

富国天利增长债券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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
经济下行压力下,货币政策趋向宽松,上半年债券呈现牛市。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.2255元,份额累计净值为2.1335元。报告期内,本基金份额净值增长率为7.59%,同期业绩比较基准收益率为6.05%。

4.5 管理人宏观策略、证券市场及行业走势的简要展望
下半年,本基金将继续调整票息收入以及精选个券,配置资产中熊平熊,在强调风险控制至上的原则下,择机带来产业债占比,关注利率债和转债的交易性机会,持续调整持仓结构,争取为基金持有人带来可持续的投资回报。

4.6 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构,由主管运营部总经理负责,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业务部门,所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。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 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本基金按本报告期利润进行收益分配如下:2014年4月11日公告每10份基金份额派发红利0.11元;2014年7月10日公告每10份基金份额派发红利0.15元。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守情况声明
本报告期内,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守情况、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,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,在各项重要方面的运作严格按照国家有关法律法规进行。本报告期内,富国天利增长债券投资基金的基金份额持有人进行了两次利润分配,分配金额分别为2,046,937.52元。

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2014年半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富国天利增长债券投资基金托管部
2014年8月26日

6.1 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:2014年06月30日

单位:人民币元

资产 期末(2014年06月30日) 上年度末(2013年12月31日)

货币: 51,565,229.51 42,319,605.54

银行存款 35,981,355.44 67,144,153.91

结算备付金 100,992.86 331,416.36

交易性金融资产 2,320,299,535.35 1,930,042,448.49

其中:股票投资 -- --

债券投资 -- --

资产支持证券投资 2,320,299,535.35 1,930,042,448.49

贵金属投资 -- --

买入金融资产 -- --

买入金融资产 -- --

应收证券清算款 -- --

应收利息 45,030,225.93 57,073,856.69

应收股利 -- --

应收申购款 394,067.99 244,276.91

其他资产 -- --

资产总计 2,453,371,407.08 2,097,901,443.28

负债和所有者权益 期末(2014年06月30日) 上年度末(2013年12月31日)

负债: -- --

短期借款 -- --

交易性金融负债 -- --

应付短期融资款 -- --

应付账款 -- --

应付利息 969,299,944.80 982,154,172.43

应付债券 -- --

应付证券清算款 4,918,514.04 462,573.69

应付赎回款 2,489,210.37 6,785,767.31

应付管理人报酬 96,480.03 81,004.28

应付托管费 226,022.02 202,651.07

应付销售服务费 -- --

应付利息 -- --

应付交易费 -- --

其他应付款 70,361.05 131,333.05

预收账款 2,243,181.87 2,243,181.87

其他负债 22,253.34 51,604.34

所有者权益 -- --

其公允价值 -- --

所有者权益合计 1,103,282,416.93 960,688,737.74

未分配利润 260,697,213.36 143,697,728.96

未分配利润 1,433,597,630.29 1,104,366,466.70

所有者权益总计 2,453,371,407.08 2,097,901,443.28

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.2255元,基金份额总额1,169,382,416.93份。

6.2 利润表
会计主体:富国天利增长债券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

单位:人民币元

项目 本期(2014年01月01日至2014年06月30日) 上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)

