

富国天丰强化收益债券型证券投资基金
2009 年半年度报告

2009 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司
(简称中国建设银行)

送出日期： 2009 年 08 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。本半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 2009 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

签发：富国基金管理有限公司董事长

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3	管理人对公平交易的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6	管理人对基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5	托管人报告.....	10
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§6	半年度财务会计报告(未经审计).....	10
6.1	资产负债表.....	10
6.2	利润表.....	12
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	13
6.4	报表附注.....	13
§7	投资组合报告.....	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	29
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	29
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.....	30
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	30
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.....	30
7.9	投资组合报告附注.....	30
§8	基金份额持有人信息.....	31
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	32

§9	重大事件揭示.....	32
9.1	基金份额持有人大会决议.....	32
9.2	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.....	32
9.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	32
9.4	基金投资策略的改变.....	32
9.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	33
9.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	33
9.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
9.8	其他重大事件.....	36
§10	影响投资者决策的其他重要信息.....	36
§11	备查文件目录.....	36
11.1	备查文件目录.....	36
11.2	存放地点.....	37
11.3	查阅方式.....	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天丰强化收益债券型基金
基金简称	富国天丰强化债券封闭
交易代码	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
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
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

	6层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	陈敏	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 深圳证券交易所 深圳市深南东路5045号

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	90,898,691.77
本期利润	88,389,138.89
加权平均基金份额本期利润	0.0442
本期加权平均净值利润率	4.21%
本期基金份额净值增长率	4.33%
3.1.2 期末数据和指标	2009年6月30日
期末可供分配利润	32,254,761.99
期末可供分配基金份额利润	0.0161
期末基金资产净值	2,099,360,472.49
期末基金份额净值	1.051
3.1.3 累计期末指标	2009年6月30日
基金份额累计净值增长率	8.71%

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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	-0.29%	0.09%	-0.15%	0.02%	-0.14%	0.07%
过去三个月	1.33%	0.10%	0.29%	0.03%	1.04%	0.07%
过去六个月	4.33%	0.15%	-0.46%	0.09%	4.79%	0.06%
成立至今	8.71%	0.16%	2.89%	0.12%	5.82%	0.04%

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 6 月 30 日。本基金合同生效日为 2008 年 10 月 24 日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 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。

§ 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6月30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、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及富国优化增强债券型证券投资基金十一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合规守信情况的说明

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 管理人对公平交易的专项说明

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

上半年,受全球金融危机影响,一季度国内经济跟随全球经济显著回落。在此背景下,政府出台经济刺激计划,实施宽松的货币政策和积极的财政政策,商业银行的信贷投放出现巨幅增长。政府经济刺激计划效果明显,国内消费保持稳定,投资好于预期,部分抵消了出口下滑的拖累。房地产持续回暖对国内经济复苏提供了支撑,宏观经济出现了好转的迹象。

上半年债券市场尤其是纯利率产品整体表现不佳,仅5月出现小幅反弹;信用债券的投资价值逐步得到市场的认同,随着市场参与者的增多,信用利差收窄,上半年信用债券的超额收益明显;可转债则伴随股票市场的强势而大幅上涨。本基金主要投资于企业债、公司债、分离债以及资产证券化产品等信用产品,并运用适当的杠杆来增强收益,上半年在基金净值波动较小的前提下,取得了优于业绩比较基准的投资回报。截至2009年6月30日,本报告期基金累积净值增长率4.33%,基金分别在2月、3月、4月、5月、6月向基金持有人派发现金红利,每10份基金单位分别派发现金红利0.045元、0.04元、0.08元、0.07元、0.08元。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济好转提高了市场对通胀的预期,IPO重启后市场对无风险收益率水平的预期也同步提升,同时,下半年债券供给量较大,我们预计债券市场还会承受一定的压力。在宏观经济好转的背景下,随着收益率水平的上升,质地较好的信用债券已经具有较高的吸引力。

下半年,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,并适时增加基金的杠杆水平来增加投资组合的基础收益率,同时,本基金还将积极参与新股申购,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

本基金本期分别于2009年2月4日公告每10份基金份额派发红利0.045元，其中根据公告说明派发属于2009年1月红利为每10份基金份额0.025元；2009年3月4日公告派发2009年2月红利每10份基金份额0.04元；2009年4月3日公告派发2009年3月红利每10份基金份额0.08元；2009年5月5日公告派发2009年4月红利每10份基金份额0.07元；2009年6月3日公告派发2009年5月红利每10份基金份额0.08元；本基金共计派发红利62,941,467.14元，其中属于2009年上半年红利为58,945,183.16元。

