

富国全球债券证券投资基金

二〇一一年半年度报告

(摘要)

2011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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2011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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 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 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国全球债券 (QDII - FOF)
基金主代码	100050
交易代码	前端交易代码: 100050 后端交易代码: -
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月20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
报告期末基金份额总额	260,215,393.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球债券市场,通过运用基金中基金(FOF: fund of funds)这种国际流行的投资管理模式,力争实现资产运作细分化、组合配置最优化、风险管理精细化、风险调整后收益最大化,从而谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用战略资产配置与战术资产配置相结合的策略,通过“自上而下”的方式进行资产配置,在有效分散风险(即:分散投资于单一国家或区域债券基金、单一债券类型基金以及单一基金公司及管理人的投资风险)的同时,力争实现基金资产风险调整后收益最大化。在本基金资产组合的构建过程中,根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征,基金资产被区分为核心资产和卫星资产。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:Barclay Global Aggregate Index。
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李长伟
	联系电话	021-68597788
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	95588
传真	021-68597799	010—66105798

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	BMO Asset Management Inc.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	蒙特利尔银行资产管理公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		77 King Street West Suite 4200 Toronto, ON M5K 1J5 Canada	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		77 King Street West Suite 4200 Toronto, ON M5K 1J5 Canada	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		M5K 1J5	10005

## 2.5 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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2011年01月01日至2011年06月30日)
本期已实现收益	2,725,206.73
本期利润	2,981,666.55
加权平均基金份额本期利润	0.0083

本期基金份额净值增长率	0.70%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2011年06月30日)</b>
期末可供分配基金份额利润	0.0066
期末基金资产净值	261,944,564.03
期末基金份额净值	1.007

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。

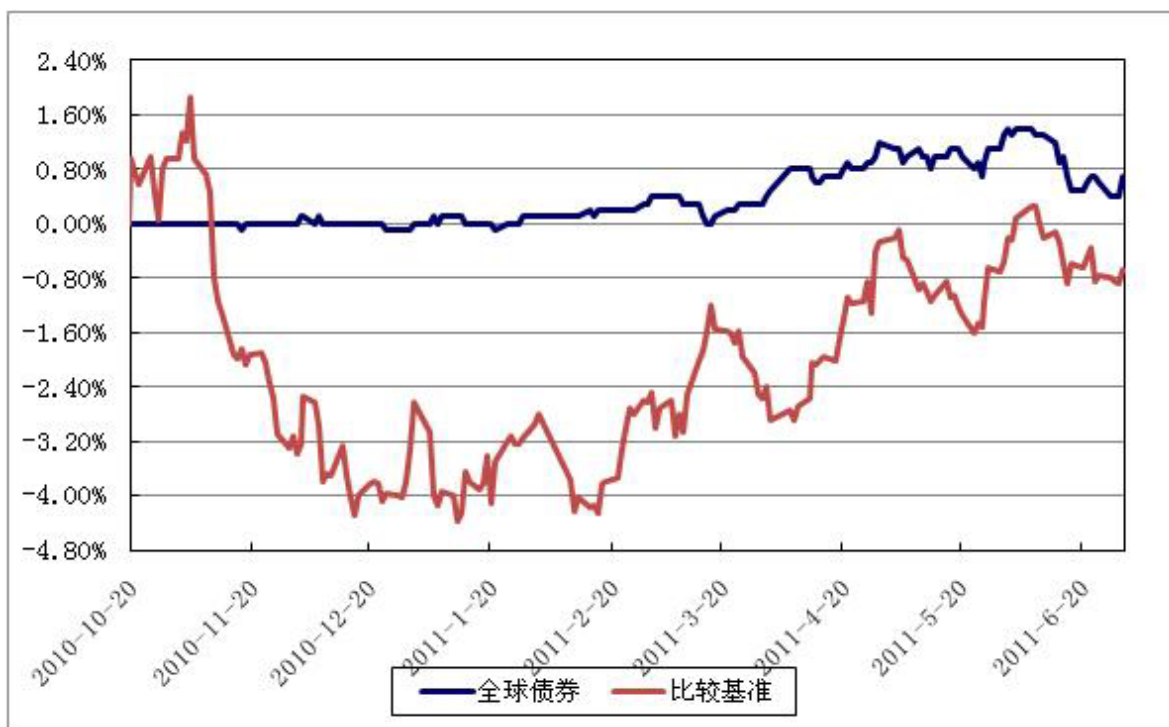
## 3.2 基金净值表现

### 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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-0.59%	0.14%	-0.12%	0.23%	-0.47%	-0.09%
过去三个月	0.30%	0.13%	1.76%	0.27%	-1.46%	-0.14%
过去六个月	0.70%	0.10%	2.00%	0.31%	-1.30%	-0.21%
自合同生效日至报告期末	0.70%	0.09%	-0.69%	0.35%	1.39%	-0.26%

