

富国天丰强化收益债券型证券投资基金

二 00 九年年度报告

(摘要)

2009 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司
(简称中国建设银行)

送出日期： 2010 年 03 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。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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但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。投资有风险，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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|---|
| 基金简称 | 富国天丰强化债券封闭 |
| 基金主代码 | 161010 |
| 基金运作方式 | 契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。 |
| 基金合同生效日 | 2008年10月24日 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行) |
| 报告期末基金份额总额 | 1,998,141,990.50份 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2008年12月8日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造较高的当期收益。 |
| 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。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。 |
| 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，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|------------------------|----------------------------|
| 名称 | | 富国基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行) |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李长伟 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021-68597788 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | yindong@ccb.cn |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-68597799 | 010-67595853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|-------------------------|--|
| 登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2009 年 | 2008 年(自基金合同生效日 2008 年 10 月 24 日起至 2008 年 12 月 31 日) |
|---------------|------------------|--|
| 本期已实现收益 | 177,242,139.52 | 12,290,103.36 |
| 本期利润 | 144,374,630.12 | 83,763,376.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0723 | 0.0419 |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.23% | 4.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2009 年 12 月 31 日 | 2008 年 12 月 31 日 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0154 | 0.0022 |
| 期末基金资产净值 | 2,067,427,714.44 | 2,073,912,800.74 |
| 期末基金份额净值 | 1.035 | 1.038 |

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、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

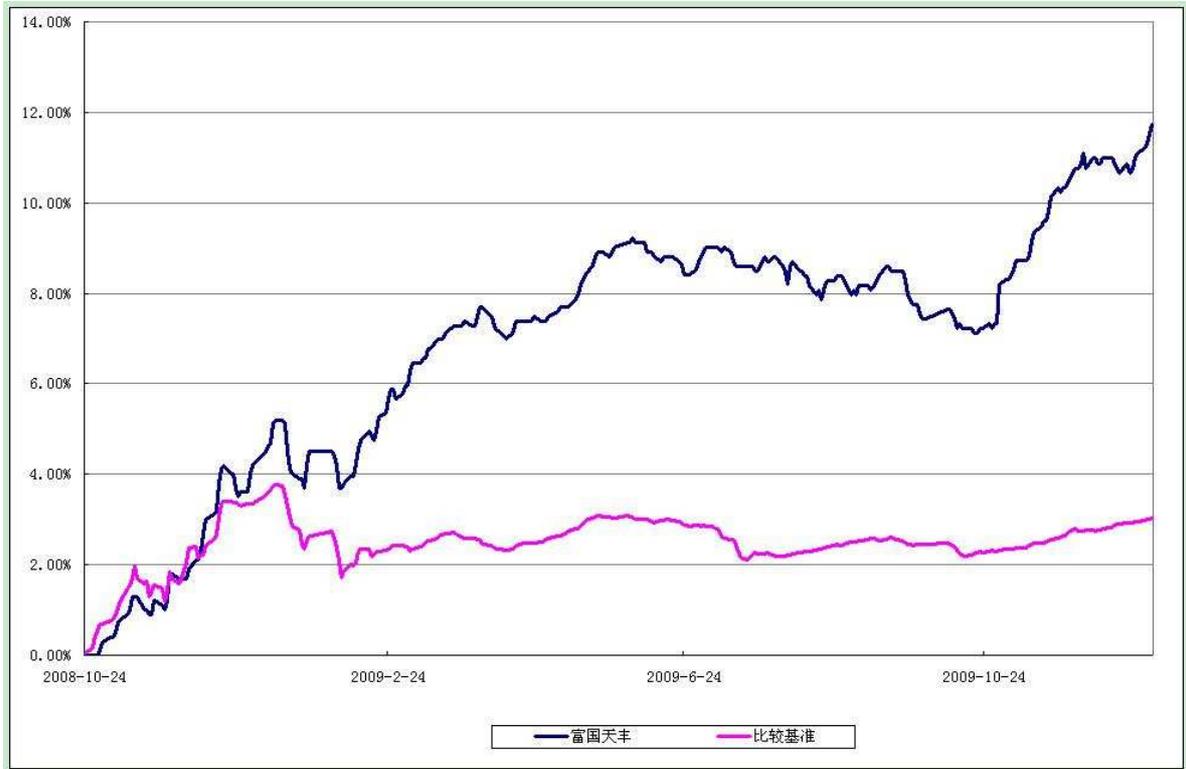
3.2 基金净值表现

3.2.1 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① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|--------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 4.00% | 0.16% | 0.55% | 0.03% | 3.45% | 0.13% |
| 过去六个月 | 2.78% | 0.15% | 0.14% | 0.04% | 2.64% | 0.11% |
| 过去一年 | 7.23% | 0.15% | -0.32% | 0.07% | 7.55% | 0.08% |
| 自基金合同生 | 11.74% | 0.16% | 3.03% | 0.09% | 8.71% | 0.07% |

