

# 富国天利增长债券投资基金

## 二 00 八年年度报告

(摘要)

2008 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二 00 九年三月三十一日

## § 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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2009 年 3 月 27 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。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国天利
交易代码	前端交易代码：100018 后端交易代码：100019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 12 月 2 日
报告期末基金份额总额	2, 180, 056, 270. 83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，投资目标是在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益。
投资策略	久期控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，属于低风险的基金品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李长伟	蒋松云
	联系电话	021-68597788	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-68597799	010—66105798

### 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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号
------------	--

### § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
本期已实现收益	163,217,918.77	271,448,706.04	46,819,776.04
本期利润	94,081,658.88	443,561,251.07	68,086,356.07
加权平均基金份额本期利润	0.0294	0.3437	0.2509
本期基金份额净值增长率	3.65%	38.70%	27.56%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.0333	0.0135	0.0771
期末基金资产净值	2,753,870,684.75	3,543,111,195.00	339,735,426.97
期末基金份额净值	1.2632	1.2545	1.1490

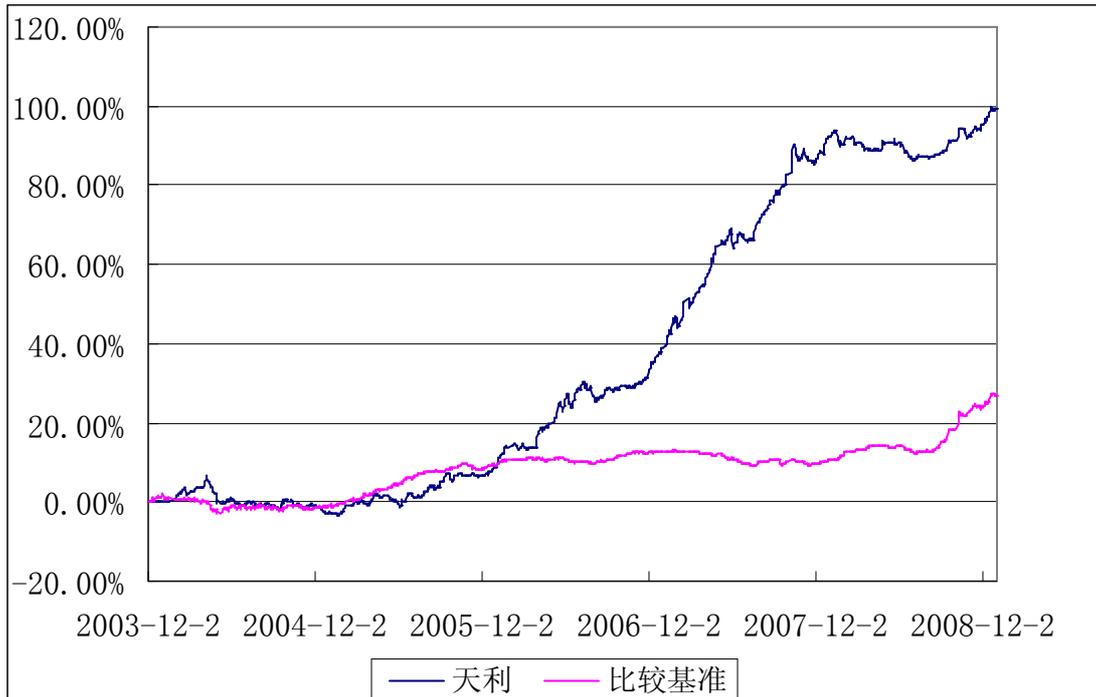
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 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