本基金严格按照相关法律法规及基金合同约定进行利润分配。

§ 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62,941,467.14元。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天丰强化收益债券型基金

报告截止日：2009年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 (2009年06月30日)	上年度末 (2008年12月31日)
资产：			
银行存款		5,665,726.27	5,427,798.54
结算备付金		12,031,414.30	3,547,083.32
存出保证金		145,882.75	—
交易性金融资产		2,384,310,725.71	2,476,588,014.17
其中：股票投资		—	—
债券投资		2,276,216,725.71	2,213,351,014.17
资产支持证券投资		108,094,000.00	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		182,160,000.00	—
应收利息		53,301,971.60	23,852,365.62
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
其他资产		—	—
资产总计		2,637,615,720.63	2,509,415,261.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 (2009年06月30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		535,000,000.00	434,000,000.00
应付证券清算款		1,411,623.95	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		1,038,882.36	1,045,668.38
应付托管费		346,294.09	348,556.14
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		5,852.50	14,119.50
应交税费		241,276.80	—
应付利息		32,798.14	44,116.89
应付利润		—	—
其他负债		178,520.30	50,000.00
负债合计		538,255,248.14	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		101,218,481.99	75,770,810.24
所有者权益合计		2,099,360,472.49	2,073,912,800.74

负债和所有者权益总计		2,637,615,720.63	2,509,415,261.65
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2009 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.051 元，基金份额总额 1,998,141,990.50 份。

所附附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：富国天丰强化收益债券型基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 (2009年01月01日至 2009年06月30日)	上年度可比期间 (2008年01月01日至 2008年06月30日)
一、收入		99,106,144.70	—
1. 利息收入		48,062,809.07	—
其中：存款利息收入		145,546.38	—
债券利息收入		43,900,380.08	—
资产支持证券利息收入		4,016,882.61	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		53,546,980.86	—
其中：股票投资收益		—	—
债券投资收益		52,546,381.05	—
资产支持证券投资收益		1,000,599.81	—
衍生工具投资收益		—	—
股利收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,509,552.88	—
4. 其他收入（损失以“-”号填列）		5,907.65	—
二、费用（以“-”号填列）		-10,717,005.81	—
1. 管理人报酬		-6,245,933.65	—
2. 托管费		-2,081,977.81	—
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		-21,288.78	—
5. 利息支出		-2,171,451.25	—
其中：卖出回购金融资产支出		-2,171,451.25	—
6. 其他费用		-196,354.32	—
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		88,389,138.89	—

注：本基金合同于 2008 年 10 月 24 日生效，无上年度对比数据。所附附注为本会计报表的组成部分。

6.3 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基金

本报告期：2009年01月01日至2009年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2009年01月01日至2009年06月30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)	—	88,389,138.89	88,389,138.89
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(以“-”号填列)	—	—	—
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)	—	-62,941,467.14	-62,941,467.14
五、期末所有者权益（基金净值）	1,998,141,990.50	101,218,481.99	2,099,360,472.49
项目	上年度可比期间 (2008年01月01日至2008年06月30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）	—	—	—
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	—	—
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(以“-”号填列)	—	—	—
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)	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	—	—	—

注：本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。所附附注为本会计报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 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于2008年10月15日至2008年10月17日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2008)验字第60467606_B01号报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2008年10月24日生效。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）。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,997,741,014.10元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币400,976.40元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,998,141,990.50元，折合1,998,141,990.50份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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。

6.4.2 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、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3号《半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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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6月30日的财务状况以及2009年上半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。

6.4.4 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

本报告期内本基金所采用的会计政策、会计估计与上年度报表相一致。

6.4.4.1 会计政策变更的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.5 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2009年06月30日）
活期存款	5,665,726.27
定期存款	—
其他存款	—

合计	5,665,726.27
----	--------------

注：本基金本报告期内未投资于定期存款。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2009年06月30日）		
		成本	公允价值	估值增值
股票		—	—	—
债券	交易所市场	1,528,051,868.26	1,581,674,725.71	53,622,857.45
	银行间市场	679,781,082.48	694,542,000.00	14,760,917.52
	合计	2,207,832,950.74	2,276,216,725.71	68,383,774.97
资产支持证券		107,514,054.97	108,094,000.00	579,945.03
其他		—	—	—
合计		2,315,347,005.71	2,384,310,725.71	68,963,720.00

