

富国汇利分级债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30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
报告截止日期:2013年07月18日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事及高级管理人员不存在虚假记载、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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年7月16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不承诺收益,也不保证最低收益,投资者应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、风险承受能力选择适当的基金产品。
本报告所载数据截至2013年6月30日止。
本报告自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|--------------------|---|
| 基金名称 | 富国汇利分级债券(场内简称:富国汇利) |
| 基金代码 | 161014 |
| 基金运作方式 | 契约型基金, 封闭式三年, 本基金(基金合同)生效后,在封闭期内不开封申购、赎回业务, 封闭期满后, 本基金转换为上市开放式基金(LOF)。 |
| 基金合同生效日 | 2010年09月09日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 2,999,258,415.06 |
| 投资目标 | 在追求本金长期安全的基础上, 力争为基金份额持有人谋求高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金按照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, 一方面根据宏观经济形势、利率走势、信用状况、流动性等因素, 调整投资组合中固定收益类资产、权益类资产、货币类资产等的配置比例, 另一方面通过久期管理、信用管理、行业配置等手段, 在控制风险的前提下, 力争实现超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债国债综合财富指数收益率+中债中债综合财富指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金, 属于证券投资基金中的低风险品种, 其预期风险和收益高于货币型基金, 低于混合型基金和股票型基金。 |
| 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 |
| 富国汇利A的基金简称 | 汇利 A |
| 富国汇利B的基金简称 | 汇利 B |
| 富国汇利A的基金份额总额(单位:份) | 150029 |
| 富国汇利B的基金份额总额(单位:份) | 2,099,478,789.45 |
| 富国汇利A的基金份额净值 | 899.77662561 |
| 富国汇利B的基金份额净值 | 1.4011 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | | 单位:人民币元 | |
|----------------|------------------------------|---------|--|
| 主要财务指标 | 报告期(2013年04月01日至2013年06月30日) | | |
| 1.本期已实现收益 | 60,079,844.66 | | |
| 2.本期利润 | 24,538,071.80 | | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0082 | | |
| 4.期末基金资产净值 | 3,571,499,361.97 | | |
| 5.期末基金份额净值 | 1.191 | | |

注:上述基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,基金交易佣金等), 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
本期未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, 本期利润为本期未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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益③ | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.68% | 0.12% | 0.93% | 0.11% | -0.25% | 0.01% |

注:过去三个月指2013年4月1日至2013年6月30日。
3.2.2 自基金合同生效以来本基金基金份额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

§4 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|------------|------|--------|--|
| 魏翔 | 本基金基金经理兼上市公司独立董事、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、富国天利分级债券型证券投资基金基金经理、富国天源分级债券型证券投资基金基金经理、富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理 | 2010-09-09 | - | 15年 | 硕士,曾任联华证券证券研究所研究员、研究员, 投资银行职员, 2003年7月加入富国基金管理有限公司, 曾任富国天利分级债券型证券投资基金基金经理, 2008年10月起兼任富国天丰基金基金经理, 2010年9月起兼任富国天源分级债券型证券投资基金基金经理, 2013年6月起兼任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理, 兼任富国基金公募事业部总经理兼富国基金公募事业部副经理, 具有基金从业资格, 中国国籍。 |
| 刁翌 | 本基金基金经理兼富国天源分级债券型证券投资基金基金经理、富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理 | 2010-11-18 | - | 7年 | 硕士,曾任富国证券研究所研究员、研究员, 富国基金管理有限公司基金经理, 2009年6月至2010年11月担任富国天源分级债券型证券投资基金基金经理, 2010年6月至2013年3月担任富国天利分级债券型证券投资基金基金经理, 2013年4月起兼任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理, 具有基金从业资格, 中国国籍。 |

§5 报告期内本基金遵守法律法规情况说明

本报告期, 富国基金管理有限公司作为富国汇利分级债券型证券投资基金的基金管理人, 严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国汇利分级债券型证券投资基金基金合同》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, 为基金份额持有人谋求利益, 基金运作符合有关法律法规和基金合同的约定, 基金管理人不存在违法违规行为, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为, 基金管理人不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。