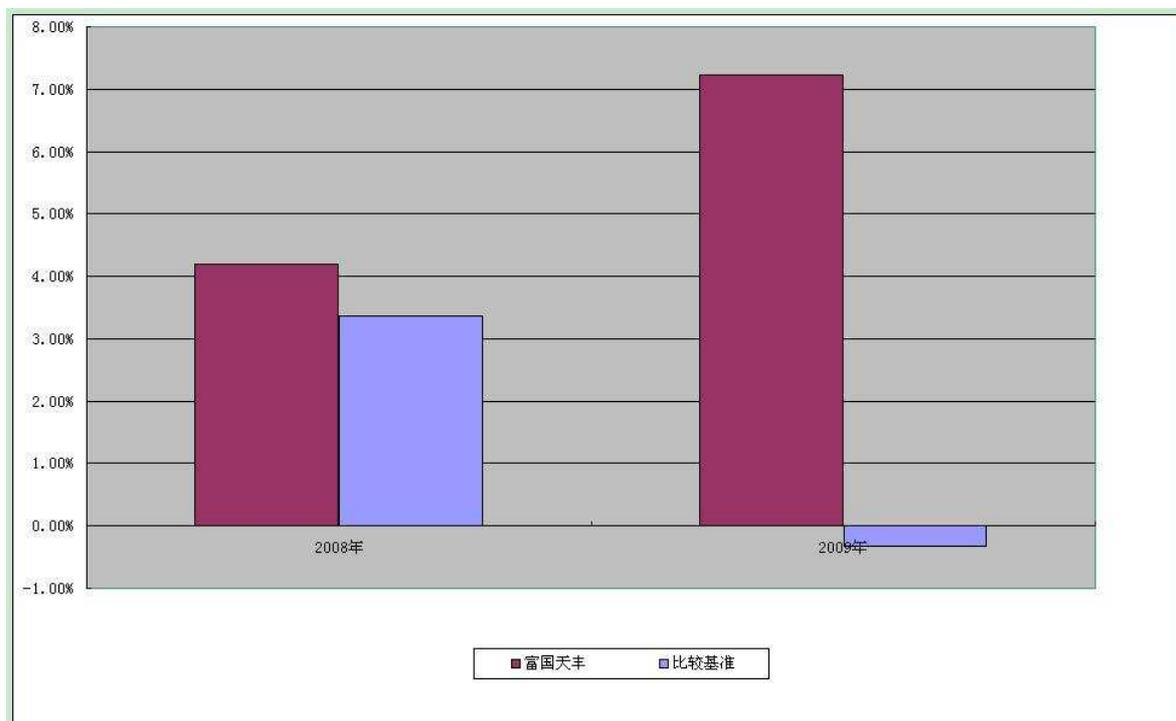
| | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 效起至今 | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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



注：截止日期为 2009 年 12 月 31 日。
 本基金合同生效日为 2008 年 10 月 24 日，建仓期 6 个月，即从 2008 年 10 月 24 日起至 2009 年 4 月 23 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2008 年 10 月 24 日，2008 年净值增长率数据按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|----------------|-----------|----------------|-------|
| 2009年 | 0.755 | 150,859,716.42 | — | 150,859,716.42 | 11次分红 |
| 2008年 | 0.040 | 7,992,566.00 | — | 7,992,566.00 | 1次分红 |
| 合计 | 0.795 | 158,852,282.42 | — | 158,852,282.42 | 12次分红 |

注：本基金合同于 2008 年 10 月 24 日生效。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第

一家中外合资的基金管理公司。截止 2009 年 12 月 31 日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金三只封闭式证券投资基金和富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金和富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金及富国沪深 300 增强证券投资基金十二只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-------------------------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 饶刚 | 本基金基金经理兼任固定收益部总经理、富国天利增长债券投资基金基金经理。 | 2008-10-24 | — | 11 年 | 硕士，曾任职兴业证券投资银行部；2003.7 至今任富国基金管理有限公司债券研究员，现任公司固定收益部总经理兼任富国天利基金经理、富国天丰基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 钟智伦 | 本基金基金经理兼任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理。 | 2008-10-24 | — | 16 年 | 硕士，曾任平安证券部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券投资经理；2005.5 至今任富国基金管理有限公司债券研究员，富国天时基金经理，现任富国天丰基金经理、富国优化增强债券基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |

注：上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天丰强化收益债券型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统内的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009年，在国内经济复苏的背景下，债券市场上纯利率产品整体表现不佳；信用债券在较高的信用利差保护下，随着市场参与者的增多，信用利差收窄，全年超额收益明显；可转债则伴随股票市场的强势8月之前大幅上涨，随后大幅调整。6月29日，新股发行重新开闸后，新股申购为债券基金提供了新的赢利来源。

本基金以企业债、公司债、分离债以及资产证券化产品等信用产品为主要投资标的，并在做好信用风险和流动性风险控制的前提下运用适当的杠杆来增强收益，信用债券较高的票息以及较低的回购利率为基金的收益提供了保障。同时，本基金还积极参与新股网下申购，申购所得股票上市后也为基金净值增长带来贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2009年12月31日，本基金份额净值为1.035元，份额累计净值为1.115元。报告期内，本基金份额净值增长率为7.23%，同期业绩比较基准收益率为-0.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2010年，国内经济强劲增长并出现过热苗头，两个主要因素即通胀预期和政策紧缩，将给证券市场带来较大的不确定性。我们预计，债券市场上利率产品上半年在通胀及加息预期下，仍将承受压力，而信用产品则由于较高的信用利差保护而具备防御性；对股票市场而言，由于整体估值水平较固定收益产品已经没有优势，加上流动性趋紧的变化，可能只存在结构性机会。

本基金仍然会把投资重点放在企业债、公司债、分离债以及资产证券化产品等信用产品上，并适时通过杠杆水平的变化来调整基金组合风险，同时，选择性参与新股申购，争取为基金持有人获取相对稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会负