注：本基金合同于2010年10月20日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

### 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 2011 年 6 月 30 日。

本基金合同生效日为 2010 年 10 月 20 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 2010 年 10 月 20 日起至 2011 年 4 月 19 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 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、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、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、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、富国汇利分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资

基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈分级债券型证券投资基金二十二只证券投资基金。

#### 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		
张峰	本基金基金经理	2011-04-12	-	10年	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券股票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，自2011年4月起任富国全球债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国香港。
林如惠	本基金前任基金经理	2010-10-20	2011-05-19	13年	硕士，曾任保诚证券投资信托股份有限公司(中国台湾)研究员、基金经理、助理(海外组主管)；2007年至2009年任富国基金管理有限公司境外投资部副总经理；2010年10月起任富国全球债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国台湾。

注：1、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。

2、本公司于2011年4月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，聘任张峰先生担任本基金基金经理。

3、本公司于2011年5月19日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，免去林如惠女士本基金基金经理职务。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Michael Stanley	投资长，总裁，执行长	17	执行长，同时也担任投资长，并负责管理加拿大股票组合，1994年加入蒙特利尔银行，然后在1996年2月加入蒙特利尔资产管理公司至今。1979年获得多伦多大学管理硕士，同时是注册金融分析师
Mark McMahon	资深副总裁及固定收益主管	22	在加拿大固定收益市场有超过22年经验，从2004年末开始成为蒙特利尔资产管理公司固定收益的领导投资

		<p>经理至今，在此前，曾负责管理蒙特利尔资产管理公司客户的债券组合，1999 年到加入蒙特利尔银行前，在一家主要券商负责管理零售交易并且是私人客户部门的固定收益投资策略师，1987 年毕业于西蒙菲沙大学，主修经济与金融，同时也是注册金融分析师</p>
--	--	--

### 4.3 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全球债券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》、《富国全球债券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，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，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。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

自年初开始，本基金逐步建仓，4月19日（基金合同规定的建仓截止日）达到债券类仓位不少于组合资产80%的监管要求。在3月份以前，全球经济复苏——尤其是美国——的势头持续，收益率较高的债券类产品表现更好。同时新兴国家由于通胀抬头，大多处于缓慢加息的周期中，造成了很多新兴国家的货币升值，资本大量流入这些国家的债券产品。在这种形势下，本基金建仓时在参考基准的同时，特意增加了收益较高债券和新兴国家——特别是亚洲——的配置，取得了良好的效果。3月份的日本大地震对全球的供应链造成了重大冲击，同时利比亚战争导致原油价格大涨，给全球的经济增长蒙上阴影，这两个因素影响了全球经济在二季度的表现，全球主要经济



体二季度的经济放缓很大程度上受这两个因素的影响。基于对全球经济放缓和对风险资产回调的判断，我们在5月初降低了组合中风险资产的比例，增加了避险资产的比例，取得了很好的效果。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日，本基金份额净值为1.007元，份额累计净值为1.007元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.7%，同期业绩比较基准收益率为2%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场面临的主要风险是欧洲债务危机的持续发酵和蔓延，欧洲各国政府如果不能尽快出台大胆、果断的措施制止危机从希腊、葡萄牙、爱尔兰蔓延到西班牙和意大利，那么世界资本市场将受到剧烈冲击。目前已经是非常关键的时期，欧洲央行和各国政府可以等待观望的时间所剩不多，资本市场正一步步逼迫他们做出艰难、痛苦但绝对有必要的决定。如果本次危机可以得到阶段性的缓解，那么下半年风险类资产会有相对较好的表现；相反，如果危机持续蔓延，持有避险类资产将会是明智选择。目前本基金持有一定比例的避险类资产，如果欧洲危机得到缓解，计划将此部分资产更换为收益率更高的债券类产品，如果危机得不到控制，这部分避险资产将对组合提供一定程度的保护。