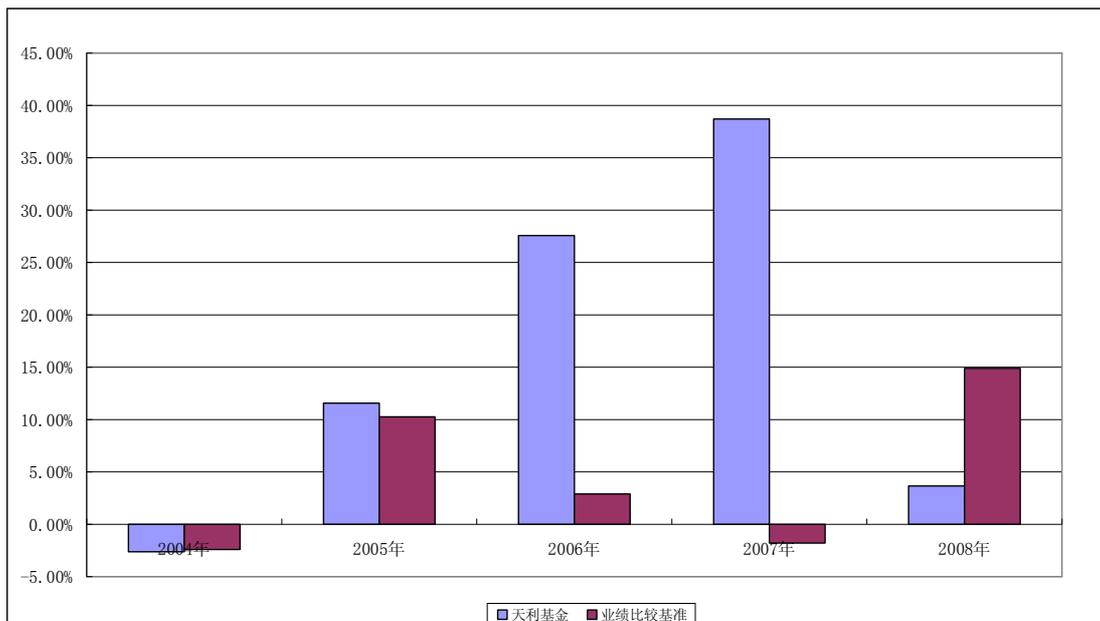
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.19%	0.20%	7.28%	0.33%	-3.09%	-0.13%
过去六个月	6.89%	0.17%	12.83%	0.26%	-5.94%	-0.09%
过去一年	3.65%	0.21%	14.89%	0.20%	-11.24%	0.01%
过去三年	83.39%	0.35%	16.08%	0.14%	67.31%	0.21%
过去五年	99.24%	0.33%	24.90%	0.21%	74.34%	0.12%
自基金合同生效起至今	99.51%	0.33%	27.04%	0.21%	72.47%	0.12%

### 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 2008 年 12 月 31 日。本基金于 2003 年 12 月 2 日成立，建仓期 6 个月，从 2003 年 12 月 2 日至 2004 年 6 月 1 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 过去五年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



### 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
2008	0.350	64,981,057.26	61,743,096.26	126,724,153.52	2 次分红
2007	2.900	168,571,363.04	233,824,494.52	402,395,857.56	5 次分红
2006	1.300	26,018,640.11	7,644,171.35	33,662,811.46	5 次分红
合计	4.550	259,571,060.41	303,211,762.13	562,782,822.54	12 次分红

## § 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 2008 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及富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金十只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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经理、富国天丰强化收益	2006 年 1 月 12 日	—	10 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，现任富国天利基金经

	债券型证券投资基金基金经理。				理兼固定收益部经理、富国天丰基金经理。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利增长债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》、《富国天利增长债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的说明

在报告期内本基金严格控制风险，实现了净值的稳定增长，报告期内净值增长率为 3.65%，并通过分红为持有人实现了一定收益。

本基金在 2008 年整体投资策略上基本把握住了宏观经济和债市的脉络。

基于对宏观经济形势的判断，2008 年上半年天利债券基金在操作上采取了维持低久期、降低可转债比例的防御性措施。在债券部分的投资策略基本符合市场走势，并未偏离太多。但是，股票市场超出预期大幅下跌，使本基金在个别股票的增发新股认购上遭受了一定程度损失，从而拖累了天利基金在 2008 年上半年的业绩。

随着 2008 年下半年通胀形势逆转，天利基金开始增加久期，并在 7 月初旗帜鲜明的提出要增加高等级企业债和公司债的投资策略。此外，我们认为，股市经过大幅下跌后存在反弹机会，因此在 08 年 12 月采取了增加可转债资产比例、尽可能将此前申购到的新股持有至契约期限末期的策略。这在 08 年底股市止跌走强后，为基金贡献了较好的收益。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 1、宏观经济依然形势严峻，难言乐观

