

## 富国天盈分级债券型证券投资基金

## 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股份有限公司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           | 富国天盈分级债券(场内简称:富国天盈)                                                                            |
|----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金代码           | 161015                                                                                         |
| 基金运作方式         | 契约型。本基金《基金合同》生效之日起3年内,天盈A(基金合同)生效之日起每满6个月开放一次,天盈B封闭运作并上市交易;本基金《基金合同》生效后3年内,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。 |
| 基金合同生效日        | 2011年05月23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     | 2,740,682,011.11份                                                                              |
| 基金合同存续期        | 不定期                                                                                            |
| 基金份额上市的证券交易所   | 深圳证券交易所                                                                                        |
| 上市日期           | 2011年7月8日                                                                                      |
| 下属两级基金的基金简称    | 天盈A 天盈B                                                                                        |
| 下属两级基金的交易代码    | 161016 150041                                                                                  |
| 报告期末下属两级基金份额总额 | 1,689,202,662.70份 1,051,479,348.41份                                                            |

## 2.2 基金产品说明

| 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,根据对属资产配置策略对投资组合类属资产进行优化配置和调整。 |
| 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。                                                                    |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 天盈A份额表现出低风险、收益相对稳定的特征;天盈B份额表现出较高风险、收益相对较高的特征。                                                                                               |

## 2.3 基金管理人及基金托管人

| 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: 曹伟<br>联系电话: 021-20361818<br>电子邮箱: public@fulgoal.com.cn | 姓名: 赵会<br>联系电话: 010-66105799<br>电子邮箱: cstudy@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  | 9510566 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.fulgoal.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<br>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

| 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: 曹伟<br>联系电话: 021-20361818<br>电子邮箱: public@fulgoal.com.cn | 姓名: 赵会<br>联系电话: 010-66105799<br>电子邮箱: cstudy@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  | 9510566 4008880688                                          | 95588                                                    |
| 传真      | 021-20361616                                                | 010-66105798                                             |

| 3.1.1期间数据和指标 | 2012年            | 2011年05月23日(基金合同生效日)至2011年12月31日 |
|--------------|------------------|----------------------------------|
| 本期已实现收益      | 301,204,916.64   | 81,135,943.13                    |
| 本期利润         | 346,176,093.41   | 79,029,698.74                    |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1148           | 0.0239                           |
| 本期基金份额净值增长率  | 12.20%           | 2.52%                            |
| 3.1.2期末数据和指标 | 2012年12月31日      | 2011年12月31日                      |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0848           | 0.0094                           |
| 期末基金资产净值     | 3,015,886,130.10 | 2,437,193,918.10                 |
| 期末基金份额净值     | 1.100            | 1.009                            |

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,封闭式基金交易佣金、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。

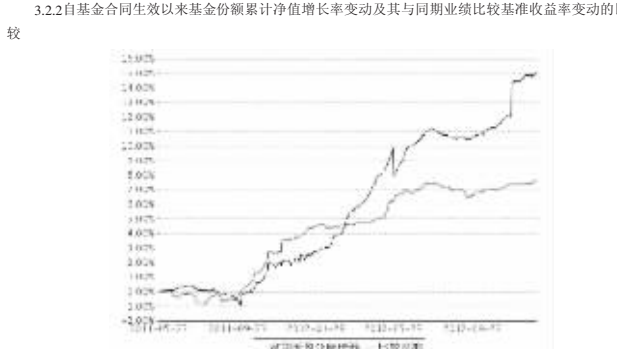
本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 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② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率④ | ①-③   | ②-④   |
|--------------|----------|----------|------------|------------|-------|-------|
| 过去三个月        | 3.85%    | 0.26%    | 0.74%      | 0.03%      | 3.11% | 0.23% |
| 过去六个月        | 4.24%    | 0.19%    | 0.58%      | 0.04%      | 3.66% | 0.15% |
| 过去一年         | 12.20%   | 0.19%    | 3.60%      | 0.06%      | 8.60% | 0.13% |
| 自基金合同生效日起至至今 | 15.03%   | 0.17%    | 7.63%      | 0.07%      | 7.40% | 0.10% |

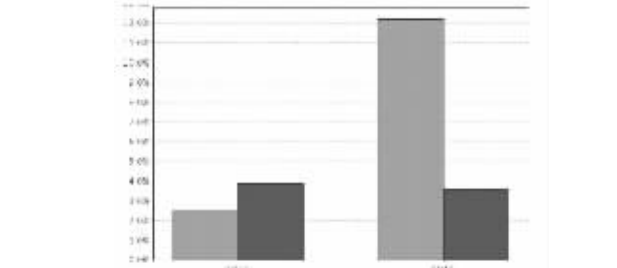
## 3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:截止日期为2012年12月31日。