§6 公平交易专项说明

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》, 对证券的一级市场申购、二级市场交易相关活动的研究分析、投资决策、授权交易、执行监控等环节管理, 实行集中控制, 确保各环节符合法律法规及基金合同的约定, 确保不同投资组合享有公平的投资机会。
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》, 对证券的一级市场申购、二级市场交易相关活动的研究分析、投资决策、授权交易、执行监控等环节管理, 实行集中控制, 确保各环节符合法律法规及基金合同的约定, 确保不同投资组合享有公平的投资机会。

§7 投资组合报告

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----------|------------------|--------------|
| 1. 医药生物 | 4,447,817,289.42 | 89.31 |
| 2. 信息技术 | 4,552,967,289.42 | 87.49 |
| 3. 金融、地产 | 94,850,000.00 | 1.82 |
| 4. 食品饮料 | 201,181,821.83 | 3.87 |
| 5. 其他 | 101,181,821.83 | 1.94 |
| 6. 合计 | 239,311,692.51 | 4.60 |

4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 002103 | 69 美年大健康 | 1,790,000 | 168,844,000.00 | 4.73 |
| 2 | 122033 | 09 格力地产 | 1,271,860 | 139,998,315.00 | 3.82 |
| 3 | 138046 | 13 苏农转债 | 1,000,000 | 101,000,000.00 | 2.83 |
| 4 | 082065 | 08 浦发转债 | 1,000,000 | 99,850,000.00 | 2.80 |
| 5 | 122932 | 09 双钱债 | 800,000 | 84,192,000.00 | 2.36 |

4.4 报告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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 061201002 | 12 开元 A2 | 1,000,000 | 94,850,000.00 | 2.66 |

4.5 报告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

4.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

4.9 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、处罚的情况

4.10 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

4.11 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

4.12 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§19 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§20 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§21 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§22 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§23 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

富国 7 天理财宝债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30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
报告截止日期:2013年07月18日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事及高级管理人员不存在虚假记载、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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定, 于2013年7月16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不承诺收益, 也不保证最低收益, 投资者应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件, 了解基金的风险收益特征, 并根据自身的投资目的、风险承受能力选择适当的基金产品。
本报告所载数据截至2013年6月30日止。
本报告自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---------------------------|--|
| 基金名称 | 富国 7 天理财宝 |
| 基金代码 | 100007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年10月19日 |
| 报告期末基金份额总额 | 474,432,882.09 |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上, 力求实现超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上, 力求实现超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金属于货币型基金, 长期风险收益水平低于股票基金、混合型基金, 高于货币市场基金和债券基金。 |
| 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 |
| 富国 7 天理财宝 A 的基金简称 | 富国 7 天理财宝 A |
| 富国 7 天理财宝 B 的基金简称 | 富国 7 天理财宝 B |
| 富国 7 天理财宝 A 的基金份额总额(单位:份) | 10007 |
| 富国 7 天理财宝 B 的基金份额总额(单位:份) | 316,011,768.43 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | | 单位:人民币元 | |
|----------------|------------------------------|---------|--|
| 主要财务指标 | 报告期(2013年04月01日至2013年06月30日) | | |
| 1.本期已实现收益 | 4,520,947.84 | | |
| 2.本期利润 | 4,520,947.84 | | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0095 | | |
| 4.期末基金资产净值 | 316,011,768.43 | | |
| 5.期末基金份额净值 | 1.166 | | |

注:上述基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,基金交易佣金等), 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
本期未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, 本期利润为本期未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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益③ | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|---------|-----------|-----------|--------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.8673% | 0.0041% | 0.3413% | 0.0000% | 0.5260% | 0.0041% |

注:过去三个月指2013年4月1日至2013年6月30日。
3.2.2 自基金合同生效以来本基金基金份额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