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本期末无买入返售金融资产余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末无买入返售金融资产余额。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2009年06月30日）
应收活期存款利息	14,729.37
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	4,211.00
应收债券利息	53,239,935.17
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	43,096.06
合计	53,301,971.60

注：上表中应收利息的其他项目所列金额为本基金本期末应收资产支持证券利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本期末无其他资产余额。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2009年06月30日）
----	------------------

交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	5,852.50
合计	5,852.50

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2009年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提上市费	29,752.78
预提审计师费	49,588.57
预提信息披露费	99,178.95
合计	178,520.30

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,998,141,990.50	1,998,141,990.50
本期申购	—	-
本期赎回	—	—
本期末	1,998,141,990.50	1,998,141,990.50

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,297,537.36	71,473,272.88	75,770,810.24
本期利润	90,898,691.77	-2,509,552.88	88,389,138.89
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-62,941,467.14	—	-62,941,467.14
本期末	32,254,761.99	68,963,720.00	101,218,481.99

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）
活期存款利息收入	80,727.05
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	64,819.33
其他	—
合计	145,546.38

6.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）
卖出股票成交总额	—
卖出股票成本总额	—
股票投资收益	—

注：本基金本报告期末未投资于股票资产。

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）
卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成交金额	1,202,380,503.47
卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成本总额	-1,129,082,496.63
应收利息总额	-20,751,625.79
债券投资收益	52,546,381.05

6.4.6.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期无权证投资收益。

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）
股票投资产生的股利收益	—
合计	—

注：本基金本报告期末未投资于股票资产。

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）
1. 交易性金融资产	-2,509,552.88
股票投资	—
债券投资	5,658,639.51
资产支持证券投资	-8,168,192.39
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	-2,509,552.88

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）
基金赎回费收入	—

其他	5,907.65
合计	5,907.65

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年06月30日)
交易所市场交易费用	13,938.78
银行间市场交易费用	7,350.00
合计	21,288.78

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年06月30日)
审计费用	49,588.57
信息披露费	99,178.95
银行费用	10,334.02
上市费	29,752.78
债券帐户维护费	7,500.00
合计	196,354.32

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

本基金于2009年7月2日公告2009年7月7日每10份基金份额派发红利0.09元，权益登记日为2009年7月7日；于2009年8月5日公告2009年8月10日每10份基金份额派发红利0.07元，权益登记日为2009年8月10日。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人、注册登记人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(简称“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(简称“申银万国证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司(简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.1.2 权证交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.1.3 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06月30日)		上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30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	703,967,976.66	66.20	—	—
申银万国	31,489,189.26	2.96	—	—

注：本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.1.4 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06月30日)		上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30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	3,311,700,000.00	27.87	—	—
申银万国	2,075,000,000.00	17.46	—	—

注：本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：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（包括与本基金存在关联方关系的海通证券股份有限公司和申银万国证券股份有限公司）支付国债现货及国债回购和企业债券的交易佣金。基金管理人从关联方获取的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年06月30日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日)
当期应支付的管理费	6,245,933.65	—

其中：当期已支付	5,207,051.29	—
期末未支付	1,038,882.36	—

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。

本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年06月30日）	上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30日）
当期应支付的托管费	2,081,977.81	—
其中：当期已支付	1,735,683.72	—
期末未支付	346,294.09	—

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。

本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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06月30日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日)
期初持有的基金份额	13,570,221.30	—
期间认购总份额	—	—
期间申购/买入总份额	19,999,939.00	—
期间赎回/卖出总份额	—	—
期间拆分增加份额	—	—
期末持有的基金份额	33,570,160.30	—

期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.68%	—
-------------------	-------	---

6.4.9.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末和上年度末均未投资本基金。

6.4.9.5 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06月30日）		上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30日）	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行	5,665,726.27	80,727.05	—	—

注：本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2009年01月01日至2009年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券	122964	09 龙湖债	公开发行	300,000	30,000,000.00
海通证券	122982	09 长城开	公开发行	200,000	20,000,000.00
海通证券	122985	09 浙能债	公开发行	400,000	40,000,000.00
海通证券	098009	09 上实债	公开发行	300,000	30,000,000.00
海通证券	098012	09 余城建 债	公开发行	300,000	30,000,000.00
海通证券	098041	09 永煤债	公开发行	200,000	20,000,000.00