除此之外，美国经济下半年或可改变二季度增长乏力的局面，预计美联储将维持零利率政策。同时由于原油价格高位回落、世界经济增速放缓和大多数国家的加息，通货膨胀继续上升的动力明显减弱，很多央行已进入政策观察期，不会轻易做出进一步加息的决定，消除了加息对债券产品的压力。因此，我们谨慎看好债券类产品下半年的表现。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

## § 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

2011年上半年,本基金托管人在对富国全球债券证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

2011年上半年,富国全球债券证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国全球债券证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,富国全球债券证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国全球债券证券投资基金 2011 年半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

2011年8月25日

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

报告截止日：2011年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 (2011年06月30日)	上年度末 (2010年12月31日)
资产：		
银行存款	21,499,251.88	366,016,395.70
结算备付金	123,809.52	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	216,900,646.65	94,152,506.10
其中：股票投资	-	-
基金投资	216,900,646.65	94,152,506.10
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	24,000,276.00	-
应收证券清算款	12,190,492.22	45,015,412.50

应收利息	43,935.67	85,912.38
应收股利	278,565.62	-
应收申购款	12,609.93	51,967.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	275,049,587.49	505,322,194.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2011年06月30日)</b>	<b>(2010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	55,265.38	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,654,761.02	29,802,150.00
应付赎回款	8,863,139.93	9,273,128.94
应付管理人报酬	207,489.10	396,812.64
应付托管费	50,719.58	96,998.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	276.00	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	273,372.45	140,926.41
负债合计	13,105,023.46	39,710,016.63
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	260,215,393.72	465,763,340.64
未分配利润	1,729,170.31	-151,163.04
所有者权益合计	261,944,564.03	465,612,177.60
负债和所有者权益总计	275,049,587.49	505,322,194.23

注：本基金合同生效日为2010年10月20日。报告截止日2011年06月30日，基金份额净值1.007元，基金份额总额260,215,393.72份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

本报告期：2011年01月01日至2011年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 (2011年01月01日至 2011年06月30日)	上年度可比期间 (2010年01月01日至 2010年06月30日)
一、收入	5,436,430.16	-

1.利息收入	1,450,554.98	-
其中：存款利息收入	325,396.07	-
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,125,158.91	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,504,244.60	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	2,292,919.68	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	1,211,324.92	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	256,459.82	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	111,722.06	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	113,448.70	-
<b>减：二、费用</b>	2,454,763.61	-
1.管理人报酬	1,636,228.94	-
2.托管费	399,967.13	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	208,543.36	-
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	210,024.18	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	2,981,666.55	-
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	2,981,666.55	-

注：本基金合同生效日为2010年10月20日，本基金合同生效不满一年，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

本报告期：2011年01月01日至2011年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2011年01月01日至2011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）	465,763,340.64	-151,163.04	465,612,177.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	-	2,981,666.55	2,981,666.55

(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)	-205,547,946.92	-1,101,333.20	-206,649,280.12
其中:1.基金申购款	2,804,990.11	15,576.80	2,820,566.91
2.基金赎回款	-208,352,937.03	-1,116,910.00	-209,469,847.03
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)	260,215,393.72	1,729,170.31	261,944,564.03
项目	上年度可比期间 (2010年01月01日至2010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	-	-	-
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:本基金合同生效日为2010年10月20日,本基金合同生效不满一年,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署;

窦玉明

林志松

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.2 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。

### 6.4.3 税项

#### 1. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的1‰调整为3‰；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

#### 2. 营业税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

#### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

### 6.4.4 关联方关系

#### 6.4.4.1 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

本期内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。

#### 6.4.4.2 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、注册登记机构、基金销售机构

中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外托管行

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。

#### 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.5.1.1 股票交易

注：本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.5.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.5.1.3 债券交易

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.5.1.4 回购交易

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.5.2 关联方报酬

###### 6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2011年01月01日至2011年06月30日）	上年度可比期间（2010年01月01日至2010年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,636,228.94	-
其中：支付销售机构的客户维护费	735,397.98	-

注：本基金合同生效日为2010年10月20日，本基金合同生效不满一年，无上年度可比期间数据。

本基金的管理费按前一日基金资产净值0.90%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% / \text{当年天数}$$

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

基金的管理费每日计算，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个工作日内从基金财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。

###### 6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2011年01月01日至2011年06月30日）	上年度可比期间（2010年01月01日至2010年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	399,967.13	-