本基金合同生效日为2011年5月23日,自基金建仓期6个月,即从2011年5月23日起至2012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。

## 3.2.3自基金合同生效以来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



注:本基金合同生效日为2011年5月23日,2011年净值增长率按实际存续期计算。

## 3.3 其他指标

| 其他指标                        | 本期末(2012年12月31日) |
|-----------------------------|------------------|
| 富国天盈分级债券A与富国天盈分级债券封闭B基金份额配比 | 1.60650104:1     |
| 期末富国天盈分级债券A与富国天盈分级债券参考净值    | 1.004            |
| 期末富国天盈分级债券A份额累计参考净值         | 1.076            |
| 期末富国天盈分级债券封闭B份额参考净值         | 1.055            |
| 期末富国天盈分级债券封闭B份额累计参考净值       | 1.255            |
| 富国天盈分级债券A的净值增长率             | 4.2%             |

## 3.4 过去三年基金的利润分配情况

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资总额          | 年度利润分配合计       | 备注                       |
|-------|-------------|----------|----------------|----------------|--------------------------|
| 2012年 | 0.310       | -        | 93,731,816.95  | 93,731,816.95  | 本期利润分配为天盈A根据基金合同进行的份额折算。 |
| 2011年 | 0.161       | -        | 56,269,856.21  | 56,269,856.21  | 本期利润分配为天盈A根据基金合同进行的份额折算。 |
| 2010年 | -           | -        | -              | -              | 本期利润分配为天盈A根据基金合同进行的份额折算。 |
| 合计    | 0.471       | -        | 150,001,673.16 | 150,001,673.16 |                          |

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

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公司变更登记办理完毕,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金管理公司中,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、富国天成增长债券型证券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天源瑞利纯债精选混合型证券投资基金、富国天源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、富国天颐价值证券投资基金、富国全球精选证券投资基金、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强股票型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、富国全球精选证券投资基金、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、富国全球精选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、富国新天峰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 香港上市型股票型证券投资基金、富国7天理财富宝货币型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国收益增强定期开放债券型证券投资基金三十三只证券投资基金。

## 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<br>任职日期 离任日期 | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                         |
|-----|-----------------------------------------------------|--------------------------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 刁刚  | 本基金基金经理兼任富国新天峰定期开放债券型证券投资基金基金经理、富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理 | 2011-05-23               | 6年     | 博士,曾任国泰君安证券股份有限公司固定收益部研究员、交易员,浦银安盛基金管理有限公司基金经理助理,2009年6月任富国基金管理有限公司富国天益价值证券投资基金基金经理,2010年6月至今任富国天益价值证券投资基金基金经理,2010年11月起兼任富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理,2011年5月起兼任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。 |
| 赵恒毅 | 本基金基金经理兼任富国新天峰定期开放债券型证券投资基金基金经理、富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理 | 2011-05-24               | 8年     | 硕士,曾任通用技术集团投资管理咨询有限公司研究员,2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司固定收益部研究员,2011年5月起任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理,2012年5月起任富国新天峰定期开放债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起任富国可转换债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。                        |

注: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。

证券从业的认证通过行业协会 证券业从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国天盈分级债券型证券投资基金的管理人按照《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合同》以及其他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,管理和运用基金资产,无损害基金份额持有人的利益,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和内部控制  
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》,对证券的一级市场中购、二级市场场内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的信息知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.3.2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》,对证券的一级市场中购、二级市场场内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的信息知情权,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:一、一级市场,通过标准化的办公流程,对关联方审核、价格公允性判断及对证券公平分配等相关环节进行控制;二、二级市场,通过交易系统的投资选择、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作流程进行自动化控制。

事中监控主要包括:一、一级市场,通过标准化的办公流程,对关联方审核、价格公允性判断及对证券公平分配等相关环节进行控制;二、二级市场,通过交易系统的投资选择、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作流程进行自动化控制。

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(日、3日、5日)的季度公平性交易分析评估等。一、通过公平性交易的事后分析评估,对涉及公平性交易的组合进行进行分析评估,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)内、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,需解释相关交易行为是否合理,并按规定要求上报辖区监管机构。二、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。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期,未发生异常交易行为。

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且交易规模超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