责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、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。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金对 2009 年报告期内利润共进行十二次收益分配。分别于 2009 年 2 月 4 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.025 元；2009 年 3 月 4 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.04 元；2009 年 4 月 3 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.08 元；2009 年 5 月 5 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.07 元；2009 年 6 月 3 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.08 元；2009 年 7 月 2 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.09 元；2009 年 8 月 5 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.07 元；2009 年 9 月 3 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.09 元；2009 年 10 月 13 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.08 元；2009 年 11 月 4 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.06 元；2009 年 12 月 3 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.05 元；2010 年 1 月 6 日公告派发红利每 10 份基金份额 0.08 元。本基金 2009 年年度可分配收益为 177,543,392.90 元，本基金共计派发 2009 年度红利 162,848,566.61 元，占年度可分配收益的 91.72%。

根据本基金《基金合同》约定：“本基金收益每年最多分配 12 次，每年基金收益分配比例不低于该年度可分配收益的 90%；”。因此本基金本期分红已符合本基金合同的约定。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 150,859,716.42 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国天丰强化收益债券型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 (2009年12月31日) | 上年度末 (2008年12月31日) |
|-----------------|------------------------------|-------------------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 10,872,444.29 | 5,427,798.54 |
| 结算备付金 | 21,629,740.14 | 3,547,083.32 |
| 存出保证金 | 103,332.72 | — |
| 交易性金融资产 | 3,351,208,239.74 | 2,476,588,014.17 |
| 其中：股票投资 | 89,147,379.94 | — |
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | 3,193,303,859.80 | 2,213,351,014.17 |
| 资产支持证券投资 | 68,757,000.00 | 263,237,000.00 |
| 衍生金融资产 | — | — |
| 买入返售金融资产 | — | — |
| 应收证券清算款 | 119,918,449.09 | — |
| 应收利息 | 54,177,015.19 | 23,852,365.62 |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | — | — |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 3,557,909,221.17 | 2,509,415,261.65 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 (2009年12月31日) | 上年度末 (2008年12月31日) |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | — | — |
| 交易性金融负债 | — | — |
| 衍生金融负债 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | 1,488,299,980.00 | 434,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | 81,246.57 | — |
| 应付赎回款 | — | — |
| 应付管理人报酬 | 1,047,548.16 | 1,045,668.38 |
| 应付托管费 | 349,182.72 | 348,556.14 |
| 应付销售服务费 | — | — |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付交易费用 | 72,848.10 | 14,119.50 |
| 应交税费 | 390,483.99 | — |
| 应付利息 | 140,217.19 | 44,116.89 |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 100,000.00 | 50,000.00 |
| 负债合计 | 1,490,481,506.73 | 435,502,460.91 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,998,141,990.50 | 1,998,141,990.50 |
| 未分配利润 | 69,285,723.94 | 75,770,810.24 |
| 所有者权益合计 | 2,067,427,714.44 | 2,073,912,800.74 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,557,909,221.17 | 2,509,415,261.65 |

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.035 元，基金份额总额 1,998,141,990.50 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天丰强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 (2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日) | 上年度可比期间 (2008 年 10 月 24 日(基 金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日) |
|------------------------|---|---|
| 一、收入 | 172,693,526.62 | 87,201,341.04 |
| 1. 利息收入 | 104,970,446.18 | 13,400,483.59 |
| 其中：存款利息收入 | 1,048,059.94 | 764,515.65 |
| 债券利息收入 | 97,898,540.32 | 11,310,807.89 |
| 资产支持证券利息收入 | 6,023,845.92 | 895,160.05 |
| 买入返售金融资产收入 | — | 430,000.00 |
| 其他利息收入 | — | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 100,574,658.90 | 2,327,108.89 |
| 其中：股票投资收益 | 14,221,288.96 | — |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | 83,992,781.50 | 2,153,858.78 |
| 资产支持证券投资收益 | 1,484,704.33 | 173,250.11 |
| 衍生工具投资收益 | 688,873.94 | — |
| 股利收益 | 187,010.17 | — |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -32,867,509.40 | 71,473,272.88 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | — | — |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 15,930.94 | 475.68 |
| 减：二、费用 | 28,318,896.50 | 3,437,964.80 |

| | | |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|
| 1. 管理人报酬 | 12,451,861.65 | 2,267,381.56 |
| 2. 托管费 | 4,150,620.48 | 755,793.89 |
| 3. 销售服务费 | — | — |
| 4. 交易费用 | 216,673.23 | 25,111.50 |
| 5. 利息支出 | 11,077,331.09 | 251,907.66 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 11,077,331.09 | 251,907.66 |
| 6. 其他费用 | 422,410.05 | 137,770.19 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 144,374,630.12 | 83,763,376.24 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 144,374,630.12 | 83,763,376.24 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天丰强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2009年01月01日至2009年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2009年01月01日至2009年12月31日) | | |
|--|---|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,998,141,990.50 | 75,770,810.24 | 2,073,912,800.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | — | 144,374,630.12 | 144,374,630.12 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | — | — | — |
| 其中：1. 基金申购款 | — | — | — |
| 2. 基金赎回款 | — | — | — |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动（净值减少以“-”号填 列） | — | -150,859,716.42 | -150,859,716.42 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,998,141,990.50 | 69,285,723.94 | 2,067,427,714.44 |
| 项目 | 上年度可比期间 (2008年10月24日(基金合同生效日)至2008年12月 31日) | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,998,141,990.50 | — | 1,998,141,990.50 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | — | 83,763,376.24 | 83,763,376.24 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变 动数（净值减少以“-”号填列） | — | — | — |
| 其中：1. 基金申购款 | — | — | — |

| | | | |
|--|------------------|---------------|------------------|
| 2. 基金赎回款 | — | — | — |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | — | -7,992,566.00 | -7,992,566.00 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,998,141,990.50 | 75,770,810.24 | 2,073,912,800.74 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|-----------|---------|
| 竇玉明 | 林志松 | 雷青松 |
| _____ | _____ | _____ |
| 基金管理公司负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国天丰强化收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1105号文《关于核准富国天丰强化收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2008年10月24日正式生效,首次设立募集规模为1,998,141,990.50份基金份额。本基金为契约型封闭式,本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,基金合同生效满三年后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证