2009 年宏观经济依然严峻。在对外贸易依存度接近 60% 的情况下，中国经济内需（投资、消费）的一部分本身就建立在外需较快的基础上（即部分投资是为了出口而进行的投资，消费的一部分资金来自于出口企业从业人员的收入）。外需一旦萎缩，对应的那部分内需将坍塌一块。即使政府刺激内需，也首先得补齐坍塌的这一块，其次才可能部分抵消外需萎缩。我们认为刺激内需只能少部分弥补外需缺口。中国脱离美国甚至全球经济寒冬而独善其身的可能性并不大。

从时间段上来看，12 月及 1 季度信贷大量投放，有助于宏观经济在 09 年上半年相对稳定，短期投资加速可以部分弥补消费和出口下滑，由于基数原因 GDP 增速看来也将逐季反弹。但下半年信贷对投资的效用逐渐减弱，而彼时外需如果依旧萎靡，则经济可能仍然继续调整。

##### 2、宏观经济政策：降息预期减弱，财政刺激持续

降息的目的是刺激信贷。目前信贷放量存在商业银行抢项目的原因，也存在响应宏观刺激政策的原因，但无论如何，信贷量短期巨量释放是现实存在的。因此，短期内大幅降息的可能性大为减弱。我们预期 2009 年上半年降息 27 个基点，下半年降息 54 个基点。如果下半年起经济再现颓势，财政政策可能再次强力出台，主要仍是大规模基建和刺激国内消费。

### 3、债市短期调整，全年依然看好

我们认为，2009 年经济不确定性仍较高，降息预期依然存在，维持低增长低通胀的可能性很大，因此债市的基本面并没有发生显著变化，依然处于牛市中后期。从时间上看，下半年债市可能好于上半年。从品种上看，信用债和可转债存在较多机会。具体而言，我们认为年内债市机会最大的来自于 3~5 年的信用债，特别是那些信用等级在 AA 附近的信用债。因为 3~5 年的利率风险较小，而宏观经济逐渐企稳将降低其信用风险，这类信用债将是获得超额收益的主要品种。其次，大幅波动的股市和债市，给可转债创造了较大的投资机会。可转债将是 09 年较好的阶段性投资品种。

### 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 2008 年 3 月 27 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，共计派发红利 73,588,399.38 元，权益登记日 2008 年 3 月 28 日；于 2008 年 6 月 25 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.15 元，共计派发红利 53,135,754.14 元，权益登记日 2008 年 6 月 26 日；于 2009 年 1 月 5 日公告派发 2008 年度收益，每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，共计派发红利 41,989,601.18 元，权益登记日 2009 年 1 月 7 日。本基金共计派发 2008 年度红利 168,713,754.70 元。

根据本基金《基金合同》约定：“基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%”。本基金 2008 年度净收益（净收益即为财务指标中的本期已实现收益）为 163,217,918.77 元，共计派发 2008 年收益分配金额 168,713,754.70 元，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

2008 年，本基金托管人在对富国天利增长债券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》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

2008 年，富国天利增长债券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国天利增长债券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国天利增长债券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配，分配金额共计 126,724,153.52 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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国天利增长债券投资基金 2008 年度报告中财务指标、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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2009 年 3 月 27 日

## § 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：富国天利增长债券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	期末余额 2008 年 12 月 31 日	期初余额 2007 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	2,994,617,541.04	3,776,701,641.56
银行存款	50,900,207.88	273,611,311.22
结算备付金	2,421,116.35	26,578,750.58
存出保证金	598,780.49	598,780.49
交易性金融资产	2,876,376,585.09	3,357,619,411.44
其中：股票投资	11,348,377.63	293,159,372.24
债券投资	2,785,481,741.71	3,054,603,874.82
资产支持证券投资	79,546,465.75	9,856,164.38
衍生金融资产	—	4,956,649.12
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	1,252,308.69	—
应收利息	45,045,705.03	36,583,828.10
应收股利	—	—
应收申购款	18,022,837.51	76,752,910.61
其他资产	—	—
资产合计	2,994,617,541.04	3,776,701,641.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>期末余额</b> <b>2008 年 12 月 31 日</b>	<b>期初余额</b> <b>2007 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	240,746,856.29	233,590,446.56
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	200,000,000.00	—
应付证券清算款	3,263,289.96	9,109,075.65
应付赎回款	33,379,214.33	220,209,693.80
应付管理人报酬	2,021,909.71	2,119,749.34

