

富国优化增强债券型证券投资基金

二〇一〇年年度报告

(摘要)

2010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：2011年03月31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 2011 年 3 月 29 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 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国优化增强债券	
基金主代码	100035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年06月10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	1,211,151,442.82份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	富国优化增强债券 A/B级	富国优化增强债券 C级
下属两级基金的交易代码	100035	100037
报告期末下属两级基金的份额总额	644,087,732.40份	567,063,710.42份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
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，在债券投资过程中突出主动性的投资管理。 本基金通过对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势的客观判断，合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等，加以对国家债券等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
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较低风险品种，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.zh@ccb.com
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 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

#### (1) 富国优增 A/B 级

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年 6 月 10 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	43,763,291.68	-16,150,488.62
本期利润	56,244,641.75	-14,848,205.06
加权平均基金份额本期利润	0.1330	-0.0146
本期基金份额净值增长率	14.65%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年 12 月 31 日	2009 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.0288	-0.0110
期末基金资产净值	696,976,561.78	537,449,896.35
期末基金份额净值	1.082	1.002

#### (2) 富国优增 C 级

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年 6 月 10 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	56,109,312.60	-26,635,349.39
本期利润	72,457,940.09	-2,925,108.33
加权平均基金份额本期利润	0.1244	-0.0013

本期基金份额净值增长率	14.07%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2010年12月31日	2009年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0212	-0.0135
期末基金资产净值	609,141,325.63	1,192,657,811.28
期末基金份额净值	1.074	1.000

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

#### (1) 富国优增 A/B 级

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	5.82%	0.56%	-0.77%	0.21%	6.59%	0.35%
过去六个月	11.97%	0.44%	1.44%	0.18%	10.53%	0.26%
过去一年	14.65%	0.39%	0.77%	0.17%	13.88%	0.22%
自基金合同生效日起至今	14.88%	0.36%	2.98%	0.18%	11.90%	0.18%

#### (2) 富国优增 C 级

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	5.66%	0.56%	-0.77%	0.21%	6.43%	0.35%
过去六个月	11.73%	0.44%	1.44%	0.18%	10.29%	0.26%
过去一年	14.07%	0.39%	0.77%	0.17%	13.30%	0.22%
自基金合同生效日起至今	14.07%	0.36%	2.98%	0.18%	11.09%	0.18%

注：本基金合同生效日为 2009 年 6 月 10 日。

本基金根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=中债综合指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能

够反映 A 股市场总体发展趋势

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 90\% * [\text{中债综合指数}_t / (\text{中债综合指数}_{t-1}) - 1] + 10\% * [\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1]$$
；

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日；

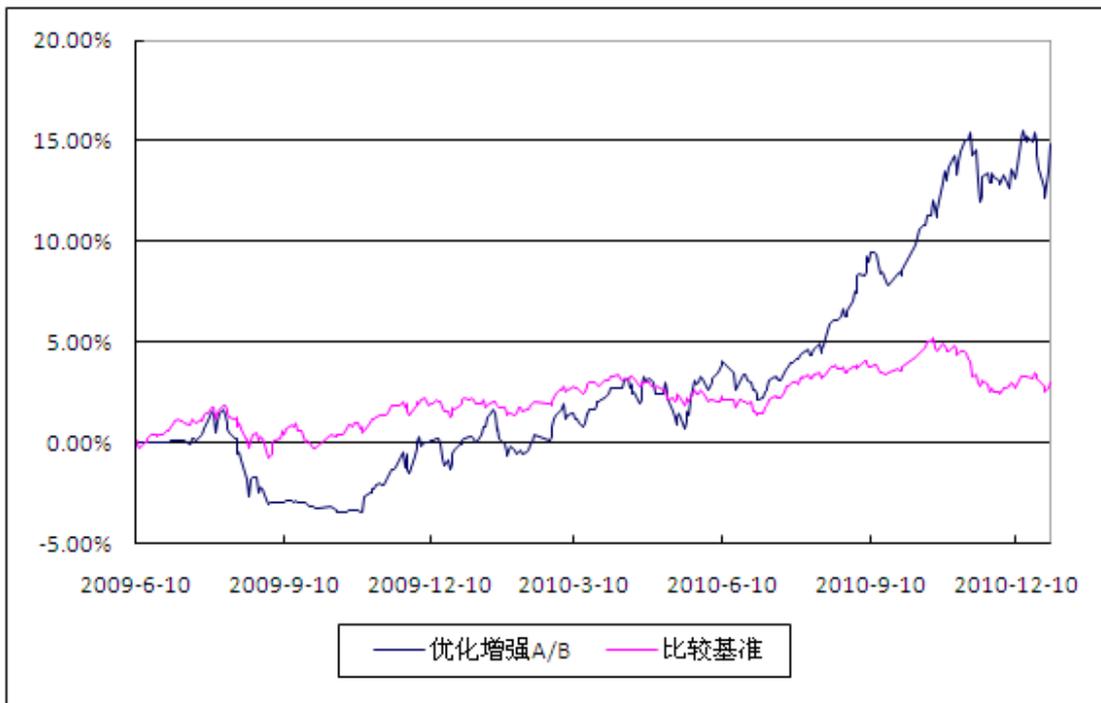
期间  $T$  日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