券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.5 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

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个人所得税时，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。

7.4.6 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---------------------------|--------------------|
| 富国基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记人、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司（“海通证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 申银万国证券股份有限公司（“申银万国证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 山东省国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 蒙特利尔银行 | 基金管理人的股东 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 富国基金公司—浦发—富国安心回报偏债型资产管理计划 | 基金管理人旗下的资产管理计划 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期(2009年01月01日至2009年12月31日) | | 上年度可比期间(2008年10月24日(基金合同生效日)至2008年12月31日) | |
|-------|-----------------------------|-----------------|---|-----------------|
| | 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(%) |
| 海通证券 | 13,807,672.90 | 18.75 | — | — |

7.4.7.1.2 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未进行权证交易。

7.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期(2009年01月01日至2009年12月31日) | | 上年度可比期间(2008年10月24日(基金合同生效日)至2008年12月31日) | |
|-------|-----------------------------|-----------------|---|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) |
| 海通证券 | 3,994,141,590.04 | 79.84 | 441,974,242.73 | 53.89 |
| 申银万国 | 45,313,716.70 | 0.91 | 328,815,024.74 | 40.09 |

7.4.7.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期(2009年01月01日至2009年12月31日) | 上年度可比期间(2008年10月24日(基金合同生效日)至2008年12月31日) |
|-------|-----------------------------|---|
| | | |

| | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 (%) |
|------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 海通证券 | 4,348,500,000.00 | 11.84 | 400,000,000.00 | 20.27 |
| 申银万国 | 2,075,000,000.00 | 5.65 | 500,000,000.00 | 25.34 |

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年12月31日） | | | |
|-------|--|----------------|-----------|------------------|
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 海通证券 | 11,218.77 | 18.30 | 11,218.77 | 18.30 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间（2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日）2008年01月01日至2008年12月31日 | | | |
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 海通证券 | — | — | — | — |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年12月31日） | 上年度可比期间（2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日） |
|-----------------|-----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,451,861.65 | 2,267,381.56 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 410,244.21 | 119,812.63 |

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年12月31日） | 上年度可比期间（2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日） |
|----------------|-----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,150,620.48 | 755,793.89 |

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期（2009年01月01日至2009年12月31日） | | | | | | |
|---|--------|------|-------|------|----------------|-----------|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国建设银行 | — | — | — | — | 118,200,000.00 | 49,004.97 |
| 上年度可比期间（2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日） | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国建设银行 | — | — | — | — | 48,000,000.00 | 14,920.77 |

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年12月31日） | 上年度可比期间（2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日） |
|-----------------------------|-----------------------------|---|
| 基金合同生效日（2008年10月24日）持有的基金份额 | — | 13,570,221.30 |
| 期初持有的基金份额 | 13,570,221.30 | — |
| 期间申购/买入总份额 | 19,999,939.00 | — |
| 期间因拆分变动份额 | — | — |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | — | — |
| 期末持有的基金份额 | 33,570,160.30 | 13,570,221.30 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.68% | 0.68% |

注：本基金管理人认购本基金份额的费率按照本基金发售公告的条款执行，不存在费率优惠的情况。本基金管理人本期投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末（2009年12月31日） | 上期末（2008年12月31日） |
|-------|------------------|------------------|
|-------|------------------|------------------|

| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份 额占基金总份 额的比例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份 额占基金总份 额的比例 (%) |
|----------------------------|--------------|------------------------------|---------------|------------------------------|
| 海通证券 | — | — | 30,003,050.00 | 1.50 |
| 浦发一富国安心回 报偏债型资产管理 计划 | 8,394,849.00 | 0.42 | — | — |

注：本基金管理人的股东海通证券股份有限公司和本基金管理人旗下的资产管理计划（浦发一富国安心回报偏债型资产管理计划）投资本基金的费率按照本基金公告的条款执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年12月31日） | | 上年度可比期间（2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日） | |
|--------|-----------------------------|------------|---|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 10,872,444.29 | 860,608.67 | 5,427,798.54 | 696,291.28 |