应付托管费	505,477.46	529,937.34
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	92,944.91	238,497.70
应交税费	847,336.28	675,423.44
应付利息	26,000.00	—
应付利润	—	—
其他负债	610,683.64	708,069.29
负债合计	240,746,856.29	233,590,446.56
<b>所有者权益：</b>	<b>2,753,870,684.75</b>	<b>3,543,111,195.00</b>
实收基金	2,180,056,270.83	2,824,385,070.32
未分配利润	573,814,413.92	718,726,124.68
所有者权益合计	2,753,870,684.75	3,543,111,195.00
负债和所有者权益总计	2,994,617,541.04	3,776,701,641.56

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2632 元，基金份额总额 2,180,056,270.83 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天利增长债券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

金额单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日 至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	153,871,103.47	491,479,321.50
1. 利息收入	135,129,501.21	38,153,164.10
其中：存款利息收入	4,143,128.08	4,166,762.91
债券利息收入	128,856,426.38	33,539,922.08
资产支持证券利息收入	2,004,218.75	396,032.88
买入返售金融资产收入	125,728.00	50,446.23
2. 投资收益（损失以“-”填列）	84,964,647.43	278,899,363.49
其中：股票投资收益	26,604,815.54	216,151,337.89
债券投资收益	48,252,190.58	55,564,524.00
资产支持证券投资收益	66,136.99	252,290.09
衍生工具收益	9,618,005.51	6,700,777.46
股利收益	423,498.81	230,434.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	-69,136,259.89	172,112,545.03

填列)		
4. 其他收入 (损失以“-”号填列)	2,913,214.72	2,314,248.88
<b>二、费用 (以“-”填列)</b>	<b>-59,789,444.59</b>	<b>-47,918,070.43</b>
1. 管理人报酬	-31,345,381.91	-12,641,216.77
2. 托管费	-7,836,345.54	-3,160,304.28
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	-2,147,331.92	-2,142,024.11
5. 利息支出	-18,207,935.84	-29,726,766.77
其中: 卖出回购金融资产支出	-18,207,935.84	-29,726,766.77
6. 其他费用	-252,449.38	-247,758.50
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>94,081,658.88</b>	<b>443,561,251.07</b>

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 富国天利增长债券投资基金

本报告期: 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

金额单位: 人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 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)	2,824,385,070.32	718,726,124.68	3,543,111,195.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	94,081,658.88	94,081,658.88
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)	-644,328,799.49	-112,269,216.12	-756,598,015.61
其中: 1. 基金申购款	2,883,447,923.52	677,162,961.28	3,560,610,884.80
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-3,527,776,723.01	-789,432,177.40	-4,317,208,900.41
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)	—	-126,724,153.52	-126,724,153.52
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,180,056,270.83	573,814,413.92	2,753,870,684.75
项目	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 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)	295,690,724.84	44,044,702.13	339,735,426.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	443,561,251.07	443,561,251.07

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）	2,528,694,345.48	633,516,029.04	3,162,210,374.52
其中：1. 基金申购款	5,054,857,730.68	1,263,928,876.68	6,318,786,607.36
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,526,163,385.20	-630,412,847.64	-3,156,576,232.84
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）	—	-402,395,857.56	-402,395,857.56
五、期末所有者权益（基金净值）	2,824,385,070.32	718,726,124.68	3,543,111,195.00

## 7.4 会计报表附注

### 7.4.1 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

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

根据中国证券监督管理委员会证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（以下简称“指导意见”）的要求，本基金自2008年9月16日起，对特定投资品种变更了估值方法，具体如下：

- (1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值进行估值；
- (2) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值进行估值；

本基金采用中国证券业协会基金估值工作小组推荐的“指数收益法”进行估值。另外，根据《指导意见》的要求，本基金的管理人对管理的不同基金持有的同一投资品种采用一致的估值政策、程序及相关的方法。对于该会计估计变更，本基金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更于2008年度均系因股票长期停牌而引起，对本基金2008年9月16日的净利润和资产净值无影响，对2008年度净利润及2008年末资产净值无影响。

### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本期未发生重大会计差错，无需更正。

### 7.4.2 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、基金发起人 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
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
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
上海申银万国证券研究所有限公司	基金管理人的股东控制的机构