注：本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。本基金虽在承销期内从一级市场购入海通证券担任副主承销商或分销商的上述证券，但并未直接向海通证券购入上述证券。

6.4.10 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2009-02-06	2009-02-09	0.045	8,991,639.54	—	8,991,639.54
2	2009-03-06	2009-03-09	0.040	7,992,565.86	—	7,992,565.86
3	2009-04-07	2009-04-08	0.080	15,985,134.17	—	15,985,134.17
4	2009-05-07	2009-05-08	0.070	13,986,993.37	—	13,986,993.37
5	2009-06-05	2009-06-08	0.080	15,985,134.20	—	15,985,134.20
合计			0.315	62,941,467.14	0.00	62,941,467.14

6.4.11 期末（2009年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有股票资产。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末无银行间市场债券正回购余额，没有因正回购而作为抵押的银行间市场债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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总额为 535,000,000.00 元，分别于 2009 年 7 月 1 日、3 日、6 日和 7 日到期。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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，基金资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

注：下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2009年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,665,726.27	-	-	-	-	-	5,665,726.27
结算备付金	12,031,414.30	-	-	-	-	-	12,031,414.30
存出保证金	-	-	-	-	-	145,882.75	145,882.75
交易性金融资产	-	338,359,900.00	-	1,728,171,519.31	317,779,306.40	-	2,384,310,725.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	182,160,000.00	182,160,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	53,301,971.60	53,301,971.60
资产总计	17,697,140.57	338,359,900.00	-	1,728,171,519.31	317,779,306.40	235,607,854.35	2,637,615,720.63
负债							
卖出回购金融资产款	535,000,000.00	-	-	-	-	-	535,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,411,623.95	1,411,623.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,038,882.36	1,038,882.36
应付托管费	-	-	-	-	-	346,294.09	346,294.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,852.50	5,852.50
应付税费	-	-	-	-	-	241,276.80	241,276.80
应付利息	-	-	-	-	-	32,798.14	32,798.14
其他负债	-	-	-	-	-	178,520.30	178,520.30
负债总计	535,000,000.00	-	-	-	-	3,255,248.14	538,255,248.14
利率敏感度缺口	-517,302,859.43	338,359,900.00	-	1,728,171,519.31	317,779,306.40	232,352,606.21	2,099,360,472.49
上年度末（2008年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,427,798.54	-	-	-	-	-	5,427,798.54
结算备付金	3,547,083.32	-	-	-	-	-	3,547,083.32
交易性金融资产	-	-	516,997,938.00	1,400,420,596.77	559,169,479.40	-	2,476,588,014.17

应收利息	-	-	-	-	-	23,852,365.62	23,852,365.62
资产总计	8,974,881.86	-	516,997,938.00	1,400,420,596.77	559,169,479.40	-	2,509,415,261.65
负债							
卖出回购金融资产款	434,000,000.00	-	-	-	-	-	434,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,045,668.38	1,045,668.38
应付托管费	-	-	-	-	-	348,556.14	348,556.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,119.50	14,119.50
应付利息	-	-	-	-	-	44,116.89	44,116.89
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	434,000,000.00	-	-	-	-	1,502,460.91	435,502,460.91
利率敏感度缺口	-425,025,118.14	-	516,997,938.00	1,400,420,596.77	559,169,479.40	22,349,904.71	2,073,912,800.74

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 影响生息资产的其他变量不变，仅利率发生变动		
	2. 利率变动范围合理		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：千元）	
		本期末（2009年06月30日）	上年度末（2008年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-7,800.52	-8,829.61
2. 基准点利率减少0.1%	7,800.52	8,829.61	

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2009年06月30日）		上年度末（2008年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,276,216,725.71	108.42%	2,213,351,014.17	106.72%
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	108,094,000.00	5.15%	263,237,000.00	12.69%
合计	2,384,310,725.71	113.57%	2,476,588,014.17	119.42%

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关		
	2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金的风险变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：千元）	
		本期末（2009年06月30日）	上年度末（2008年12月31日）
	1. 业绩比较基准减少1%	-22,574.85	-13,232.05
	2. 业绩比较基准增加1%	22,574.85	13,232.05

6.4.13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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	2,384,310,725.71	90.40
	其中：债券	2,276,216,725.71	86.30
	资产支持证券	108,094,000.00	4.10
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	17,697,140.57	0.67
6	其他资产	235,607,854.35	8.93
7	合计	2,637,615,720.63	100.00