2012年上半年国内GDP增速逐季下降,通胀水平显著回落,与此同时,欧债危机在2012年继续发酵,使得全球经济复苏的前景蒙上阴影。在这样的经济背景下,中国央行采取了1项实质偏宽松的货币政策,央行在年内连续两次降息,2次下调法定存款准备金率,下半年尤其是季度开始通胀数据迹象较为明显,货币政策以实行逆回购为主,维持宽松局面。信用债市场的城投债在2-3月市场对其看法有所好转后,收益率大幅下行,成为本年度表现最佳的品种。

本基金今年年初持仓相对较高的仓位,分享了收益率快速下行的收益,7月底-8月初基金减持了部分转债类资产,一定程度上减小了8-9月市场调整带来的损失,9月底-10月初,基金增持仓位到140%附近,参与7月-11月的小牛行情。12月中基金开始小幅加仓操作。适当的杠杆操作能够提升组合收益,经过长期的债券买入,2012年末本基金存在60%左右的杠杆。本基金在转债和新增申购方面谨慎参与,严控风险。报告期内本基金的投资收益主要来自转债和新增申购的收益,以及杠杆操作带来的收入,本基金的主要贡献来自转债,部分信用的净下亏损损失是主要的负贡献来源。

4.4.2报告期内基金的投资表现  
截至2012年12月31日,本基金份额净值为1.100元,份额累计净值为1.147元,报告期内,本基金份额净值增长率为12.20%,同期业绩比较基准收益率为3.60%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的主要展望  
2013年,我们将持续关注中国国内经济增速复苏基础将进一步夯实,通胀水平维持较低水平,外围经济最大的风险仍然在欧洲债务危机。

在当前市场的环境下,我们判断国债收益率已经充分反映了经济下行和政策宽松的预期,中票的投资价值基本回到中性位置,企业债中品种的分化仍将继续,低等级品种可能受到事件冲击,本基金将继续专注于信用债的投资,注意筛选信用风险较低且收益率具有吸引力的品种,进行行业和板块分散,追求高流动性品种和低流动性品种的合理搭配。转债投资将在安全边际较高的前提下进行。

4.6 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金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会计,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供估值意见,提供和评估估值技术,执行估值决策程序,对外信息披露等工作,保证基金估值的公允性和合理性,维护基金份额持有人的利益。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 管理人报告期内基金利润分配情况的说明  
根据本基金《基金合同》约定:“本基金《基金合同》生效之日起3年内,本基金不进行收益分配”,因此本基金本期不进行收益分配。

## § 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盈分级债券型证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,富国天盈分级债券型证券投资基金的管理人—富国基金管理有限公司在富国天盈分级债券型证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,富国天盈分级债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等方面的真实、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盈分级债券型证券投资基金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。

## § 6 审计报告

本基金的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:富国天盈分级债券型证券投资基金  
报告截止日:2012年12月31日

| 资产         | 本期末<br>(2012年12月31日) | 上年度末<br>(2011年12月31日) |
|------------|----------------------|-----------------------|
| 资产:        |                      |                       |
| 银行存款       | 34,424,327.64        | 3,119,542.08          |
| 结算备付金      | 56,976,757.02        | 70,195,081.45         |
| 存出保证金      | 671,918.35           | 320,068.07            |
| 交易性金融资产    | 4,664,376,222.13     | 4,346,736,000.77      |
| 其中:股票投资    | -                    | 33,800,000.00         |
| 基金投资       | -                    | -                     |
| 债券投资       | 4,664,376,222.13     | 4,312,936,007.77      |
| 资产支持证券投资   | -                    | -                     |
| 衍生金融资产     | -                    | -                     |
| 买入返售金融资产   | 159,060,365.13       | 79,478,101.97         |
| 应收证券清算款    | -                    | 18,290,821.59         |
| 应收利息       | 129,321,543.28       | 107,626,342.17        |
| 应收股利       | -                    | -                     |
| 应收申购款      | -                    | -                     |
| 递延所得税资产    | -                    | -                     |
| 其他资产       | -                    | -                     |
| 资产总计       | 5,044,831,133.55     | 4,625,765,965.10      |
| 负债和所有者权益   |                      |                       |
| 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  | 2,000,000,000.00     | 2,185,457,621.40      |
| 应付证券清算款    | 24,280,473.04        | -                     |
| 应付赎回款      | -                    | -                     |
| 应付管理人报酬    | 1,782,647.45         | 1,442,510.85          |
| 应付托管费      | 599,327.83           | 412,145.99            |
| 应付销售服务费    | 891,323.70           | 721,255.45            |
| 应付交易费用     | 14,603.85            | 19,472.09             |
| 应交税费       | 1,059,213.46         | 11,42                 |
| 应付利息       | 7,414.12             | 229,029.80            |
| 应付股利       | -                    | -                     |
| 递延所得税负债    | -                    | -                     |
| 其他负债       | 400,000.00           | 290,000.00            |
| 负债合计       | 2,028,945,003.45     | 2,188,572,047.00      |
| 所有者权益      |                      |                       |
| 实收基金       | 2,740,682,011.11     | 2,414,434,075.57      |
| 未分配利润      | 275,204,118.99       | 22,759,842.53         |
| 所有者权益合计    | 3,015,886,130.10     | 2,437,193,918.10      |
| 负债和所有者权益总计 | 5,044,831,133.55     | 4,625,765,965.10      |