注：本基金合同生效日为2010年10月20日，本基金合同生效不满一年，无上年度可比期间数据。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 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本报告期间未投资本基金。

##### 6.4.5.4.2 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本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.5.5 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（2011年01月01日至2011年06月30日）		上年度可比期间（2010年01月01日至2010年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,034,692.86	305,767.95	-	-
布朗兄弟哈里曼银行	13,464,559.02	6,907.63	-	-

注：本基金合同生效日为 2010 年 10 月 20 日，本基金合同生效不满一年，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.6 期末（2011年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

###### 6.4.6.1.1 受限证券类别：股票

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 日未持有流通受限的证券。

##### 6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 日未持有暂时停牌的证券。



### 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 日未持有正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金截至 2011 年 6 月 30 日无正回购交易余额。

### 6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期无需要说明的其他事项。

## §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：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	216,900,646.65	78.86
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	24,000,276.00	8.73
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,623,061.40	7.86
8	其他各项资产	12,525,603.44	4.55
9	合计	275,049,587.49	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

##### 7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

#### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

##### 8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未买入权益投资。

##### 8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未卖出权益投资。

##### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期无权益投资。

#### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	远期投资	汇率远期(美元兑人民币三个月)	-26,100.00	-0.01
2	远期投资	汇率远期(美元兑人民币三个月)	-29,165.38	-0.01

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ISHARES BARCLAYS 20+ YEAR TR	开放式	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	36,416,858.09	13.90
2	PIMCO-GLOBAL BOND-US UH IAC	开放式	契约型开放式	Pimco Global Advisors Ltd	27,022,438.90	10.32
3	FIDELITY-ASIAN HI YLD-A\$	开放式	契约型开放式	FIL Fund Management Ltd	25,776,616.04	9.84
4	SKANDIA-EMERGING MKT DEBT-A	开放式	契约型开放式	Stone Harbor Investment Partners L	22,440,474.27	8.57
5	FRANKTEMP INV GLBD-A MDIS\$	开放式	契约型开放式	Franklin Advisers Inc	20,631,764.90	7.88
6	SKANDIA-US TOTAL RTN BOND-A	开放式	契约型开放式	Pacific Investment Management Co LLC	18,823,208.07	7.19
7	MORGAN STANLEY EMERGING MARK	开放式	ETF 基金	Morgan Stanley Investment Mgmt Inc	14,519,125.20	5.54
8	FULLERTON ASIAN	开放式	契约型开放式	Fullerton Fund Management	13,566,928.47	5.18

	BOND-A			nt Co Ltd		
9	FRANK TEMP INV TE ASIA B-AA\$	开放式	契约型开 放式	Franklin Advisers Inc	12,550,494.25	4.79
10	SPDR DB INTL GOV INFL-P ROT	开放式	ETF 基金	SSGA Funds Manageme nt Inc	6,812,265.02	2.60

## 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 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。

本基金投资的前十名基金中，没有投资于超出基金合同规定备选基金库之外的基金。

### 7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	12,190,492.22
3	应收股利	278,565.62
4	应收利息	43,935.67
5	应收申购款	12,609.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,525,603.44

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 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(%)
4913	52,964.66	994,615.79	0.38	259,220,777.93	99.62

### 8.2 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	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	0.00	0.0000

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年10月20日)基金份额总额	828,405,192.16
报告期期初基金份额总额	465,763,340.64
本报告期基金总申购份额	2,804,990.11
减：本报告期基金总赎回份额	208,352,937.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	260,215,393.72

注：本基金合同于2010年10月20日生效。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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、本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变

动。

### **10.3 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。

### **10.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **10.5 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。

### **10.6 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未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 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		基金交易		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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10,595,132.69	2.78	14,394.10	7.77	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-	147,611,664.18	38.68	26,550.21	14.33	-
State Street Bank & Trust Company	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97,732,462.09	25.61	18,569.25	10.03	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-	125,701,296.90	32.94	125,701.44	67.87	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	18,000,000.00	0.95	-	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	55,000,000.00	2.91	-	-	-	-	-	-	-

湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	455,000,000.00	24.11	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	506,000,000.00	26.82	-	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	340,000,000.00	18.02	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	8,000,000.00	0.42	-	-	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	505,000,000.00	26.76	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

- 注：1. 我公司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。  
2. 基金债券回购交易与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）共用上交所交易单元。  
3. 本基金本期新增东兴证券 23087 席位、红塔证券 25547 席位、华创证券 25295 席位。