7.4.2.1 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  
 本基金本期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.2.2 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 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
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
上海申银万国证券研究所有限公司	基金管理人的股东控制的机构

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

### 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	318,986,577.41	52.10%	301,599,667.92	56.85%
申银万国证券	293,306,612.95	47.90%	228,885,618.40	43.15%

#### 7.4.3.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比例
海通证券	34,335,727.94	62.64%	7,807,852.17	63.97%
申银万国证券	20,480,544.45	37.36%	4,397,599.96	36.03%

#### 7.4.3.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	1,427,126,489.61	48.27%	1,229,163,328.55	60.89%
申银万国证券	1,529,369,704.22	51.73%	789,550,317.27	39.11%

#### 7.4.3.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	11,506,900,000.00	34.30%	8,077,500,000.00	57.66%
申银万国证券	22,036,800,000.00	65.70%	5,932,000,000.00	42.34%

#### 7.4.3.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	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	389,655.17	51.37%	63,245.31	73.48%
申银万国证券	368,922.54	48.63%	22,824.60	26.52%
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			

	当期佣金	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	296,952.02	58.36%	104,863.20	46.68%
申银万国证券	211,865.98	41.64%	119,763.55	53.32%

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。

#### 7.4.3.2 关联方报酬

##### 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007 年12月31日
当期应支付的管理费	31,345,381.91	12,641,216.77
其中：当期已支付	29,323,472.20	10,521,467.43
期末未支付	2,021,909.71	2,119,749.34

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付管理费。

##### 7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007 年12月31日
当期应支付的托管费	7,836,345.54	3,160,304.28
其中：当期已支付	7,330,868.08	2,630,366.94
期末未支付	505,477.46	529,937.34

注：(1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。

#### 7.4.3.3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 2008年1月1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
中国工商银行	—	178,640,530.08	—	—	—	—
上年度可比期间 2007年1月1日至2007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
中国工商银行	—	—	—	—	29,400,000.00	6,862.68

#### 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人 2008 年度及 2007 年度均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.3.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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
上海申银万国证券研究所有限公司	32,608,988.70	1.50%	7,893,739.63	0.28%

注：本基金管理人的股东申银万国证券股份有限公司控制的机构上海申银万国证

券研究所有限公司投资本基金的费率按照公告费率执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.3.5 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 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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
中国工商银行	50,900,207.88	3,382,791.75	273,611,311.22	3,720,551.98

7.4.3.6 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 2008年1月1日至2008年12月31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	601898	中煤能源	公开发行	2,078,294	34,977,688.02
海通证券	601186	中国铁建	公开发行	3,275,800	29,744,264.00
海通证券	601958	金钼股份	公开发行	1,190,313	19,723,486.41
海通证券	122997	08 苏高新债	公开发行	300,000	30,000,000.00
海通证券	088039	08 兵器装备债	公开发行	300,000	30,000,000.00
申银万国	122006	08 金地债	公开发行	840,000	84,000,000.00
海通证券	110003	新钢转债	公开发行	151,940	15,194,000.00
海通证券	088054	08 南网债 01	公开发行	600,000	60,000,000.00
上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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
申银万国、海通证券	601166	兴业银行	公开发行	98,000	1,566,040.00
申银万国、海通证券	601318	中国平安	公开发行	162,240	5,483,712.00
申银万国、海通证券	601998	中信银行	公开发行	982,000	5,695,600.00
申银万国、海通证券	601919	中国远洋	公开发行	891,310	7,558,308.80
海通证券	601168	西部矿业	公开发行	190,250	2,564,570.00
海通证券	601169	北京银行	公开发行	752,400	9,405,000.00
申银万国、海通证券	601939	建设银行	公开发行	4,853,120	31,302,624.00
申银万国、海通证券	601808	中海油服	公开发行	464,920	6,267,121.60
申银万国、海通证券	601857	中国石油	公开发行	1,617,000	27,003,900.00
申银万国、海通证券	601088	中国神华	公开发行	1,183,240	43,768,047.60
申银万国、海通证券	601390	中国中铁	公开发行	4,555,960	21,868,608.00
申银万国	601866	中海集运	公开发行	1,980,274	13,109,413.88
申银万国、海通证券	601601	中国太保	公开发行	782,460	23,473,800.00
海通证券	126003	07 云化债	公开发行	20,810	2,081,000.00
海通证券	126005	07 武钢债	公开发行	134,190	13,419,000.00
海通证券	126008	08 上汽债	公开发行	151,540	15,154,000.00

