对可控的状态，债券的收益率可能在当前的估值中枢上下的相对较小区域变动。

我们对于信用债的投资仍然以精选个券为主，转债投资保持适度的灵活性，力争给投资者带来确定的回报。

4.6管理人对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成立了估值委员会，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关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金对2012年报告期内利润共进行三次收益分配。分别于2012年7月4日公告每10份基金份额派发红利0.10元；2012年10月11日公告每10份基金份额派发红利0.15元；2013年1月10日公告每10份基金份额派发红利0.25元；本基金共计派发2012年度红利82,728,726.78元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012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，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。本报告期内，富国天利增长债券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配，分配金额为43,682,814.11元。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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年年度报告中财务指标、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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2013年3月22日

§6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：富国天利增长债券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末（2012年12月31日）	上年度末（2011年12月31日）
资 产：		
银行存款	7,354,518.92	31,919,932.07
结算备付金	47,177,061.33	23,040,444.74
存出保证金	380,616.93	598,780.49
交易性金融资产	3,255,609,221.98	2,999,096,009.01
其中：股票投资	119,516,690.61	56,778,309.14
基金投资	-	-
债券投资	3,136,092,531.37	2,942,317,699.87
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	313,121,658.26	68,951,906.96
应收利息	82,273,104.38	61,831,910.92
应收股利	-	-
应收申购款	2,079,500.95	181,982.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,707,995,682.75	3,185,620,966.94
负债和所有者权益	本期末（2012年12月31日）	上年度末（2011年12月31日）
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,822,925,671.45	839,300,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,238,690.21	2,659,866.11
应付管理人报酬	1,303,538.69	1,624,829.91
应付托管费	325,884.68	406,207.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	249,121.17	306,601.23
应交税费	1,999,941.31	1,891,341.14
应付利息	200,922.18	1,004,010.90
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	737,825.79	730,542.32
负债合计	1,830,981,595.48	847,923,399.10
所有者权益：		
实收基金	1,515,936,499.48	2,029,779,626.87
未分配利润	361,077,587.79	307,917,940.97
所有者权益合计	1,877,014,087.27	2,337,697,567.84
负债和所有者权益总计	3,707,995,682.75	3,185,620,966.94

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值1.2382元，基金份额总额1,515,936,499.48份。

7.2利润表

会计主体：富国天利增长债券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）
一、收入	250,968,884.62	-37,191,451.55
1.利息收入	124,814,117.41	127,762,881.68
其中：存款利息收入	1,076,472.88	1,286,506.57
债券利息收入	123,454,104.23	123,466,042.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	283,540.30	3,010,332.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	44,487,394.54	-43,618,143.90
其中：股票投资收益	172,141.65	27,781,257.61
基金投资收益	-	-
债券投资收益	44,291,612.37	-72,403,721.89
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	23,640.52	1,004,320.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	80,977,970.02	-122,341,667.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	689,402.65	1,005,478.26
减：二、费用	57,483,311.30	58,745,870.07
1.管理人报酬	17,137,547.44	22,124,345.99
2.托管费	4,284,386.86	5,531,086.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,395,853.57	2,164,412.77
5.利息支出	34,409,594.34	28,685,762.73
其中：卖出回购金融资产支出	34,409,594.34	28,685,762.73
6.其他费用	255,929.09	240,262.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	193,485,573.32	-95,937,321.62
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	193,485,573.32	-95,937,321.62

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天利增长债券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,029,779,626.87	307,917,940.97	2,337,697,567.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	193,485,573.32	193,485,573.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-513,843,127.39	-96,643,112.39	-610,486,239.78
其中：1.基金申购款	542,842,085.33	112,629,703.89	655,471,789.22
2.基金赎回款	-1,056,685,212.72	-209,272,816.28	-1,265,958,029.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-43,682,814.11	-43,682,814.11
五、期末所有者权益（基金净值）	1,515,936,499.48	361,077,587.79	1,877,014,087.27
项目	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,453,506,743.69	595,392,549.02	3,048,899,292.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-95,937,321.62	-95,937,321.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-423,727,116.82	-70,835,823.09	-494,562,939.91
其中：1.基金申购款	1,038,168,723.10	207,046,543.34	1,245,215,266.44
2.基金赎回款	-1,461,895,839.92	-277,882,366.43	-1,739,778,206.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-120,701,463.34	-120,701,463.34
五、期末所有者权益（基金净值）	2,029,779,626.87	307,917,940.97	2,337,697,567.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

窦玉明　　林志松　　雷青松

基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.2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。

7.4.3关联方关系

关联方名称	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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（“申银万国”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立.

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	159,474,452.68	80.74	448,872,586.22	57.47
申银万国	38,039,916.42	19.26	332,237,349.49	42.53

7.4.4.1.2权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易

7.4.4.1.3债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	6,110,190,965.43	66.44	3,841,094,223.83	69.90
申银万国	3,086,950,679.95	33.56	1,653,810,938.87	30.10

7.4.4.1.4回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	44,943,287,000.00	53.49	26,870,588,000.00	38.14
申银万国	39,079,043,000.00	46.51	43,578,755,000.00	61.86

7.4.4.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	689,319.94	68.33	98,492.05	41.85
申银万国	319,481.47	31.67	136,871.42	58.15
关联方名称	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	715,056.65	62.79	282,784.74	95.69
申银万国	423,722.23	37.21	12,745.24	4.31

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除由证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	17,137,547.44	22,124,345.99
其中：支付销售机构的客户维护费	995,663.20	1,036,417.01

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.80%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）	上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	4,284,386.86	5,531,086.58

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期（2012年01月01日至2012年12月31日）							
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购		
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	
中国工商银行	-	55,826,458.74	-	-	-	-	-
上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）							
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购		
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	
-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2012年01月01日至2012年12月31日）		上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	7,354,518.92	511,960.97	31,919,932.07	774,985.60

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	
600815	厦工股份	2012-12-26	2013-01-08	认购增发证券	6.42	6.99	17,098,239	109,770,694.38	119,516,690.61	-

7.4.5.1.2受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
112137	12康得债	2012-12-18	2013-02-08	认购新发证券	100.00	100.00	95,450	9,545,000.00	9,545,000.00	
112142	12格林债	2012-12-24	2013-01-24	认购新发证券	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	
124038	12远洲控	2012-12-05	2013-02-06	认购新发证券	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币303,899,144.15元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
080301	08进出01	2013-01-04	100.34	500,000	50,170,000.00
090203	09国开03	2013-01-04	98.65	500,000	49,325,000.00
100409	10农发09	2013-01-04	94.98	400,000	37,992,000.00
110320	11进出20	2013-01-04	98.20	500,000	49,100,000.00
120228	12国开28	2013-01-04	99.77	700,000	69,839,000.00
1001037	10央行票据37	2013-01-04	99.95	500,000	49,975,000.00
合计				3,100,000.00	306,401,000.00

7.4.5.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,519,026,527.30元，于2013年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.6有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	119,516,690.61	3.22
	其中：股票	119,516,690.61	3.22
2	固定收益投资	3,136,092,531.37	84.58
	其中：债券	3,136,092,531.37	84.58
	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	54,531,580.25	1.47
6	其他各项资产	397,854,880.52	10.73
7	合计	3,707,995,682.75	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	119,516,690.61	6.37
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	-	-
C7	机械、设备、仪表	119,516,690.61	6.37
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	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-