

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8月29日 § 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金由富国基金管理有限公司的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员担任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人承诺本年度报告不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告所载数据截至半年度报告公告前最后一个完整会计年度的定期报告。

本报告期末基金资产总额为人民币1,050,000,000.00元。

本基金自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 富国天盈分级债券型证券投资基金
基金代码 161015
基金类型 契约型基金，本基金《基金合同》生效之日起3年内，天盈A自基金成立之日起每6个月开放一次，天盈B封闭运作并上市交易；本基金在开放期结束后6个月内开放，本基金转换为上市开放式基金。
基金运作方式 LOF

基金合同生效日 2010年1月21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

报告期末基金份额总额 2,636,067,641.39份

报告期末基金资产净值 1,050,000,000.00元

报告期末基金份额净值 1,018份

2.2 基金产品说明

投资目标 在追求基金资产安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩基准的投资收益。

投资策略 本基金将采取自上而下的方法对基金资产进行整体配置和类属配置。在认真评估宏观经济形势和金融市场走势的基础上，根据整体资产配置的动态调整大类金融资产的配置比例，同时根据市场情况适时地动态调整股票、债券类属资产配置对投资组合进行结构优化，使组合整体的风险收益属性更加优良。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为1.146元，份额累计净值为1.206元。报告期内，本基金份额净值增长率为5.37%，同期业绩比较基准收益率为2.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来，本基金将继续关注通胀水平、经济增速、信贷增长以及货币政策方面的变化对市场可能带来的影响，继续跟踪债券发行人信用状况的变化趋势，积极把握市场中各种交易机会，按照相关法规对报告期基金净值增长率等项目的说明。

4.6 管理人对报告期基金估值政策的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了“富国基金管理有限公司估值委员会”，并制定了《富国基金管理有限公司估值政策》，估值委员会的主要决策办法：由分管营运部的总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的骨干以及相关部门经理，所有相关部门均具有相应的证券从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见，提供和评估估值技术，执行估值政策和程序，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。基金经理领导的估值委员会的主要决策办法：由分管营运部的总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的骨干以及相关部门经理，所有相关部门均具有相应的证券从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见，提供和评估估值技术，执行估值政策和程序，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。

4.7 管理人对报告期基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定，“本基金《基金合同》生效之日起3年内，本基金不进行收益分配”，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声明

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《证券投资基金管理暂行办法》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的职责。

5.2 托管人对报告期基金估值政策的说明

本公司根据《关于证券投资基金估值业务的指导意见》，结合基金的具体情况，对基金估值政策进行了调整，以确保估值结果的公平、准确。

5.3 托管人对本期报告内容的真实、准确和完整发表意见

托管人依据中国证监会管理有限公司编制和披露的《富国天盈分级债券型证券投资基金基金托管人2013年度报告》对财务指标、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。

6 半年度财务报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国天盈分级债券型证券投资基金

报告截止日:2013年 06 月 30 日

单位:人民币元

6.2 利润表

报告期:2013年 01 月 01 日至 2013 年 06 月 30 日

金额单位:人民币元

6.3 主要财务指标和基金净值表现

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]12号文《关于开放式证券投资基金有关税收政策的通知》的规定，对于基金取得的股息、红利收入，债券的利息收入，储蓄存款利息收入，由上市公司、银行、证券交易所代扣代缴所得税；对于基金买卖股票、债券的差价收入，股权转让所得，由证券交易所代扣代缴所得税。

6.4 财务报告

6.4.1 财务报告

6.4.2 财务报告

6.4.3 财务报告

6.4.4 财务报告

6.4.5 财务报告

6.4.6 财务报告

6.4.7 财务报告

6.4.8 财务报告

6.4.9 财务报告

6.4.10 财务报告

6.4.11 财务报告

6.4.12 财务报告

6.4.13 财务报告

6.4.14 财务报告

6.4.15 财务报告

6.4.16 财务报告

6.4.17 财务报告

6.4.18 财务报告

6.4.19 财务报告

6.4.20 财务报告

6.4.21 财务报告

6.4.22 财务报告

6.4.23 财务报告

6.4.24 财务报告

6.4.25 财务报告

6.4.26 财务报告

6.4.27 财务报告

6.4.28 财务报告

6.4.29 财务报告

6.4.30 财务报告

6.4.31 财务报告

6.4.32 财务报告

6.4.33 财务报告

6.4.34 财务报告

6.4.35 财务报告

6.4.36 财务报告

6.4.37 财务报告

6.4.38 财务报告

6.4.39 财务报告

6.4.40 财务报告

6.4.41 财务报告

6.4.42 财务报告

6.4.43 财务报告

6.4.44 财务报告

6.4.45 财务报告

6.4.46 财务报告

6.4.47 财务报告

6.4.48 财务报告

6.4.49 财务报告

6.4.50 财务报告

6.4.51 财务报告

6.4.52 财务报告

6.4.53 财务报告

6.4.54 财务报告

6.4.55 财务报告

6.4.56 财务报告

6.4.57 财务报告

6.4.58 财务报告

6.4.59 财务报告

6.4.60 财务报告

6.4.61 财务报告

6.4.62 财务报告

6.4.63 财务报告

6.4.64 财务报告

6.4.65 财务报告

6.4.66 财务报告

6.4.67 财务报告

6.4.68 财务报告

6.4.69 财务报告

6.4.70 财务报告

6.4.71 财务报告

6.4.72 财务报告

6.4.73 财务报告

6.4.74 财务报告

6.4.75 财务报告

6.4.76 财务报告

6.4.77 财务报告

6.4.78 财务报告

6.4.79 财务报告

6.4.80 财务报告

6.4.81 财务报告

6.4.82 财务报告

6.4.83 财务报告

6.4.84 财务报告

6.4.85 财务报告

6.4.86 财务报告

6.4.87 财务报告

6.4.88 财务报告

6.4.89 财务报告

6.4.90 财务报告

6.4.91 财务报告

6.4.92 财务报告

6.4.93 财务报告

6.4.94 财务报告

6.4.95 财务报告

6.4.96 财务报告

6.4.97 财务报告

6.4.98 财务报告

6.4.99 财务报告

6.4.10 财务报告

6.4.11 财务报告

6.4.12 财务报告

6.4.13 财务报告

6.4.14 财务报告

6.4.15 财务报告

6.4.16 财务报告