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于2009年度及2008年10月24日（基金合同生效日）至2008年12月31日止期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期末无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.8 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.8.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 002299 | 圣农发展 | 2009-10-13 | 2010-01-21 | 新股认购 | 19.75 | 25.03 | 64,239 | 1,268,720.25 | 1,607,902.17 | — |
| 002300 | 太阳电缆 | 2009-10-13 | 2010-01-21 | 新股认购 | 20.56 | 33.33 | 48,535 | 997,879.60 | 1,617,671.55 | — |
| 002301 | 齐心文具 | 2009-10-14 | 2010-01-21 | 新股认购 | 20.00 | 35.20 | 35,656 | 713,120.00 | 1,255,091.20 | — |
| 002304 | 洋河股份 | 2009-10-29 | 2010-02-08 | 新股认购 | 60.00 | 113.99 | 22,271 | 1,336,260.00 | 2,538,671.29 | — |
| 002305 | 南国置业 | 2009-10-29 | 2010-02-08 | 新股认购 | 12.30 | 19.57 | 59,221 | 728,418.30 | 1,158,954.97 | — |
| 002308 | 威创股份 | 2009-11-18 | 2010-03-01 | 新股认购 | 23.80 | 31.83 | 26,647 | 634,198.60 | 848,174.01 | — |
| 002310 | 东方园林 | 2009-11-20 | 2010-03-01 | 新股认购 | 58.60 | 110.88 | 13,914 | 815,360.40 | 1,542,784.32 | — |
| 002311 | 海大集团 | 2009-11-20 | 2010-03-01 | 新股认购 | 28.00 | 37.54 | 117,927 | 3,301,956.00 | 4,426,979.58 | — |
| 002313 | 日海通讯 | 2009-11-26 | 2010-03-03 | 新股认购 | 24.80 | 40.82 | 15,899 | 394,295.20 | 648,997.18 | — |
| 002318 | 久立特材 | 2009-12-03 | 2010-03-11 | 新股认购 | 23.00 | 33.13 | 51,938 | 1,194,574.00 | 1,720,705.94 | — |
| 002319 | 乐通股份 | 2009-12-03 | 2010-03-11 | 新股认购 | 13.70 | 31.28 | 31,296 | 428,755.20 | 978,938.88 | — |
| 002322 | 理工监测 | 2009-12-11 | 2010-03-18 | 新股认购 | 40.00 | 61.88 | 14,995 | 599,800.00 | 927,890.60 | — |
| 002323 | 中联电气 | 2009-12-11 | 2010-03-18 | 新股认购 | 30.00 | 40.57 | 24,197 | 725,910.00 | 981,672.29 | — |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|--------|---------|---------------|---------------|---|
| 002324 | 普利特 | 2009-12-11 | 2010-03-18 | 新股认购 | 22.50 | 34.62 | 42,716 | 961,110.00 | 1,478,827.92 | — |
| 002325 | 洪涛股份 | 2009-12-15 | 2010-03-22 | 新股认购 | 27.00 | 33.18 | 40,472 | 1,092,744.00 | 1,342,860.96 | — |
| 002326 | 永太科技 | 2009-12-15 | 2010-03-22 | 新股认购 | 20.00 | 31.27 | 35,590 | 711,800.00 | 1,112,899.30 | — |
| 002327 | 富安娜 | 2009-12-22 | 2010-03-30 | 新股认购 | 30.00 | 39.66 | 27,665 | 829,950.00 | 1,097,193.90 | — |
| 002328 | 新朋股份 | 2009-12-22 | 2010-03-30 | 新股认购 | 19.38 | 26.55 | 182,038 | 3,527,896.44 | 4,833,108.90 | — |
| 002329 | 皇氏乳业 | 2009-12-25 | 2010-04-06 | 新股认购 | 20.10 | 20.10 | 51,032 | 1,025,743.20 | 1,025,743.20 | — |
| 002333 | 罗普斯金 | 2009-12-30 | 2010-04-12 | 新股认购 | 22.00 | 22.00 | 76,021 | 1,672,462.00 | 1,672,462.00 | — |
| 300001 | 特锐德 | 2009-09-29 | 2010-02-01 | 新股认购 | 23.80 | 42.24 | 89,582 | 2,132,051.60 | 3,783,943.68 | — |
| 300002 | 神州泰岳 | 2009-09-29 | 2010-02-01 | 新股认购 | 58.00 | 105.20 | 71,753 | 4,161,674.00 | 7,548,415.60 | — |
| 300003 | 乐普医疗 | 2009-09-29 | 2010-02-01 | 新股认购 | 29.00 | 51.20 | 70,615 | 2,047,835.00 | 3,615,488.00 | — |
| 300005 | 探路者 | 2009-09-29 | 2010-02-01 | 新股认购 | 19.80 | 43.17 | 29,177 | 577,704.60 | 1,259,571.09 | — |
| 300015 | 爱尔眼科 | 2009-10-15 | 2010-02-01 | 新股认购 | 28.00 | 48.80 | 38,568 | 1,079,904.00 | 1,882,118.40 | — |
| 300024 | 机器人 | 2009-10-19 | 2010-02-01 | 新股认购 | 39.80 | 72.28 | 26,015 | 1,035,397.00 | 1,880,364.20 | — |
| 300026 | 红日药业 | 2009-10-19 | 2010-02-01 | 新股认购 | 60.00 | 91.20 | 30,148 | 1,808,880.00 | 2,749,497.60 | — |
| 300027 | 华谊兄弟 | 2009-10-19 | 2010-02-01 | 新股认购 | 28.58 | 55.43 | 55,467 | 1,585,246.86 | 3,074,535.81 | — |
| 300029 | 天龙光电 | 2009-12-18 | 2010-03-25 | 新股认购 | 18.18 | 29.10 | 124,780 | 2,268,500.40 | 3,631,098.00 | — |
| 300030 | 阳普医疗 | 2009-12-18 | 2010-03-26 | 新股认购 | 25.00 | 35.10 | 20,990 | 524,750.00 | 736,749.00 | — |
| 300032 | 金龙机电 | 2009-12-18 | 2010-03-25 | 新股认购 | 19.00 | 29.80 | 39,715 | 754,585.00 | 1,183,507.00 | — |
| 300034 | 钢研高纳 | 2009-12-18 | 2010-03-25 | 新股认购 | 19.53 | 34.53 | 39,466 | 770,770.98 | 1,362,760.98 | — |
| 300035 | 中科电气 | 2009-12-18 | 2010-03-25 | 新股认购 | 36.00 | 48.42 | 13,813 | 497,268.00 | 668,825.46 | — |
| 300036 | 超图软件 | 2009-12-18 | 2010-03-25 | 新股认购 | 19.60 | 38.31 | 12,805 | 250,978.00 | 490,559.55 | — |
| 300037 | 新宙邦 | 2009-12-28 | 2010-01-08 | 新股认购 | 28.99 | 28.99 | 500 | 14,495.00 | 14,495.00 | — |
| 600999 | 招商证券 | 2009-11-12 | 2010-02-22 | 新股认购 | 31.00 | 29.39 | 436,984 | 13,546,504.00 | 12,842,959.76 | — |
| 601117 | 中国化学 | 2009-12-29 | 2010-04-07 | 新股认购 | 5.43 | 5.43 | 730,704 | 3,967,722.72 | 3,967,722.72 | — |
| 601139 | 深圳燃气 | 2009-12-15 | 2010-03-25 | 新股认购 | 6.95 | 16.78 | 113,609 | 789,582.55 | 1,906,359.02 | — |
| 601299 | 中国北车 | 2009-12-23 | 2010-03-29 | 新股认购 | 5.56 | 6.13 | 160,927 | 894,754.12 | 986,482.51 | — |
| 601888 | 中国国旅 | 2009-09-25 | 2010-01-15 | 新股认购 | 11.78 | 20.94 | 131,060 | 1,543,886.80 | 2,744,396.40 | — |