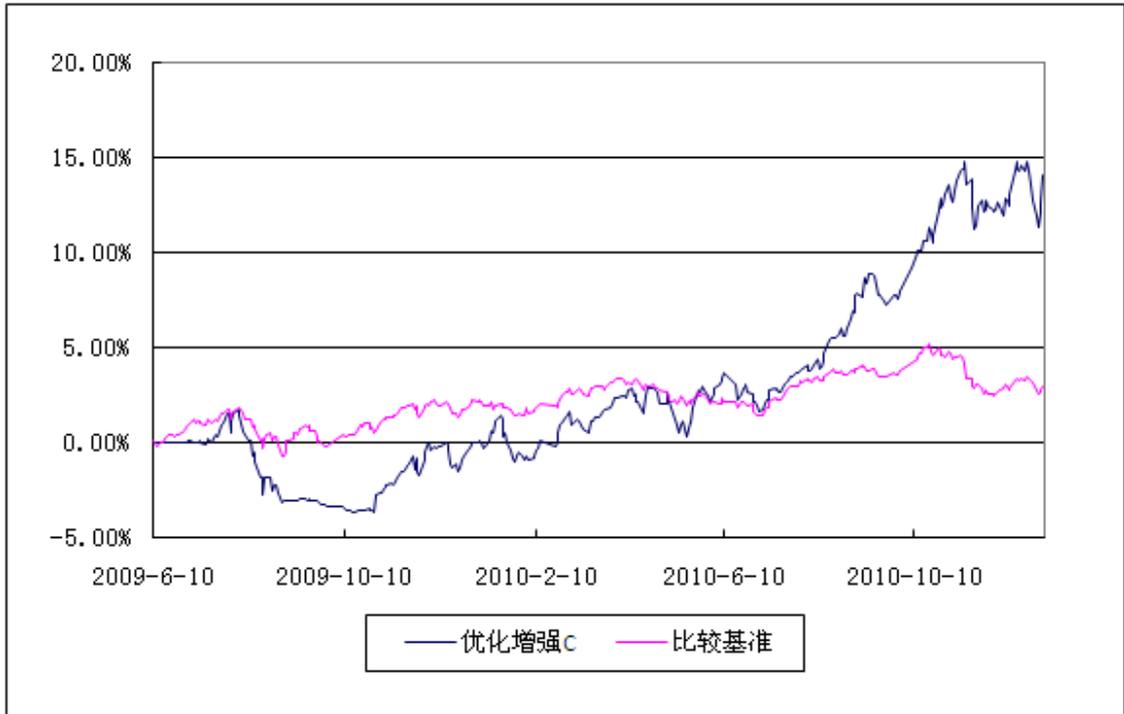
其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

### 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

(1) 自基金合同生效以来富国优化增强债券型 A/B 级基金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



(2) 自基金合同生效以来富国优化增强债券型 C 级基金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