海通证券	115002	07 中信国安债	公开发行	7,880	788,000.00
申银万国、海通证券	110026	中海转债	公开发行	216,680	21,668,000.00

注：本基金虽在承销期内从一级市场购入海通证券、申银万国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、申银万国证券购入上述证券。

#### 7.4.4 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
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
002257	立立电子	2008-06-30	未知	新股认购	21.81	21.81	43,974	959,072.94	959,072.94
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券									
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
088071	08 东特债	2008-12-29	2009-1-6	认购新债	100.00	100.89	200,000	20,000,000.00	20,178,000.00

##### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本年末未持有暂时停牌股票。

##### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金年末未持有在银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2008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200,000,000.00元，于2009年1月5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。

#### 7.4.5 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。

## §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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	11,348,377.63	0.38
	其中：股票	11,348,377.63	0.38
2	固定收益投资	2,865,028,207.46	95.67

	其中：债券	2,785,481,741.71	93.02
	资产支持证券	79,546,465.75	2.66
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	53,321,324.23	1.78
6	其他资产	64,919,631.72	2.17
7	合计	2,994,617,541.04	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	—	—
C	制造业	7,689,099.98	0.28
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	381,358.05	0.01
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	1,542,789.19	0.06
C6	金属、非金属	762,392.30	0.03
C7	机械、设备、仪表	5,002,560.44	0.18
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	1,444,255.40	0.05
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	237,665.54	0.01
H	批发和零售贸易	1,977,356.71	0.07
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	11,348,377.63	0.41

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601766	中国南车	800,000	3,448,000.00	0.13

2	002269	美邦服饰	59,612	1,651,252.40	0.06
3	002267	陕天然气	121,366	1,444,255.40	0.05
4	002257	立立电子	43,974	959,072.94	0.03
5	002271	东方雨虹	23,033	762,392.30	0.03
6	002266	浙富股份	30,196	630,492.48	0.02
7	002273	水晶光电	27,625	583,716.25	0.02
8	002270	法因数控	49,124	534,469.12	0.02
9	002260	伊立浦	61,548	389,598.84	0.01
10	002259	升达林业	84,185	381,358.05	0.01

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	证券代码	证券名称	累计买入金额（元）	占期初基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	217,130,051.00	6.13
2	600026	中海发展	35,227,142.44	0.99
3	601899	紫金矿业	35,212,945.26	0.99
4	601898	中煤能源	34,977,688.02	0.99
5	601186	中国铁建	29,744,264.00	0.84
6	601958	金钼股份	19,723,486.41	0.56
7	600236	桂冠电力	15,513,962.66	0.44
8	601766	中国南车	8,053,741.86	0.23
9	000402	金融街	6,615,797.76	0.19
10	600232	金鹰股份	5,211,279.90	0.15
11	600557	康缘药业	3,257,853.72	0.09
12	002003	伟星股份	2,679,012.45	0.08
13	002244	滨江集团	2,631,140.19	0.07
14	002269	美邦服饰	2,047,373.12	0.06
15	002242	九阳股份	2,028,329.52	0.06
16	002267	陕天然气	1,952,435.94	0.06
17	002240	威华股份	1,816,788.30	0.05
18	002233	塔牌集团	1,246,698.91	0.04
19	002251	步步高	1,242,503.36	0.04
20	002257	立立电子	959,072.94	0.03

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	证券代码	证券名称	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	149,668,065.74	4.22
2	601088	中国神华	53,972,852.72	1.52
3	601898	中煤能源	41,490,718.02	1.17
4	601899	紫金矿业	37,150,936.04	1.05
5	601939	建设银行	35,849,161.61	1.01
6	600026	中海发展	35,680,013.45	1.01
7	601186	中国铁建	33,675,587.03	0.95
8	601390	中国中铁	29,136,958.86	0.82
9	601958	金钼股份	22,844,986.84	0.64
10	601601	中国太保	20,476,553.52	0.58
11	600236	桂冠电力	14,837,554.50	0.42
12	601808	中海油服	13,384,512.40	0.38
13	601866	中海集运	12,977,615.15	0.37
14	601766	中国南车	11,831,247.51	0.33
15	000402	金融街	5,391,360.00	0.15
16	601918	国投新集	5,274,405.58	0.15
17	600232	金鹰股份	5,157,090.60	0.15
18	600557	康缘药业	4,047,502.09	0.11
19	600795	国电电力	3,867,060.33	0.11
20	002242	九阳股份	3,643,065.64	0.10