7.4.8.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|--------|------------|------------|------------|--------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 122040 | 09 新黄埔 | 2009-12-16 | — | 认购新发 证券 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | |
| 122040 | 09 新黄埔 | 2009-12-18 | — | 认购新发 证券 | 100.00 | 100.00 | 240,000 | 24,000,000.00 | 24,000,000.00 | |
| 122042 | 09 金丰债 | 2009-12-30 | 2010-01-27 | 认购新发 证券 | 100.00 | 100.00 | 150,000 | 15,000,000.00 | 15,000,000.00 | |
| 122043 | 09 紫江债 | 2009-12-31 | 2010-01-20 | 认购新发 证券 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | |

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 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零。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 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人民币 1,488,299,980.00 元，于 2010 年 1 月 4 日、5 日、6 日、7 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新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。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 89,147,379.94 | 2.51 |
| | 其中：股票 | 89,147,379.94 | 2.51 |
| 2 | 固定收益投资 | 3,262,060,859.80 | 91.68 |
| | 其中：债券 | 3,193,303,859.80 | 89.75 |
| | 资产支持证券 | 68,757,000.00 | 1.93 |
| 3 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 4 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 32,502,184.43 | 0.91 |
| 6 | 其他各项资产 | 174,198,797.00 | 4.90 |
| 7 | 合计 | 3,557,909,221.17 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,607,902.17 | 0.08 |
| B | 采掘业 | — | — |
| C | 制造业 | 47,540,639.07 | 2.30 |
| C0 | 食品、饮料 | 7,991,394.07 | 0.39 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,097,193.90 | 0.05 |

| | | | |
|-----|----------------|---------------|------|
| C2 | 木材、家具 | — | — |
| C3 | 造纸、印刷 | 2,514,662.29 | 0.12 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 3,585,161.10 | 0.17 |
| C5 | 电子 | 1,183,507.00 | 0.06 |
| C6 | 金属、非金属 | 9,589,037.82 | 0.46 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 18,830,185.29 | 0.91 |
| C8 | 医药、生物制品 | 2,749,497.60 | 0.13 |
| C99 | 其他制造业 | — | — |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,906,359.02 | 0.09 |
| E | 建筑业 | 2,885,645.28 | 0.14 |
| F | 交通运输、仓储业 | — | — |
| G | 信息技术业 | 9,536,146.34 | 0.46 |
| H | 批发和零售贸易 | — | — |
| I | 金融、保险业 | 12,842,959.76 | 0.62 |
| J | 房地产业 | 1,158,954.97 | 0.06 |
| K | 社会服务业 | 8,594,237.52 | 0.42 |
| L | 传播与文化产业 | 3,074,535.81 | 0.15 |
| M | 综合类 | — | — |
| | 合计 | 89,147,379.94 | 4.31 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 600999 | 招商证券 | 436,984 | 12,842,959.76 | 0.62 |
| 2 | 300002 | 神州泰岳 | 71,753 | 7,548,415.60 | 0.37 |
| 3 | 002328 | 新朋股份 | 182,038 | 4,833,108.90 | 0.23 |
| 4 | 002311 | 海大集团 | 117,927 | 4,426,979.58 | 0.21 |
| 5 | 601117 | 中国化学 | 730,704 | 3,967,722.72 | 0.19 |
| 6 | 300001 | 特锐德 | 89,582 | 3,783,943.68 | 0.18 |
| 7 | 300029 | 天龙光电 | 124,780 | 3,631,098.00 | 0.18 |
| 8 | 300003 | 乐普医疗 | 70,615 | 3,615,488.00 | 0.17 |
| 9 | 300027 | 华谊兄弟 | 55,467 | 3,074,535.81 | 0.15 |
| 10 | 300026 | 红日药业 | 30,148 | 2,749,497.60 | 0.13 |