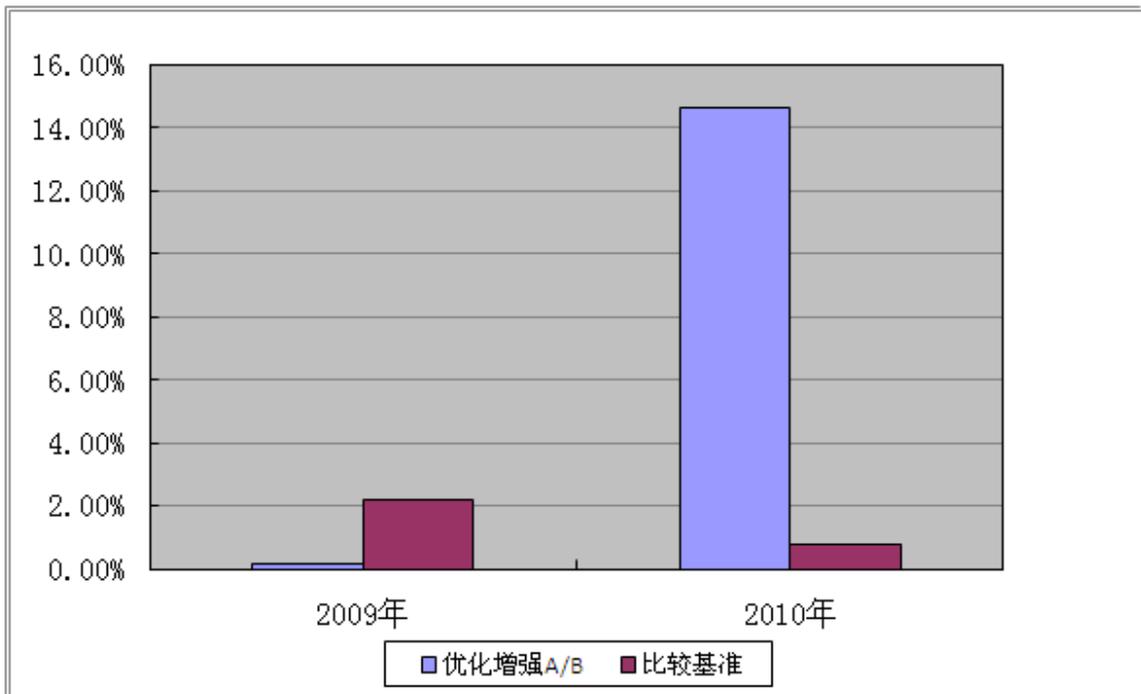


注：截止日期为 2010 年 12 月 31 日。

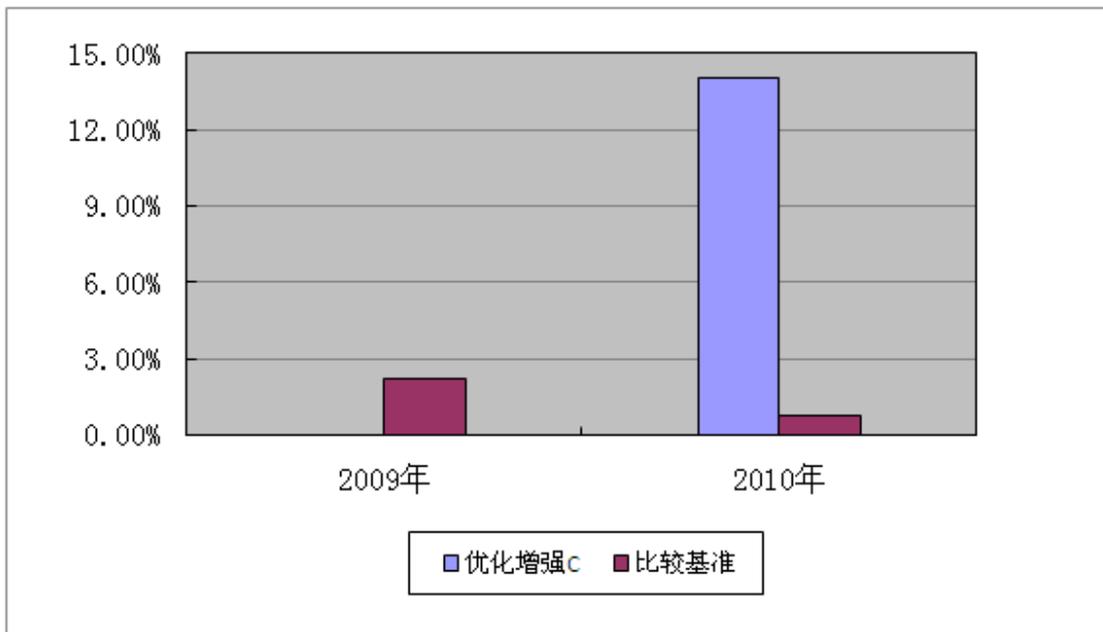
本基金于 2009 年 6 月 10 日成立，建仓期 6 个月，从 2009 年 6 月 10 日至 2009 年 12 月 9 日建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 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