一、收入 108,833,576.59 66,095,741.61

利息收入 59,722,816.81 61,443,229.79

公允价值变动损益 513,144.41 491,086.36

净公允价值变动损益 59,209,672.40 60,768,246.39

其他利息收入 -- --

其他公允价值变动损益 -- --

二、费用 6,291,128.86 48,205,306.40

2.股票投资收益(损失以“-”号填列) -- --

其中:买卖股票差价 -- --

3.债券投资收益 -- --

其中:买卖债券差价 -- --

4.公允价值变动损益(损失以“-”号填列) -- --

5.其他公允价值变动损益 -- --

6.其他公允价值变动损益 -- --

7.其他公允价值变动损益 -- --

8.其他公允价值变动损益 -- --

9.其他公允价值变动损益 -- --

10.其他公允价值变动损益 -- --

11.其他公允价值变动损益 -- --

12.其他公允价值变动损益 -- --

13.其他公允价值变动损益 -- --

14.其他公允价值变动损益 -- --

15.其他公允价值变动损益 -- --

16.其他公允价值变动损益 -- --

17.其他公允价值变动损益 -- --

18.其他公允价值变动损益 -- --

19.其他公允价值变动损益 -- --

20.其他公允价值变动损益 -- --

21.其他公允价值变动损益 -- --

22.其他公允价值变动损益 -- --

23.其他公允价值变动损益 -- --

24.其他公允价值变动损益 -- --

25.其他公允价值变动损益 -- --

26.其他公允价值变动损益 -- --

27.其他公允价值变动损益 -- --

28.其他公允价值变动损益 -- --

29.其他公允价值变动损益 -- --

30.其他公允价值变动损益 -- --

31.其他公允价值变动损益 -- --

32.其他公允价值变动损益 -- --

33.其他公允价值变动损益 -- --

34.其他公允价值变动损益 -- --

35.其他公允价值变动损益 -- --

36.其他公允价值变动损益 -- --

37.其他公允价值变动损益 -- --

38.其他公允价值变动损益 -- --

39.其他公允价值变动损益 -- --

40.其他公允价值变动损益 -- --

41.其他公允价值变动损益 -- --

42.其他公允价值变动损益 -- --

43.其他公允价值变动损益 -- --

44.其他公允价值变动损益 -- --

45.其他公允价值变动损益 -- --

46.其他公允价值变动损益 -- --

47.其他公允价值变动损益 -- --

48.其他公允价值变动损益 -- --

49.其他公允价值变动损益 -- --

50.其他公允价值变动损益 -- --

51.其他公允价值变动损益 -- --

52.其他公允价值变动损益 -- --

53.其他公允价值变动损益 -- --

54.其他公允价值变动损益 -- --

55.其他公允价值变动损益 -- --

56.其他公允价值变动损益 -- --

57.其他公允价值变动损益 -- --

58.其他公允价值变动损益 -- --

59.其他公允价值变动损益 -- --

60.其他公允价值变动损益 -- --

61.其他公允价值变动损益 -- --

62.其他公允价值变动损益 -- --

63.其他公允价值变动损益 -- --

64.其他公允价值变动损益 -- --

65.其他公允价值变动损益 -- --

66.其他公允价值变动损益 -- --

67.其他公允价值变动损益 -- --

68.其他公允价值变动损益 -- --

69.其他公允价值变动损益 -- --

70.其他公允价值变动损益 -- --

71.其他公允价值变动损益 -- --

72.其他公允价值变动损益 -- --

73.其他公允价值变动损益 -- --

74.其他公允价值变动损益 -- --

75.其他公允价值变动损益 -- --

76.其他公允价值变动损益 -- --

77.其他公允价值变动损益 -- --

78.其他公允价值变动损益 -- --

79.其他公允价值变动损益 -- --

80.其他公允价值变动损益 -- --

81.其他公允价值变动损益 -- --

82.其他公允价值变动损益 -- --

83.其他公允价值变动损益 -- --

84.其他公允价值变动损益 -- --

85.其他公允价值变动损益 -- --

86.其他公允价值变动损益 -- --

87.其他公允价值变动损益 -- --

88.其他公允价值变动损益 -- --

89.其他公允价值变动损益 -- --

90.其他公允价值变动损益 -- --

91.其他公允价值变动损益 -- --

92.其他公允价值变动损益 -- --

93.其他公允价值变动损益 -- --

94.其他公允价值变动损益 -- --

95.其他公允价值变动损益 -- --

96.其他公允价值变动损益 -- --

97.其他公允价值变动损益 -- --

98.其他公允价值变动损益 -- --

99.其他公允价值变动损益 -- --

100.其他公允价值变动损益 -- --

101.其他公允价值变动损益 -- --

102.其他公允价值变动损益 -- --

103.其他公允价值变动损益 -- --

104.其他公允价值变动损益 -- --

105.其他公允价值变动损益 -- --

106.其他公允价值变动损益 -- --

107.其他公允价值变动损益 -- --

108.其他公允价值变动损益 -- --

109.其他公允价值变动损益 -- --

110.其他公允价值变动损益 -- --

111.其他公允价值变动损益 -- --

112.其他公允价值变动损益 -- --

113.其他公允价值变动损益 -- --

114.其他公允价值变动损益 -- --

115.其他公允价值变动损益 -- --

116.其他公允价值变动损益 -- --

117.其他公允价值变动损益 -- --

118.其他公允价值变动损益 -- --

119.其他公允价值变动损益 -- --

120.其他公允价值变动损益 -- --

121.其他公允价值变动损益 -- --

122.其他公允价值变动损益 -- --

123.其他公允价值变动损益 -- --

124.其他公允价值变动损益 -- --

125.其他公允价值变动损益 -- --

126.其他公允价值变动损益 -- --

127.其他公允价值变动损益 -- --

128.其他公允价值变动损益 -- --

129.其他公允价值变动损益 -- --

130.其他公允价值变动损益 -- --

131.其他公允价值变动损益 -- --

132.其他公允价值变动损益 -- --

133.其他公允价值变动损益 -- --

134.其他公允价值变动损益 -- --

135.其他公允价值变动损益 -- --

136.其他公允价值变动损益 -- --

137.其他公允价值变动损益 -- --

138.其他公允价值变动损益 -- --

139.其他公允价值变动损益 -- --

140.其他公允价值变动损益 -- --

141.其他公允价值变动损益 -- --

142.其他公允价值变动损益 -- --

143.其他公允价值变动损益 -- --

144.其他公允价值变动损益 -- --

145.其他公允价值变动损益 -- --

146.其他公允价值变动损益 -- --

147.其他公允价值变动损益 -- --

148.其他公允价值变动损益 -- --

149.其他公允价值变动损益 -- --

150.其他公允价值变动损益 -- --

151.其他公允价值变动损益 -- --

152.其他公允价值变动损益 -- --

153.其他公允价值变动损益 -- --

154.其他公允价值变动损益 -- --

155.其他公允价值变动损益 -- --

156.其他公允价值变动损益 -- --

157.其他公允价值变动损益 -- --

158.其他公允价值变动损益 -- --

159.其他公允价值变动损益 -- --

160.其他公允价值变动损益 -- --

16