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 1 | 601668 | 中国建筑 | 15,792,023.28 | 0.76 |
| 2 | 600999 | 招商证券 | 13,546,504.00 | 0.65 |
| 3 | 601618 | 中国中冶 | 10,564,203.30 | 0.51 |
| 4 | 002154 | 报喜鸟 | 9,280,781.24 | 0.45 |
| 5 | 601788 | 光大证券 | 5,590,943.00 | 0.27 |
| 6 | 300002 | 神州泰岳 | 4,161,674.00 | 0.20 |
| 7 | 601117 | 中国化学 | 3,967,722.72 | 0.19 |
| 8 | 000778 | 新兴铸管 | 3,563,972.10 | 0.17 |
| 9 | 002328 | 新朋股份 | 3,527,896.44 | 0.17 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 3,301,956.00 | 0.16 |
| 11 | 300029 | 天龙光电 | 2,268,500.40 | 0.11 |
| 12 | 300001 | 特锐德 | 2,132,051.60 | 0.10 |
| 13 | 300003 | 乐普医疗 | 2,047,835.00 | 0.10 |
| 14 | 300026 | 红日药业 | 1,808,880.00 | 0.09 |
| 15 | 002333 | 罗普斯金 | 1,672,462.00 | 0.08 |
| 16 | 300027 | 华谊兄弟 | 1,585,246.86 | 0.08 |
| 17 | 002291 | 星期六 | 1,555,596.00 | 0.08 |
| 18 | 601888 | 中国国旅 | 1,543,886.80 | 0.07 |
| 19 | 601107 | 四川成渝 | 1,494,237.60 | 0.07 |
| 20 | 002304 | 洋河股份 | 1,336,260.00 | 0.06 |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601668 | 中国建筑 | 18,822,677.50 | 0.91 |
| 2 | 601618 | 中国中冶 | 10,252,344.90 | 0.49 |
| 3 | 002154 | 报喜鸟 | 9,541,085.30 | 0.46 |
| 4 | 601788 | 光大证券 | 6,279,951.50 | 0.30 |
| 5 | 000778 | 新兴铸管 | 3,050,693.05 | 0.15 |
| 6 | 601107 | 四川成渝 | 2,823,543.80 | 0.14 |
| 7 | 002291 | 星期六 | 2,049,434.75 | 0.10 |
| 8 | 002294 | 信立泰 | 1,799,440.00 | 0.09 |
| 9 | 002293 | 罗莱家纺 | 1,622,975.50 | 0.08 |
| 10 | 002285 | 世联地产 | 1,479,549.00 | 0.07 |
| 11 | 002275 | 桂林三金 | 1,432,507.44 | 0.07 |
| 12 | 002276 | 万马电缆 | 1,372,878.00 | 0.07 |
| 13 | 002277 | 家润多 | 1,215,894.55 | 0.06 |
| 14 | 002278 | 神开股份 | 1,124,658.80 | 0.05 |
| 15 | 002283 | 天润曲轴 | 1,111,425.99 | 0.05 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 002282 | 博深工具 | 1,066,261.77 | 0.05 |
| 17 | 600173 | 卧龙地产 | 984,784.66 | 0.05 |
| 18 | 002292 | 奥飞动漫 | 905,865.04 | 0.04 |
| 19 | 002284 | 亚太股份 | 863,512.20 | 0.04 |
| 20 | 002286 | 保龄宝 | 858,279.95 | 0.04 |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 122,625,941.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 73,633,786.62 |

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（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 59,508,000.00 | 2.88 |
| | 其中：政策性金融债 | 59,508,000.00 | 2.88 |
| 4 | 企业债券 | 3,085,939,459.80 | 149.26 |
| 5 | 企业短期融资券 | 29,971,000.00 | 1.45 |
| 6 | 可转债 | 17,885,400.00 | 0.87 |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 3,193,303,859.80 | 154.46 |

8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 112006 | 08 万科 G2 | 1,364,780 | 143,670,390.60 | 6.95 |
| 2 | 122996 | 08 常城建 | 1,298,660 | 127,814,117.20 | 6.18 |
| 3 | 122033 | 09 富力债 | 1,000,000 | 103,300,000.00 | 5.00 |
| 4 | 088045 | 08 联想债 | 1,000,000 | 101,640,000.00 | 4.92 |
| 5 | 122013 | 08 北辰债 | 675,980 | 72,762,487.20 | 3.52 |

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资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 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 | 0832011 | 08 信元 1A | 1,300,000 | 68,757,000.00 | 3.33 |

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 申明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内受到公开谴责、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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 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。

本基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 103,332.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 119,918,449.09 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 54,177,015.19 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 174,198,797.00 |

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 110003 | 新钢转债 | 17,885,400.00 | 0.87 |

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600999 | 招商证券 | 12,842,959.76 | 0.62 | 新股认购 |
| 2 | 300002 | 神州泰岳 | 7,548,415.60 | 0.37 | 新股认购 |
| 3 | 002328 | 新朋股份 | 4,833,108.90 | 0.23 | 新股认购 |
| 4 | 002311 | 海大集团 | 4,426,979.58 | 0.21 | 新股认购 |
| 5 | 601117 | 中国化学 | 3,967,722.72 | 0.19 | 新股认购 |
| 6 | 300001 | 特锐德 | 3,783,943.68 | 0.18 | 新股认购 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|------|
| 7 | 300029 | 天龙光电 | 3,631,098.00 | 0.18 | 新股认购 |
| 8 | 300003 | 乐普医疗 | 3,615,488.00 | 0.17 | 新股认购 |
| 9 | 300027 | 华谊兄弟 | 3,074,535.81 | 0.15 | 新股认购 |
| 10 | 300026 | 红日药业 | 2,749,497.60 | 0.13 | 新股认购 |