(1) 自基金合同生效以来富国优增 A/B 级基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2) 自基金合同生效以来富国优增 C 级基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于2009年6月10日成立，2009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

#### (1) 富国优增 A/B 级

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
2010年	0.650	32,060,616.35	4,258,169.57	36,318,785.92	2次分红
2009年	—	—	—	—	—
2008年	—	—	—	—	—
合计	0.650	32,060,616.35	4,258,169.57	36,318,785.92	2次分红

#### (2) 富国优增 C 级

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
2010年	0.650	27,665,193.74	8,486,585.69	36,151,779.43	2次分红
2009年	—	—	—	—	—
2008年	—	—	—	—	—
合计	0.650	27,665,193.74	8,486,585.69	36,151,779.43	2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2010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、富国汇利分级债券型证券投资基金四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、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金和富国可转换债券证券投资基金十五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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
钟智伦	本基金基金经理兼任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理	2009-06-10	—	17年	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2009年3月任富国天时基金经理；2008年10月至今任富国天丰基金经理；2009年6月起兼任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优化增强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》、《富国优化增强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，本着诚实守信、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

2010年，国内经济增长呈现前高后低态势，通胀水平逐月走高。在此背景下，债券市场上利率产品全年整体上没有大的投资机会，信用债券由于有较高的信用利差保护，全年超额收益明显，可转债市场在下半年扩容后伴随股票市场的上涨出现较好的投资机会。股票市场指数表现不佳，但结构性行情贯穿全年，新股申购超额收益明显，

但 11 月新股实行新的发行方式后，新股申购出现较大的不确定性，风险加大。

本年度本基金债券投资主要配置高收益的信用债券，同时，为兼顾基金的流动性管理，配置部分短久期的利率产品，下半年增加了可转债的配置；对股票投资，积极挖掘市场的结构性投资机会，自下而上寻找投资标的，同时选择性参与新股网下申购。除债券投资收益为基金净值增长带来贡献外，股票投资也对基金投资收益起到较好的增强作用。

本年度向基金持有人派发现金红利 2 次，每 10 份基金单位累计派发现金红利 0.65 元。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金 A/B 级份额净值为 1.082 元，份额累计净值为 1.147 元；本基金 C 级份额净值为 1.074 元，份额累计净值为 1.139 元。报告期内，本基金 A/B 级份额净值增长率为 14.65%，同期业绩比较基准收益率为 0.77%；本基金 C 级份额净值增长率为 14.07%，同期业绩比较基准收益率为 0.77%。

#### 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 2011 年，国际及国内经济均存在较大的不确定性，从而给国内证券市场带来较大的不确定性。我们预计，利率产品上半年在通胀压力下难有好的表现，信用产品整体上看仍是较好的投资标的，但同等级别的个券信用风险将会出现较大的分化，需要仔细分析单个发行主体的信用风险，可转债在估值较高的情况下，安全边际不足；股票市场在估值修复的过程中存在结构性和阶段性投资机会，而新股申购的风险在发行方式改变后大大增加，需要谨慎对待。

本基金将保持对信用产品和利率产品的基础配置以获取相对稳定的债券投资收益，同时，维持一定比例的可转债配置，谨慎参与新股申购，积极自下而上挖掘股票投资机会，努力为基金持有人获取投资回报。

#### 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 2010 年报告期内利润共进行二次收益分配，分别于 2010 年 7 月 23 日公告：截至 2010 年 7 月 16 日，本基金 A/B 级期末可分配利润为 10,551,236.54 元，每 10 份基金份额派发红利 0.15 元，共计派发红利 4,839,741.62 元，占期末可供分配利润的 45.87%；本基金 C 级期末可分配利润为 10,778,865.15 元，每 10 份基金份额派发红利 0.15 元，共计派发红利 6,160,919.43 元，占期末可供分配利润的 57.16%；。

2010年12月21日公告：截至2010年12月17日，本基金A/B级期末可分配利润为39,544,098.52元，每10份基金份额派发红利0.50元，共计派发红利31,479,044.30元，占期末可供分配利润的79.60%；本基金C级期末可分配利润为40,350,445.90元，每10份基金份额派发红利0.50元，共计派发红利29,990,860.00元，占期末可供分配利润的74.33%。