7.2 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	—	—
B	采掘业	—	—

C	制造业	—	—
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	—	—
C8	医药、生物制品	—	—
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	—	—
H	批发和零售贸易	—	—
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	—	—

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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

注：本基金本报告期内未投资股票资产。

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

注：本基金本报告期内未投资股票资产。

7.4.3 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	—
卖出股票收入（成交）总额	—

注：本基金本报告期内未投资股票资产。

7.5 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	60,150,000.00	2.87
	其中：政策性金融债	60,150,000.00	2.87
4	企业债券	1,991,420,425.71	94.86
5	企业短期融资券	172,441,000.00	8.21
6	可转债	52,205,300.00	2.49
7	其他	—	—
8	合计	2,276,216,725.71	108.42

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

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	1,420,000	153,573,000.00	7.32
2	122996	08 常城建	1,370,000	140,836,000.00	6.71
3	0881182	08 方正 CP02	1,200,000	121,776,000.00	5.80
4	122995	08 合建投	1,120,000	113,713,600.00	5.42
5	088045	08 联想债	1,000,000	105,680,000.00	5.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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	102,466,000.00	4.88
2	0840011	08 浙元 1A	300,000	3,168,000.00	0.15
3	0831011	08 建元 1 优先	2,000,000	2,460,000.00	0.12

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

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。

本基金本报告期及报告期末均未持有股票资产。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	145,882.75
2	应收证券清算款	182,160,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	53,301,971.60
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	235,607,854.35

7.9.4 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	52,205,300.00	2.49

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

	额	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
8049	248,247.23	1,334,188,019.74	66.77	663,953,970.76	33.23

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（%）
1	中信证券—中信—中信证券债券优化集合资产管理计划	139,901,167	9.54
2	中英人寿保险有限公司(个险万能)	91,526,000	6.24
3	中国人寿保险股份有限公司	90,800,829	6.19
4	中信信托有限责任公司-债券增值1号	85,976,692	5.86
5	中国人民健康保险股份有限公司	70,017,900	4.77
6	中国人保寿险有限公司	50,012,500	3.41
6	永安财产保险股份有限公司	50,012,500	3.41
8	招商证券股份有限公司	50,006,000	3.41
9	中投信托有限责任公司-建行利得盈5号-001	47,469,412	3.24
10	国都证券-建行-国都2号-安心理财集合资产管理计划	47,267,957	3.22

注：截至本报告期末，本基金份额持有人中国人保寿险有限公司和永安财产保险股份有限公司持有相同数量的上市基金份额。

§9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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。

9.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 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	—	—	143,017,010.69	13.45	2,194,000,000.00	18.47	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	521,546.71	0.05	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	7,510,774.18	0.71	652,000,000.00	5.49	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
高华证券	1	—	—	2,455,315.59	0.23	177,000,000.00	1.49	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	16,532,856.18	1.55	453,000,000.00	3.81	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	22,971,192.40	2.16	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	2	—	—	703,967,976.66	66.20	3,311,700,000.00	27.87	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申银万国	1	—	—	31,489,189.26	2.96	2,075,000,000.00	17.46	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	19,859,787.41	1.87	1,661,500,000.00	13.98	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	1,070,472.60	0.10	310,000,000.00	2.61	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	107,697,072.33	10.13	971,000,000.00	8.17	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

中信证券	1	-	-	223,242.78	0.02	76,000,000.00	0.64	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	6,066,021.50	0.57	-	-	-	-	-	-	-
合计	18	-	-	1,063,382,458.29	100.00	11,881,200,000.00	100.00	-	-	-	-	-

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 24228 交易单元。

9.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国天丰强化收益债券型证券投资基金收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年02月04日
2	富国天丰强化收益债券型证券投资基金收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年03月04日
3	富国天丰强化收益债券型证券投资基金二00九年第三次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年04月03日
4	富国天丰强化收益债券型证券投资基金二00九年第四次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年05月05日
5	富国天丰强化收益债券型证券投资基金二00九年第五次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年06月03日

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

1、2009年1月16日，本基金托管人公告中国建设银行股份有限公司聘请胡哲一先生担任中国建设银行股份有限公司副行长；

2、2009年5月14日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

3、2009年5月26日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

4、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

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中国建设银行股份有限公司执行董事。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国天丰强化收益债券型证券投资基金的文件

- 2、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国天丰强化收益债券型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国天丰强化收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）
公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司
2009 年 08 月 27 日