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|------------|------------------|-----------|----------------|-----------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 7213 | 277,019.55 | 1,595,879,775.74 | 79.87 | 402,262,214.76 | 20.13 |

9.2 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(%) |
|----|----------------------------------|-------------|-------------|
| 1 | 中国人寿保险(集团)公司 | 103,373,372 | 5.81 |
| 2 | 中信证券-中信-中信证券债券优化集合资产管理计划 | 98,604,960 | 5.54 |
| 3 | 中国人寿保险股份有限公司 | 93,644,738 | 5.26 |
| 4 | 中英人寿保险有限公司(个险万能) | 87,526,000 | 4.92 |
| 5 | 中信信托有限责任公司-债券增值1号 | 85,850,976 | 4.82 |
| 6 | 长江金色晚晴(集合型)企业年金计划-浦发银行 | 82,623,070 | 4.64 |
| 7 | 泰康人寿保险股份有限公司-分红-团体分红-019L-FH001深 | 77,506,041 | 4.35 |
| 8 | 中国人民健康保险股份有限公司 | 70,017,900 | 3.93 |
| 9 | 长江金色晚晴(集合型)企业年金计划-浦发银行 | 50,697,584 | 2.85 |
| 10 | 中信证券-中行-中信证券聚宝盆稳健收益子集合资产管理计划 | 50,586,227 | 2.84 |

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|----------------------|-----------|-------------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | — | — |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2008年10月24日)基金份额总额 | 1,998,141,990.50 |
| 报告期期初基金份额总额 | 1,998,141,990.50 |
| 本报告期基金总申购份额 | — |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | — |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,998,141,990.50 |

注：本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。本基金本期仍处于封闭运作期间，无申购赎回发生额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内经中国证监会核准，本基金基金管理人于2009年6月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告聘任孟朝霞女士担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所审计报酬为10万元人民币，其已为本公司提供审计服务的连续年限为7年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 安信证券 | 1 | — | — | 220,481,990.85 | 4.41 | 5,009,100,000.00 | 13.63 | 1,271,880.90 | 58.18 | — | — | — |
| 长城证券 | 1 | 22,515,289.66 | 30.58 | 22,258,824.02 | 0.44 | 2,332,700,000.00 | 6.35 | — | — | 19,137.22 | 31.22 | — |
| 长江证券 | 1 | 1,190,215.00 | 1.62 | 144,228,754.35 | 2.88 | 7,720,000,000.00 | 21.01 | — | — | 1,011.67 | 1.65 | — |
| 德邦证券 | 1 | — | — | 4,323,413.49 | 0.09 | 211,000,000.00 | 0.57 | — | — | — | — | — |
| 高华证券 | 1 | — | — | 2,455,315.59 | 0.05 | 177,000,000.00 | 0.48 | — | — | — | — | — |
| 国泰君安 | 2 | 18,795,277.92 | 25.53 | 136,794,443.80 | 2.73 | 4,026,000,000.00 | 10.96 | — | — | 15,271.37 | 24.91 | — |
| 国信证券 | 1 | 1,867,533.44 | 2.54 | 51,869,470.77 | 1.04 | 200,000,000.00 | 0.54 | — | — | 1,517.36 | 2.48 | — |
| 海通证券 | 2 | 13,807,672.90 | 18.75 | 3,994,141,590.04 | 79.84 | 4,348,500,000.00 | 11.84 | — | — | 11,218.77 | 18.30 | — |
| 上海证券 | 1 | — | — | 11,098,149.99 | 0.22 | 260,000,000.00 | 0.71 | — | — | — | — | — |
| 申银万国 | 1 | — | — | 45,313,716.70 | 0.91 | 2,075,000,000.00 | 5.65 | — | — | — | — | — |
| 湘财证券 | 1 | 2,823,543.80 | 3.83 | 80,980,966.28 | 1.62 | 2,951,500,000.00 | 8.03 | — | — | 2,400.17 | 3.92 | — |
| 兴业证券 | 1 | 2,381,909.00 | 3.23 | 25,548,890.19 | 0.51 | 373,000,000.00 | 1.02 | — | — | 2,024.60 | 3.30 | — |
| 中投证券 | 1 | 10,252,344.90 | 13.92 | 257,076,827.04 | 5.14 | 6,979,200,000.00 | 19.00 | 914,295.15 | 41.82 | 8,714.29 | 14.22 | — |
| 中信建投 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

| | | | | | | | | | | | | |
|------|---|---|---|--------------|------|---------------|------|---|---|---|---|---|
| 中信证券 | 1 | - | - | 223,242.78 | 0.00 | 76,000,000.00 | 0.21 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | 6,066,021.50 | 0.12 | - | - | - | - | - | - | - |

注：我对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的；根据本基金与券商的证券交易租用单元协议，本基金不向券商支付国债现货及国债回购和企业债券的交易佣金；本基金本报告期新租用以下交易单元：德邦证券的上交所 24228 交易单元。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009年1月16日，本基金托管人公告聘请胡哲一先生担任本基金托管人副行长；
- 2、2009年5月14日，美国银行公告关于本基金托管人股权变动报告书；
- 3、2009年5月26日，中国建银投资有限责任公司公告关于本基金托管人股权变动报告书；
- 4、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于本基金托管人股权变动报告书；
- 5、2009年8月2日，本基金托管人公告，自2009年7月24日起陈佐夫先生就任本基金托管人执行董事；
- 6、2009年9月27日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告；
- 7、2009年10月11日，本基金托管人发布关于控股股东增持本基金托管人股份的公告。