根据本基金《基金合同》约定：“本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的25%，期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；”。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A/B级36,318,785.92元，C级36,151,779.43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：富国优化增强债券型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2010年12月31日)	上年度末 (2009年12月31日)
<b>资产：</b>		
银行存款	16,838,740.41	2,013,786.93
结算备付金	10,331,941.77	3,789,126.28
存出保证金	446,474.14	223,780.38
交易性金融资产	1,482,374,782.90	1,859,639,629.08
其中：股票投资	252,132,235.74	280,786,262.68
基金投资	—	—
债券投资	1,230,242,547.16	1,578,853,366.40
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	109,967,809.25	1,679,467.43
应收利息	15,346,817.76	27,078,682.99
应收股利	—	—
应收申购款	9,936,182.46	1,301,247.80
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,645,242,748.69	1,895,725,720.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2010年12月31日)</b>	<b>上年度末 (2009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	279,999,998.00	154,000,000.00
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	56,574,157.58	8,779,567.94
应付管理人报酬	748,290.71	1,143,456.11
应付托管费	213,797.32	326,701.72
应付销售服务费	218,844.69	448,899.52
应付交易费用	486,336.25	800,677.75
应交税费	739,104.00	26,204.00
应付利息	10,334.19	5,000.34
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	133,998.54	87,505.88
负债合计	339,124,861.28	165,618,013.26
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,211,151,442.82	1,728,879,447.36

未分配利润	94,966,444.59	1,228,260.27
所有者权益合计	1,306,117,887.41	1,730,107,707.63
负债和所有者权益总计	1,645,242,748.69	1,895,725,720.89

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，富国优增 A/B 类基金份额净值 1.082 元，富国优增 C 类基金份额净值 1.074 元；富国优增基金份额总额 1,211,151,442.82 份（其中 A/B 级基金份额总额 644,087,732.40 份，其中 C 级基金份额总额 567,063,710.42 份）。

本基金合同于 2009 年 6 月 10 日生效，上年度可比期间自 2009 年 6 月 10 日至 2009 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：富国优化增强债券型证券投资基金

本报告期：2010 年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2010 年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2009 年 6 月 10 日(基 金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	150,051,420.14	8,646,689.32
1. 利息收入	30,239,073.67	39,233,759.83
其中：存款利息收入	995,094.25	3,627,562.32
债券利息收入	29,243,979.42	32,028,563.58
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	3,577,633.93
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	90,693,661.55	-55,962,336.56
其中：股票投资收益	85,584,492.19	-45,741,748.12
基金投资收益	—	—
债券投资收益	4,384,041.26	-11,181,191.01
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	819,015.11
股利收益	725,128.10	141,587.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	28,829,977.56	25,012,524.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	288,707.36	362,741.43
<b>减：二、费用</b>	21,348,838.30	26,420,002.71
1. 管理人报酬	7,330,778.11	12,491,586.53
2. 托管费	2,094,507.96	3,569,024.64
3. 销售服务费	2,421,406.27	4,888,956.53

4. 交易费用	3,398,348.93	3,567,830.19
5. 利息支出	5,857,803.18	1,646,940.72
其中：卖出回购金融资产支出	5,857,803.18	1,646,940.72
6. 其他费用	245,993.85	255,664.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	128,702,581.84	-17,773,313.39
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	128,702,581.84	-17,773,313.39

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国优化增强债券型证券投资基金

本报告期：2010年01月01日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2010年01月01日至2010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）	1,728,879,447.36	1,228,260.27	1,730,107,707.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	128,702,581.84	128,702,581.84
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）	-517,728,004.54	37,506,167.83	-480,221,836.71
其中：1. 基金申购款	1,810,649,681.01	161,714,223.35	1,972,363,904.36
2. 基金赎回款	-2,328,377,685.55	-124,208,055.52	-2,452,585,741.07
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）	—	-72,470,565.35	-72,470,565.35
五、期末所有者权益（基金净值）	1,211,151,442.82	94,966,444.59	1,306,117,887.41
项目	上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)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）	5,820,523,023.61	—	5,820,523,023.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-17,773,313.39	-17,773,313.39
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）	-4,091,643,576.25	19,001,573.66	-4,072,642,002.59
其中：1. 基金申购款	333,219,297.02	-4,745,010.39	328,474,286.63
2. 基金赎回款	-4,424,862,873.27	23,746,584.05	-4,401,116,289.22
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）	1, 728, 879, 447. 36	1, 228, 260. 27	1, 730, 107, 707. 63
-----------------	----------------------	-----------------	----------------------