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

买入股票的成本（成交）总额	444,376,791.92
卖出股票的收入（成交）总额	612,293,190.36

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	265,586,991.20	9.64
2	央行票据	587,305,000.00	21.33
3	金融债券	684,648,000.00	24.86
	其中：政策性金融债	664,192,000.00	24.12
4	企业债券	995,610,639.75	36.15
5	企业短期融资券	40,632,000.00	1.48
6	可转债	211,699,110.76	7.69
7	其他	—	—

8	合计	2,785,481,741.71	101.15
---	----	------------------	--------

### 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	0801044	08 央行票据 44	3,000,000	320,550,000.00	11.64
2	080220	08 国开 20	1,400,000	143,066,000.00	5.20
3	0801038	08 央行票据 38	1,000,000	106,770,000.00	3.88
4	0801032	08 央行票据 32	1,000,000	106,640,000.00	3.87
5	040216	04 国开 16	1,000,000	102,440,000.00	3.72

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	占基金资产净值比例（%）
1	0838013	08 信银 A2	300,000	30,093,000.00	1.09
2	0830011	08 开元 1A1	300,000	30,021,000.00	1.09
3	119008	宁建 03	100,000	9,854,465.75	0.36
4	0830012	08 开元 1A2	200,000	9,578,000.00	0.35

### 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：本基金截至 2008 年 12 月 31 日未持有权证。

### 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 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	598,780.49
2	应收证券清算款	1,252,308.69
3	应收股利	—
4	应收利息	45,045,705.03
5	应收申购款	18,022,837.51

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	64,919,631.72

8.9.4 报告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	市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	110002	南山转债	91,141,511.20	3.31
2	125528	柳工转债	19,749,597.40	0.72
3	110078	澄星转债	6,765,777.90	0.25
4	128031	巨轮转债	6,675,134.40	0.24
5	110368	五洲转债	4,852,516.20	0.18
6	110971	恒源转债	4,667,743.80	0.17
7	110567	山鹰转债	767,741.90	0.03
8	125960	锡业转债	206,606.96	0.01

注：—

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	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002257	立立电子	959,072.94	0.03	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(%)
34,851	62,553.62	1,291,970,091.99	59.26	888,086,178.84	40.74

9.2 期末基金管理公司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	3,498,329.96	0.1605%
----------------------	--------------	---------

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年12月2日）基金份额总额	2,294,660,372.47
报告期期初基金份额总额	2,824,385,070.32
报告期期间基金总申购份额	2,883,447,923.52
报告期期间基金总赎回份额	-3,527,776,723.01
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	2,180,056,270.83

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §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2008年12月11日公告聘任窦玉明先生担任公司总经理；2008年11月21日公告聘任林志松先生、陈戈先生担任公司副总经理、聘任李长伟先生担任公司督察长，李长伟先生不再担任公司副总经理、林志松先生不再担任公司督察长。2008年8月28日公告李建国先生不再担任总经理职务、陈继武先生不再担任副总经理职务；2008年10月10日公告谢卫先生不再担任副总经理职务。

以上事项均于上述日期在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上披露。

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本基金审计的会计师事务所。原审计机构安永大华会计师事务所，更名为安永华明会计师事务所。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6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 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	回购交易		股票交易		债券交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期回购交易总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票交易总额的比例 (%)	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 (%)	
海通证券	2	11,506,900,000.00	34.30	318,986,577.41	52.10	1,427,126,489.61	48.27	34,335,727.94	62.64	389,655.17	51.37	—
申银万国	2	22,036,800,000.00	65.70	293,306,612.95	47.90	1,529,369,704.22	51.73	20,480,544.45	37.36	368,922.54	48.63	—

注：我对基金交易单元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。本基金本期租用的券商交易单元未发生变更。

富国基金管理有限公司  
二〇〇九年三月三十一日