

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
基金合同生效日期:2011年08月27日

§1 重要提示及目录

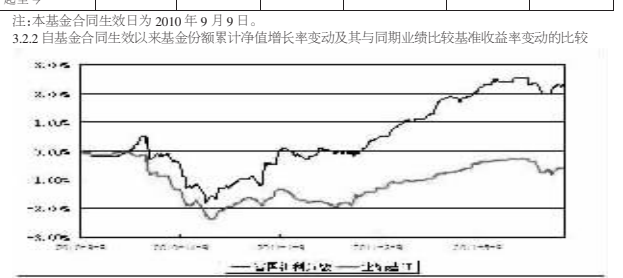
1.1 重要提示
富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。
富国基金管理有限公司的基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况), Content (Fund details like name, code, dates, etc.)

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.2 基金业绩表现), Content (Investment objectives, strategies, performance metrics, etc.)

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.1 1期间数据和指标), Content (Financial performance metrics for various periods)



注:截止日期为2011年6月30日。
本基金于2011年9月9日成立,建仓期自2010年9月9日至2011年3月8日共6个月,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

Table with 2 columns: Section (e.g., 其他指标), Content (Additional performance indicators like asset-liability ratio, etc.)

§4 管理人报告

Table with 2 columns: Section (e.g., 4.1 基金管理人及基金经理情况), Content (Management team details, including names, roles, and experience)

Table with 2 columns: Section (e.g., 4.3 异常交易行为的专项说明), Content (Disclosure of unusual trading activities and compliance measures)

Table with 2 columns: Section (e.g., 4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明), Content (Investment strategy and performance analysis for the reporting period)

Table with 2 columns: Section (e.g., 4.5 报告期内基金投资组合的重大变动), Content (Significant changes in the fund's investment portfolio)

富国汇利分级债券型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

4.7 管理人应对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:在封闭期内,本基金不对基金份额所分配的汇利A与汇利B基金份额进行收益分配,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的说明
在报告期内,本基金托管人-中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国汇利分级债券型证券投资基金基金合同》、《富国汇利分级债券型证券投资基金托管协议》的约定,对富国汇利分级债券型证券投资基金管理人-富国基金管理有限公司2011年1月1日至2011年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真执行了托管职责,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

§6 半年度财务报表 (未经审计)

Table with 3 columns: Asset/Liability Category, Current Period (2011.06.30), Previous Period (2010.12.31). Includes assets like cash, securities, and liabilities like interest payable.

Table with 3 columns: Section (e.g., 6.1 资产负债表), Content (Detailed financial statements including income statement and balance sheet)

Table with 2 columns: Section (e.g., 6.2 利润表), Content (Profit and loss statement details)

Table with 2 columns: Section (e.g., 6.3 所有者权益变动表), Content (Statement of changes in equity)

注:本基金合同生效日为2010年9月9日,截至报告日本基金合同生效未满一年,本报告期内财务报表及报告附注均与上年度同期对比披露。

Table with 2 columns: Section (e.g., 6.4 现金流量表), Content (Cash flow statement details)

注:本基金合同生效日为2010年9月9日,截至报告日本基金合同生效未满一年,本报告期内财务报表及报告附注均与上年度同期对比披露。

Table with 2 columns: Section (e.g., 6.5 资产负债表), Content (Balance sheet details)

Table with 2 columns: Section (e.g., 6.6 利润表), Content (Profit and loss statement details)

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.4 关联方关系
6.4.4.1 本报告期末存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本基金本报告期末存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期末与基金发生关联交易的各关联方
关联方名称:富国基金管理有限公司,基金管理人、基金发起人、注册登记人、基金销售机构;中国农业银行股份有限公司(农业银行),基金托管人、基金管理人、基金销售机构;

6.4.5 关联交易
6.4.5.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.5.1.1 股票交易
注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.5.1.2 权证交易
注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.5.1.3 债券交易
注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.5.1.4 回购交易
注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金
注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行佣金交易。

6.4.5.2 关联方报酬
注:本基金本报告期为2010年9月9日,无上年度同期对比数据。

Table with 3 columns: Section (e.g., 6.4.5.2.1 基金管理人报酬), Content (Compensation details for the fund manager)

Table with 3 columns: Section (e.g., 6.4.5.2.2 基金托管人报酬), Content (Compensation details for the fund custodian)

注:本基金合同生效日为2010年9月9日,无上年度同期对比数据。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 回购交易
注:本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券 回购交易。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.5.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
注:本基金基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资其他关联基金的情况
注:本基金基金管理人本报告期末未运用固有资金投资其他关联基金。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
注:本基金本报告期末银行存款余额为1,796,857.70元,当期产生的利息收入为213,043.93元。

Table with 3 columns: Section (e.g., 6.4.6.1.1 受限证券类别), Content (Details of restricted securities)

Table with 3 columns: Section (e.g., 6.4.6.1.2 受限证券类别), Content (Details of restricted securities)

Table with 3 columns: Section (e.g., 6.4.6.1.3 受限证券类别), Content (Details of restricted securities)

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等受限受限股票
注:本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.6.3 期末未售出的回购交易中的作为抵押的债券
注:截至本报告期末2011年6月30日止,本基金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0。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2011年6月30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为人民币1,383,767,781.40元,分别于2011年7月1日及2011年7月4日先后到期,该类交易要求本基金在回购期间持有的有证券交易所交易的债券和/或在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。

6.4.7 有重大影响的关联方对本基金投资运作的其他重要事项
截至本报告期末,本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告
7.1 期末基金资产组合情况
7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.2 期末按行业分类的股票投资组合), Content (Industry breakdown of stock investments)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细), Content (Top 10 stocks by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细), Content (Top 10 warrants by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细), Content (Top 20 stocks bought)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细), Content (Top 20 stocks sold)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细), Content (Top 10 warrants by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细), Content (Top 10 warrants by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 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10名权证投资明细), Content (Top 10 warrants by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额), Content (Buy/sell totals for stocks)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.5 期末按投资组合品种分类的债券投资组合), Content (Bond portfolio breakdown)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资明细), Content (Top 5 bonds by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资明细), Content (Top 10 structured products by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细), Content (Top 5 warrants by fair value)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9 投资组合报告附注), Content (Notes on portfolio composition)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9.1 申明基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制前一年受到公开谴责、处罚的情况), Content (Notes on issuer status)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9.2 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), Content (Notes on stock selection)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9.3 期末其他各项资产构成), Content (Other assets breakdown)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细), Content (Convertible bonds details)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明), Content (Notes on restricted stocks)

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分), Content (Additional portfolio notes)

§8 基金持有人信息

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.1 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.2 期末上市基金前十名持有人), Content (Top 10 holders of listed funds)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.3 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.4 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.5 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.6 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.7 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.8 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.9 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.10 期末基金持有人户数及持有人结构), Content (Holder statistics)

注:1、我公司对基金交易方式的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。
2、本基金本报告期间券商交易单元无变更。