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：

窦玉明	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 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。

### 7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 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、注册登记机构、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

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。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年12月31日)		上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至 2009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	296,119,546.90	13.82	183,660,565.07	7.72
申银万国	17,006,771.51	0.79	18,595,712.99	0.78

###### 7.4.5.1.2 权证交易

注：本基金本年度未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.5.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年12月31日)		上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至 2009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	412,632,854.47	24.39	244,658,575.14	17.68
申银万国	—	—	7,873,673.97	0.57

#### 7.4.5.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年12月31日)		上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至2009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	166,500,000.00	1.42	—	—
申银万国	140,000,000.00	1.20	—	—

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010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	241,544.69	13.64	71,902.57	14.87
申银万国	14,455.81	0.82	0.00	0.00
关联方名称	上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)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	149,314.42	7.46	128,331.48	16.24
申银万国	15,805.74	0.79	11,158.40	1.41

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。

#### 7.4.5.2 关联方报酬

##### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年12月31日)	上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至2009年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	7,330,778.11	12,491,586.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,239,978.54	2,284,692.35

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.7\% / \text{当年天数}$

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。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年12月31日)	上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至2009年12月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	2,094,507.96	3,569,024.64

注：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：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.5.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年12月31日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	AB级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	2,421,406.27	2,421,406.27
合计	-	2,421,406.27	2,421,406.27

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至2009年12月31日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	AB级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	4,888,956.53	4,888,956.53
合计	-	4,888,956.53	4,888,956.53

注：本基金A类和B类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H为C类基金每日应支付的基金销售服务费

E为C类基金前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。

### 7.4.5.3 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（2010年01月01日至2010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
中国建设银行股份有限公司	—	9,952,134.11	—	—	1,385,000,000.00	554,355.68
上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)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
中国建设银行股份有限公司	—	—	—	—	1,078,000,000.00	214,615.17

### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人2010年度及2009年6月10日（基金合同生效日）至2009年12月31日止期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.5.4.2 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于2010年年末和2009年年末均未投资本基金。

### 7.4.5.5 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（2010年01月01日至2010年12月31日）		上年度可比期间 (2009年6月10日(基金合同生效日)至2009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
中国建设银行股份有限公司	16,838,740.41	889,760.17	2,013,786.93	3,521,155.46

### 7.4.5.6 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2010年度及2009年6月10日（基金合同生效日）至2009年12月31日止期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

### 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金2010年度及2009年度均无其他关联方交易事项。

## 7.4.6 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

#### 7.4.6.1.1 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
002496	辉丰股份	2010-10-29	2011-02-09	新股认购	48.69	55.80	90,645	4,413,505.05	5,057,991.00	—
002501	利源铝业	2010-11-05	2011-02-17	新股认购	35.00	52.80	77,695	2,719,325.00	4,102,296.00	—
002502	骅威股份	2010-11-05	2011-02-17	新股认购	29.00	30.30	98,474	2,855,746.00	2,983,762.20	—
300127	银河磁体	2010-09-27	2011-01-13	新股认购	18.00	27.90	66,951	1,205,118.00	1,867,932.90	—
300128	锦富新材	2010-09-27	2011-01-13	新股认购	35.00	47.19	77,567	2,714,845.00	3,660,386.73	—
300133	华策影视	2010-10-14	2011-01-26	新股认购	68.00	116.00	48,599	3,304,732.00	5,637,484.00	—
300139	福星晓程	2010-11-03	2011-02-14	新股认购	62.50	72.80	129,562	8,097,625.00	9,432,113.60	—
300141	和顺电气	2010-11-03	2011-02-14	新股认购	31.68	47.28	47,400	1,501,632.00	2,241,072.00	—
600998	九州通	2010-10-27	2011-02-09	新股认购	13.00	14.55	200,326	2,604,238.00	2,914,743.30	—
601098	中南传媒	2010-10-22	2011-01-28	新股认购	10.66	11.98	364,594	3,886,572.04	4,367,836.12	—
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股认购	23.00	31.11	59,361	1,365,303.00	1,846,720.71	—
601177	杭齿前进	2010-09-29	2011-01-11	新股认购	8.29	16.03	322,459	2,673,185.11	5,169,017.77	—
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	新股认购	23.98	31.24	79,145	1,897,897.10	2,472,489.80	—