§4 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---|------------|------|--------|---|
| 邱道 | 本基金基金经理兼富国天源分级债券型证券投资基金基金经理、富国天利分级债券型证券投资基金基金经理 | 2012-10-19 | - | 6年 | 硕士,曾任联华证券研究所研究员、研究员, 投资银行职员, 2003年7月加入富国基金管理有限公司, 曾任富国天利分级债券型证券投资基金基金经理, 2008年10月起兼任富国天源基金基金经理, 2010年9月起兼任富国天利分级债券型证券投资基金基金经理, 2012年10月起兼任富国 7 天理财宝 A 基金经理, 2013年6月起兼任富国 7 天理财宝 B 基金经理, 兼任富国基金公募事业部副经理, 具有基金从业资格, 中国国籍。 |
| 冯彬 | 本基金基金经理兼富国天源分级债券型证券投资基金基金经理、富国天利分级债券型证券投资基金基金经理 | 2012-11-13 | - | 6年 | 硕士,曾任平安证券研究所研究员、研究员, 富国基金管理有限公司基金经理, 2009年6月至2012年12月担任富国天源分级债券型证券投资基金基金经理, 2012年12月起兼任富国 7 天理财宝 A 基金经理, 2013年5月起兼任富国 7 天理财宝 B 基金经理, 具有基金从业资格, 中国国籍。 |

§5 报告期内本基金遵守法律法规情况说明

本报告期, 富国基金管理有限公司作为富国 7 天理财宝债券型证券投资基金的基金管理人, 严格按照《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 7 天理财宝债券型证券投资基金基金合同》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, 为基金份额持有人谋求利益, 基金运作符合有关法律法规和基金合同的约定, 基金管理人不存在违法违规行为, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为, 基金管理人不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。

§6 公平交易专项说明

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》, 对证券的一级市场申购、二级市场交易相关活动的研究分析、投资决策、授权交易、执行监控等环节管理, 实行集中控制, 确保各环节符合法律法规及基金合同的约定, 确保不同投资组合享有公平的投资机会。
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》, 对证券的一级市场申购、二级市场交易相关活动的研究分析、投资决策、授权交易、执行监控等环节管理, 实行集中控制, 确保各环节符合法律法规及基金合同的约定, 确保不同投资组合享有公平的投资机会。

§7 投资组合报告

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----------|------------------|--------------|
| 1. 医药生物 | 4,788,221,682.90 | 83.13 |
| 2. 信息技术 | 4,788,221,682.90 | 83.13 |
| 3. 金融、地产 | 99,970,000.00 | 1.73 |
| 4. 食品饮料 | 101,203,000.00 | 2.10 |
| 5. 其他 | 571,400,000.00 | 12.02 |
| 6. 合计 | 4,788,221,682.90 | 100.00 |

4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 115001 | 申开转债 | 4,480,000 | 440,880,000.00 | 9.26 |
| 2 | 128048 | 12 康欣债 | 1,500,000 | 154,150,000.00 | 3.24 |
| 3 | 115002 | 1 行将转债 | 1,200,000 | 131,250,000.00 | 2.76 |
| 4 | 115003 | 12 康欣转债 | 1,200,000 | 123,080,000.00 | 2.59 |

4.4 报告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

4.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.6 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

4.8 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、处罚的情况

4.9 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

4.10 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

4.11 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

4.12 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§19 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§20 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§21 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§22 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§23 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内, 基金管理人未运用固有资金投资本基金。

长期和资产配置, 较好地应对了季末的流动性冲击, 并抓住机会获得了相应的投资回报。
4.2 报告期内本基金的投资策略
本报告期, 本基金严格执行基金合同约定的投资策略, 报告期内本基金资产配置为 A 股 0.3413%, 债 0.3413%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 固定收益投资 | 280,493,091.82 | 55.50 |
| | 其中:债券 | 280,493,091.82 | 55.50 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 156,655,953.62 | 31.00 |
| 4 | 其他资产 | 68,225,609.43 | 13.50 |
| 5 | 合计 | 505,374,654.87 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) |
|-----|------------------|---------------|
| 1 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 3.68% |
| 1.1 | 其中:买入返售金融资产 | - |
| 1.2 | 其中:买入返售金融资产 | - |