注:1)报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.100元,基金份额总额720,682,011.11份,其中天盈A基金份额净值1.004元,份额总额1,689,202,662.70份;天盈B基金份额净值1.255元,份额总额1,051,479,348.41份。

2)本基金合同于2011年5月23日生效,上年度可比期间自2011年5月23日至2011年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:富国天盈分级债券型证券投资基金

本报告期:2012年01月01日至2012年12月31日

| 项目                    | 本期<br>(2012年01月01日至2012年12月31日) | 上年度可比期间<br>(2011年05月23日至2011年12月31日) |
|-----------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入                  | 430,313,550.52                  | 119,689,164.37                       |
| 1.利息收入                | 227,222,932.81                  | 124,218,256.97                       |
| 其中:存款利息收入             | 1,922,114.43                    | 970,092.44                           |
| 债券利息收入                | 222,979,526.82                  | 93,288,775.18                        |
| 资产支持证券利息收入            | -                               | -                                    |
| 买入返售金融资产收入            | 2,321,291.56                    | 29,959,389.35                        |
| 其他利息收入                | -                               | -                                    |
| 2.投资收益(损失以“-”填列)      | 157,268,693.00                  | -4,062,160.88                        |
| 其中:股票投资收益             | -624,956.99                     | 208,258.00                           |
| 基金投资收益                | -                               | -                                    |
| 债券投资收益                | 157,893,649.99                  | -4,270,418.88                        |
| 资产支持证券投资              | -                               | -                                    |
| 衍生工具投资收益              | -                               | -                                    |
| 股利收益                  | -                               | -                                    |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 44,971,176.77                   | -2,106,244.39                        |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)     | -                               | -                                    |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)     | 850,747.94                      | 1,639,312.67                         |
| 减:二、费用                | 84,137,457.11                   | 40,659,465.63                        |
| 1.管理人报酬               | 22,320,002.78                   | 14,163,224.47                        |
| 2.托管费                 | 6,377,143.67                    | 4,046,635.12                         |
| 3.销售服务费               | 11,160,001.38                   | 7,081,611.23                         |
| 其中:基金销售服务费            | 255,858.24                      | 111,648.55                           |
| 4.利息支出                | 43,490,456.90                   | 14,847,420.87                        |
| 其中:卖出回购金融资产支出         | 43,490,456.90                   | 14,847,420.87                        |
| 6.其他费用                | 533,994.14                      | 408,927.39                           |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)   | 346,176,093.41                  | 79,029,698.74                        |
| 减:所得税费用               | -                               | -                                    |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)     | 346,176,093.41                  | 79,029,698.74                        |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:富国天盈分级债券型证券投资基金  
本报告期:2012年01月01日至2012年12月31日

| 项目                                     | 本期<br>(2012年01月01日至2012年12月31日) | 上年度可比期间<br>(2011年05月23日至2011年12月31日) |
|----------------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 2,414,434,075.57                | 22,759,842.53                        |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | 346,176,093.41                  | 346,176,093.41                       |
| 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)      | 326,247,935.54                  | -326,247,935.54                      |
| 其中:1.基金申购款                             | 1,911,385,948.34                | -1,911,385,948.34                    |
| 2.基金赎回款                                | -1,585,138,012.80               | -1,585,138,012.80                    |
| 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) | -93,731,816.95                  | -93,731,816.95                       |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2,740,682,011.11                | 275,204,118.99                       |
| 六、所有者权益合计                              | 2,740,682,011.11                | 275,204,118.99                       |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 3,504,716,032.32                | 3,504,716,032.32                     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | 79,029,698.74                   | 79,029,698.74                        |
| 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)      | -1,090,281,956.75               | -1,090,281,956.75                    |
| 其中:1.基金申购款                             | 272,670,466.57                  | -272,670,466.57                      |
| 2.基金赎回款                                | -1,362,952,423.32               | -1,362,952,423.32                    |
| 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) | -56,269,856.21                  | -56,269,856.21                       |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2,414,434,075.57                | 22,759,842.53                        |