#### 7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

#### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2010年12月31日止，本基金无银行间市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，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余额人民币279,999,998.00元，其中有19,999,998.00于2011年1月4日到期，有260,000,000于2011年1月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。

#### 7.4.7 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	252,132,235.74	15.32
	其中：股票	252,132,235.74	15.32
2	固定收益投资	1,230,242,547.16	74.78
	其中：债券	1,230,242,547.16	74.78
	资产支持证券	—	—
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	27,170,682.18	1.65
6	其他各项资产	135,697,283.61	8.25
7	合计	1,645,242,748.69	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	—	—
B	采掘业	—	—
C	制造业	92,480,364.87	7.08
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	2,983,762.20	0.23
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,586,991.00	0.81
C5	电子	51,629,921.23	3.95
C6	金属、非金属	4,102,296.00	0.31
C7	机械、设备、仪表	21,738,928.80	1.66
C8	医药、生物制品	1,438,465.64	0.11
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	52,566,450.54	4.02
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	42,590,200.00	3.26
H	批发和零售贸易	15,775,233.10	1.21
I	金融、保险业	6,825,000.00	0.52
J	房地产业	27,209,667.11	2.08
K	社会服务业	4,680,000.00	0.36
L	传播与文化产业	10,005,320.12	0.77

M	综合类	—	—
	合计	252,132,235.74	19.30

### 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	002161	远望谷	1,220,000	42,590,200.00	3.26
2	002375	亚厦股份	433,273	39,852,450.54	3.05
3	002371	七星电子	330,010	35,905,088.00	2.75
4	600223	鲁商置业	2,399,999	17,855,992.56	1.37
5	002482	广田股份	150,000	12,714,000.00	0.97
6	600859	王府井	200,000	10,388,000.00	0.80
7	300139	福星晓程	140,062	10,196,513.60	0.78
8	000718	苏宁环球	1,000,393	9,353,674.55	0.72
9	601998	中信银行	1,300,000	6,825,000.00	0.52
10	300133	华策影视	48,599	5,637,484.00	0.43

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	600050	中国联通	59,599,563.84	3.44
2	002161	远望谷	52,215,503.82	3.02
3	002375	亚厦股份	52,086,680.58	3.01
4	002371	七星电子	42,308,059.31	2.45
5	002153	石基信息	35,541,532.62	2.05
6	002310	东方园林	32,091,007.50	1.85
7	000581	威孚高科	27,489,508.69	1.59
8	600271	航天信息	25,761,192.51	1.49
9	601866	中海集运	22,569,367.91	1.30
10	600383	金地集团	22,020,398.33	1.27
11	000568	泸州老窖	21,636,753.99	1.25
12	600303	曙光股份	20,351,428.91	1.18
13	002376	新北洋	19,737,850.01	1.14
14	002482	广田股份	19,195,296.16	1.11
15	000598	兴蓉投资	19,019,330.10	1.10
16	600223	鲁商置业	18,820,408.51	1.09

17	000021	长城开发	18,564,915.53	1.07
18	002353	杰瑞股份	17,295,091.70	1.00
19	601106	中国一重	16,518,041.95	0.95
20	600208	新湖中宝	16,373,673.77	0.95

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	600050	中国联通	66,064,879.20	3.82
2	002310	东方园林	39,503,212.85	2.28
3	002153	石基信息	39,168,825.99	2.26
4	600271	航天信息	38,212,418.94	2.21
5	000581	威孚高科	27,236,008.31	1.57
6	002375	亚厦股份	26,140,051.37	1.51
7	600683	京投银泰	24,778,972.24	1.43
8	600208	新湖中宝	24,382,969.54	1.41
9	000568	泸州老窖	23,055,840.87	1.33
10	601866	中海集运	22,670,735.00	1.31
11	000989	九芝堂	21,843,984.38	1.26
12	000061	农产品	21,478,143.58	1.24
13	600383	金地集团	21,101,984.26	1.22
14	002161	远望谷	21,034,788.54	1.22
15	002376	新北洋	20,694,885.29	1.20
16	600631	百联股份	20,352,489.19	1.18
17	002353	杰瑞股份	20,339,996.37	1.18
18	000598	兴蓉投资	18,807,421.20	1.09
19	002371	七星电子	18,711,045.61	1.08
20	000021	长城开发	18,609,772.40	1.08

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	1,067,417,064.81
卖出股票收入（成交）总额	1,181,537,132.49

