

富国天丰强化收益债券型证券投资基金  
2009 年半年度报告  
(摘要)

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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

## § 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
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

### 2.4 信息披露方式

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
--

### § 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

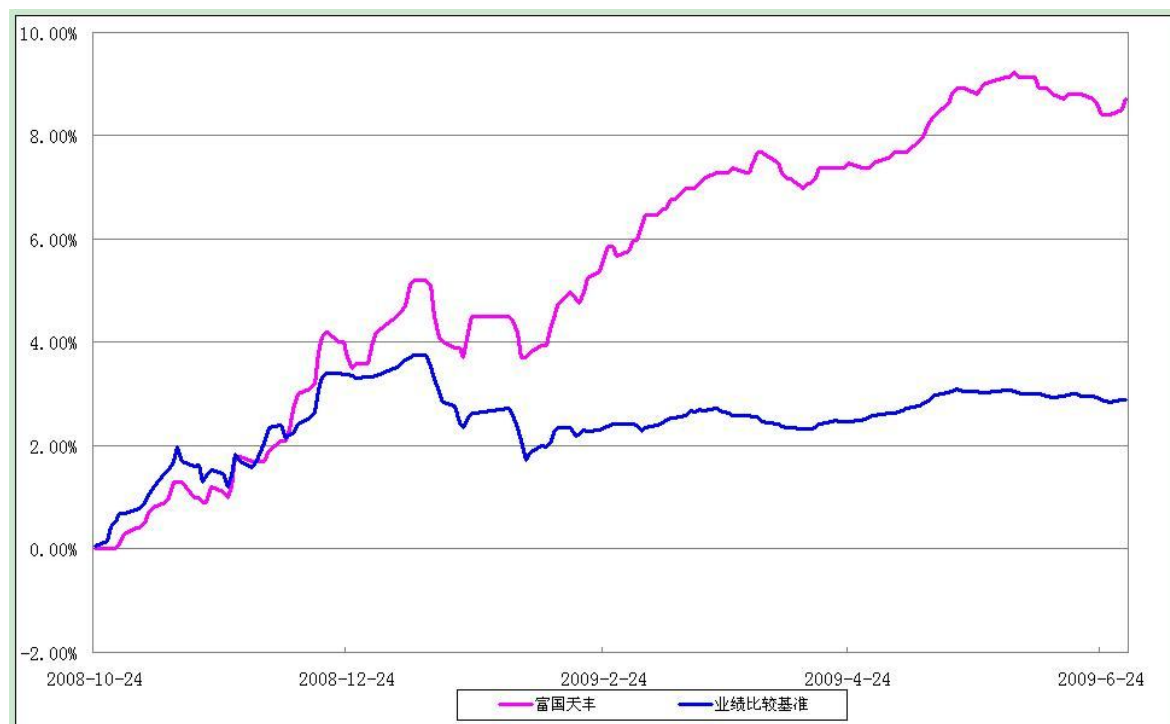
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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，严格执行交易系统中的公平交易程序，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	本期末 (2009年06月30日)	上年度末 (2008年12月31日)
<b>资产：</b>		
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
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2009年06月30日)</b>	<b>(2008年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>		
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
<b>所有者权益:</b>		
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。

## 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	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	—
<b>二、费用（以“-”号填列）</b>	<b>-10,717,005.81</b>	<b>—</b>
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	—
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>88,389,138.89</b>	<b>—</b>

注：本基金合同于2008年10月24日生效，无上年度对比数据。

### 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。

#### 6.4 报表附注

6.4.1 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。

##### 6.4.1.1 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。

##### 6.4.1.2 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。

##### 6.4.1.3 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。

#### 6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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。

##### 6.4.2.2 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	基金托管人、基金代销机构

建设银行”)

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。

#### 6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.3.1.1 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。

###### 6.4.3.1.2 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。

###### 6.4.3.1.3 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。

###### 6.4.3.1.4 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。

###### 6.4.3.1.5 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。

##### 6.4.3.2 关联方报酬

###### 6.4.3.2.1 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。

#### 6.4.3.2.2 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。

#### 6.4.3.3 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。

#### 6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.3.4.1 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%	—
-------------------	-------	---

#### 6.4.3.4.2 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。

#### 6.4.3.5 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。

#### 6.4.3.6 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。

#### 6.4.4 期末（2009年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.4.3.1 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。

###### 6.4.4.3.2 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。

6.4.5 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前十名股票投资明细

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	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 (%)
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。

## § 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。

富国基金管理有限公司  
2009年08月27日