

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
重要提示: 富国基金管理有限公司的董事会、监事会对本报告期内所披露的信息进行了认真核对...

2.1基金基本情况
基金名称: 富国双债债券
基金代码: 500005
基金管理人: 富国基金管理有限公司

2.2基金产品说明
投资目标: 力争资产减少和分散投资风险, 确保基金资产的稳定性和谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略: 积极品种, 组合投资, 长期持有...

2.3基金管理人和其他基金托管人
名称: 富国基金管理有限公司
姓名: 林志松
联系电话: 021-20361818

2.4信息披露方式
基金管理人网站: www.fund.com.cn
基金年度报告全文的披露日期: 2012年8月18日

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标
本期已实现收益: -18,519,639.94
本期利润: 167,600,037.06

3.1.2 期末数据和指标
期末可供分配基金份额净值: 2.175,201,292.50
期末基金份额净值: 1.0879

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等, 计入费用后实际收益水平可能会低于所列数值。

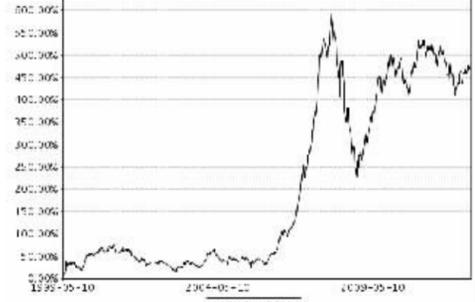
3.2 基金净值表现

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 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率标准差

注: 本基金建仓在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净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



图一: 基金净值表现

注: 本图中所示时间区间为1999年5月10日至2012年6月30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。

4.1 基金管理人及基金情况

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, 是经中国证监会批准设立的十家基金管理公司之一, 公司于2001年3月从北京迁往上海。

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, 是经中国证监会批准设立的十家基金管理公司之一, 公司于2001年3月从北京迁往上海。

4.1.2 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, 是经中国证监会批准设立的十家基金管理公司之一, 公司于2001年3月从北京迁往上海。

4.1.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

4.1.4 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

4.1.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

4.1.6 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

4.1.7 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

4.1.8 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

4.1.9 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法律法规, 结合实际情况, 制定了内部的《公平交易管理办法》, 对证券的市场申购、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、事后评估及反馈的精细化管理。

汉盛证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

本托管人认为, 富国基金管理有限公司在汉盛证券投资基金的投资运作, 基金资产净值的计算, 基金费用开支、利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面运作严格按照基金合同的有关规定进行。

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
本托管人认为, 富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人编制和披露的汉盛证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现其中有虚假记载、误导性陈述或有重大遗漏。

6.1 资产负债表

会计主体: 汉盛证券投资基金
报告截止日: 2012年06月30日
单位: 人民币元

资产负债表表
项目 2012年06月30日 2011年12月31日
资产: 货币资金 123,158,525.77 134,911,786.69

6.2 利润表

会计主体: 汉盛证券投资基金
报告截止日: 2012年06月30日
单位: 人民币元

利润表表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、收入 194,397,701.10 -76,739,263.68

6.3 所有者权益变动表

会计主体: 汉盛证券投资基金
报告截止日: 2012年06月30日
单位: 人民币元

所有者权益变动表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、所有者权益 167,600,037.06 167,600,037.06

6.4 所有者权益变动表

所有者权益变动表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、所有者权益 167,600,037.06 167,600,037.06

6.5 所有者权益变动表

所有者权益变动表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、所有者权益 167,600,037.06 167,600,037.06

6.6 所有者权益变动表

所有者权益变动表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、所有者权益 167,600,037.06 167,600,037.06

6.7 所有者权益变动表

所有者权益变动表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、所有者权益 167,600,037.06 167,600,037.06

6.8 所有者权益变动表

所有者权益变动表
项目 本期 2012年06月30日 上期 2011年12月31日
一、所有者权益 167,600,037.06 167,600,037.06

关联方名称 本期 2012年01月01日至2012年06月30日 上年度可比期间 2011年01月01日至2011年06月30日

关联方名称 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(%)

6.4.5.1 权证交易
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.5.1.1 债券交易
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.5.1.2 权证交易
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均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: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.5.1.4 权证交易
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.5.1.5 权证交易
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.5.2 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.1 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.2 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.3 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.4 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.5 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.6 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.7 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.8 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.9 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.10 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.11 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.12 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.13 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.14 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.15 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.16 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.17 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.18 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.19 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.20 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.21 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.22 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.23 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.24 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.25 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.26 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.27 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.28 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.29 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.30 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.31 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.32 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.33 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.34 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.35 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.36 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.37 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.38 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.39 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.40 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.41 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.42 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.43 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.44 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.45 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.46 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.47 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.48 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.49 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.50 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.51 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.52 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.53 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.54 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.55 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.56 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.57 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.58 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.59 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.60 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.61 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.62 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.63 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.64 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.65 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.66 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.67 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.68 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.69 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.70 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.71 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.72 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.73 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.74 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

6.4.5.2.75 基金管理人
注: 本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行基金管理人交易。

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读刊登于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
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

股票交易 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)

注: 本期累计买入金额"按买入成交金额"成交均价乘以成交量"填列, 不考虑相关交易费用。

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

股票交易 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)

注: 本期累计卖出金额"按卖出成交金额"成交均价乘以成交量"填列, 不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

买入股票成本 成交总额 2,506,013,805.83

卖出股票收入 成交总额 2,545,847,081.31

注: "买入股票成本"成交"总额"和"卖出股票收入"成交"总额"按买卖成交金额"成交均价乘以成交量"填列, 不考虑相关交易费用。

7.5 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 占基金资产净值比例(%)

7.6 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(亿) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十五名资产支持证券投资明细

7.8 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

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 报告期内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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

序号 名称 金额

7.9.4 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 占基金资产净值比例(%)

7.9.5 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。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因, 投资组合公允价值分项之和与合计可能存在尾差。

8.1 期末基金资产净值及基金份额持有人结构

持有人户数(户) 户均持有的基金份额

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号 持有人名称 持有份额(份) 占上市总份额比例(%)

8.3 期末基金资产净值及基金份额持有人结构

基金管理人所有从业人员持有本基金 0.00

注: 1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员均无个人未持有本基金。

2. 本基金基金管理人未持有本基金。

9.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内基金份额持有人大会决议如下:

9.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

本基金报告期内基金管理人、基金销售机构的重大人事变动:

9.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼:

9.4 基金投资情况的改变

本基金报告期内基金投资情况改变:

9.5 基金投资情况的会计审计师变更

本基金报告期内基金投资情况的会计审计师变更:

9.6 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

9.7 本期基金租用证券交易单元的有关