

富国天盈分级债券型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

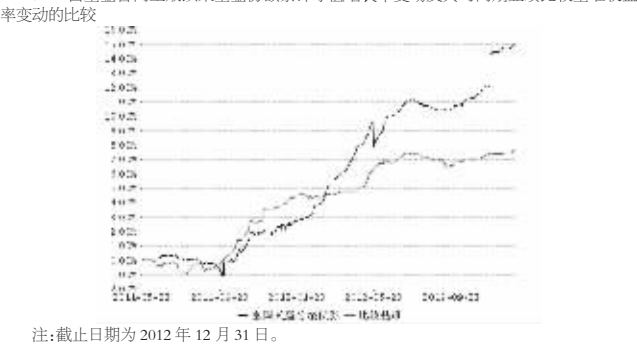
重要提示
富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2013年03月26日

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明) and Content (Fund details, objectives, and characteristics).

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.3 基金管理人, 2.4 基金托管人) and Content (Management and Custodian information).

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现) and Content (Financial data and performance metrics).



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，本基金建仓期6个月，即从2011年5月23日起至2012年11月22日。

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.3 其他指标) and Content (Additional performance indicators).

Table with 2 columns: Section (e.g., 4.1 基金管理人及基金业绩情况) and Content (Management and performance details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 4.2 基金经理) and Content (Fund manager information).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.1 审计报告) and Content (Audit report details).

断及证券公平分配等相关环节控制；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内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。

4.3 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，公司采取连续四个季度、不同时间窗口（日、3日、5日）的同向交易价差分析，在假设同向交易价差为零、95%的分位数水平下，对同向交易价差进行分析。

4.4 管理人对外宏观经济的投资策略和业绩表现说明
2012年，我们预计中国国内经济增速将逐步进一步夯实，通胀水平维持较低水平，外围经济最大的风险仍然在欧元区债务危机。
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%。

5 托管人报告
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。

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.2 审计报告) and Content (Audit report details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.3 资产负债表) and Content (Balance sheet details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.4 利润表) and Content (Income statement details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.5 所有者权益变动表) and Content (Equity of fund holders statement).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.6 所有者权益变动表) and Content (Equity of fund holders statement).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.7 关联方关系) and Content (Related party relationships).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.8 关联方关系) and Content (Related party relationships).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.9 关联方关系) and Content (Related party relationships).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.10 关联方关系) and Content (Related party relationships).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.11 关联方关系) and Content (Related party relationships).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.12 关联方关系) and Content (Related party relationships).

Table with 2 columns: Section (e.g., 5.13 关联方关系) and Content (Related party relationships).

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股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
注：截至本报告期末未持有债券正回购。
7.4.5.4 银行间市场债券正回购
注：截至本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.1 期末基金资产组合情况) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.2 期末按行业分类的股票投资组合) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.4 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) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细) and Content (Fund asset portfolio details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细) and Content (Fund asset portfolio details).