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	298,391,400.00	22.85
2	央行票据	39,152,000.00	3.00
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	573,091,109.10	43.88
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	319,608,038.06	24.47
7	其他	—	—
8	合计	1,230,242,547.16	94.19

## 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	113002	工行转债	1,020,000	120,502,800.00	9.23
2	010112	21 国债(2)	1,150,000	115,828,000.00	8.87
3	010203	02 国债(3)	1,100,040	110,004,000.00	8.42
4	113001	中行转债	800,000	87,888,000.00	6.73
5	126630	铜陵转债	400,000	80,620,000.00	6.17

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	446,474.14
2	应收证券清算款	109,967,809.25
3	应收股利	—
4	应收利息	15,346,817.76
5	应收申购款	9,936,182.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	135,697,283.61

### 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	113001	中行转债	87,888,000.00	6.73
2	110003	新钢转债	10,727,913.00	0.82
3	125731	美丰转债	7,580,325.06	0.58

### 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	300139	福星晓程	9,432,113.60	0.72	新股认购
2	300133	华策影视	5,637,484.00	0.43	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

份额级别	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

		额	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
富国优化增强债券 A/B 级	6504	99,029.48	373,150,734.64	57.93	270,936,997.76	42.07
富国优化增强债券 C 级	8274	68,535.62	114,410,510.98	20.18	452,653,199.44	79.82
合计	14778	81,956.38	487,561,245.62	40.26	723,590,197.20	59.74

## 9.2 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	份额级别	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	富国优化增强债券 A/B 级	298,366.74	0.0463
	富国优化增强债券 C 级	49,676.27	0.0088
	合计	348,043.01	0.0287

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国优化增强债券 A/B 级	富国优化增强债券 C 级
基金合同生效日(2009 年 06 月 10 日)基金份额总额	1,376,956,367.55	4,443,566,656.06
报告期期初(2009 年 6 月 10 日(基金合同生效日))基金份额总额	536,136,485.39	1,192,742,961.97
本报告期(2009 年 6 月 10 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日)基金总申购份额	904,670,242.20	905,979,438.81
减：本报告期(2009 年 6 月 10 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日)基金总赎回份额	796,718,995.19	1,531,658,690.36
本报告期(2009 年 6 月 10 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日)基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	644,087,732.40	567,063,710.42

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**

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

## **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的报酬为 8 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 8 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和基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	59,918,290.50	2.80	33,636,708.21	1.99	539,700,000.00	4.61	—	—	50,930.72	2.88	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	1	230,550,506.72	10.76	601,154,549.54	35.54	4,572,200,000.00	39.03	—	—	195,966.93	11.06	—
德邦证券	1	87,859,459.86	4.10	201,764,150.20	11.93	1,433,100,000.00	12.23	—	—	74,679.68	4.22	—
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	327,645,964.27	15.29	44,999,701.55	2.66	95,000,000.00	0.81	—	—	266,368.34	15.04	—
国信证券	1	613,076,341.06	28.61	53,726,511.39	3.18	20,000,000.00	0.17	—	—	498,129.14	28.13	—
海通证券	2	296,119,546.90	13.82	412,632,854.47	24.39	166,500,000.00	1.42	—	—	241,544.69	13.64	—
上海证券	1	245,795,199.42	11.47	315,761,193.00	18.67	4,237,100,000.00	36.17	—	—	208,926.22	11.80	—
申银万国	1	17,006,771.51	0.79	—	—	140,000,000.00	1.20	—	—	14,455.81	0.82	—
湘财证券	1	—	—	—	—	83,700,000.00	0.71	—	—	—	—	—
兴业证券	1	20,643,295.48	0.96	14,600,371.30	0.86	159,000,000.00	1.36	—	—	17,547.50	0.99	—
中投证券	1	92,467,615.87	4.32	4,102,781.80	0.24	269,000,000.00	2.30	—	—	78,595.01	4.44	—
中信建投	1	11,023,408.10	0.51	—	—	—	—	—	—	9,369.43	0.53	—

中信证券	1	7,293,275.92	0.34	2,100,000.00	0.12	—	—	—	—	6,199.45	0.35	—
中银国际	1	133,427,003.75	6.23	7,067,511.28	0.42	—	—	—	—	108,410.30	6.12	—

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。本期内本基金租用券商交易单元的未有变更

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告，每10股派发现金股息人民币2.02元(含税)。

2010年9月15日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。