

富国天时货币市场基金  
二〇一〇年半年度报告  
(摘要)

2010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： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2010年08月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 20 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 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国天时货币	
基金主代码	100025	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年06月05日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,452,249,874.66份	
下属两级基金的基金简称	富国天时货币 A	富国天时货币 B
下属两级基金的交易代码	100025	100028
报告期末下属两级基金的份额总额	301,481,161.68份	1,150,768,712.98份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在充分重视本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团（BMO Financial Group）的投资管理经验及技能，结合国内市场的特征，应用“富国 FIPS—MMF 系统（Fixed Income Portfolio System—Money Market Fund）”，构建优质组合。 在投资管理过程中，本基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金属于风险较低、收益稳定、流动性较高的证券投资基金品种，但并不意味着投资本基金不承担任何风险。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李长伟	李芳菲
	联系电话	021-68597788	010—66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-68597799	010—63201816

## 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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

## § 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

#### (1) 富国天时 A 级

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年01月01日至2010年06月30日)
本期已实现收益	3,134,438.44
本期利润	3,134,438.44
本期净值收益率	0.7625%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年06月30日)
期末基金资产净值	301,481,161.68
期末基金份额净值	1.0000

#### (2) 富国天时 B 级

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年01月01日至2010年06月30日)
本期已实现收益	17,154,419.34
本期利润	17,154,419.34
本期净值收益率	0.8821%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年06月30日)
期末基金资产净值	1,150,768,712.98
期末基金份额净值	1.0000

注：本基金收益分配是按月结转份额。所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，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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国天时 A 级

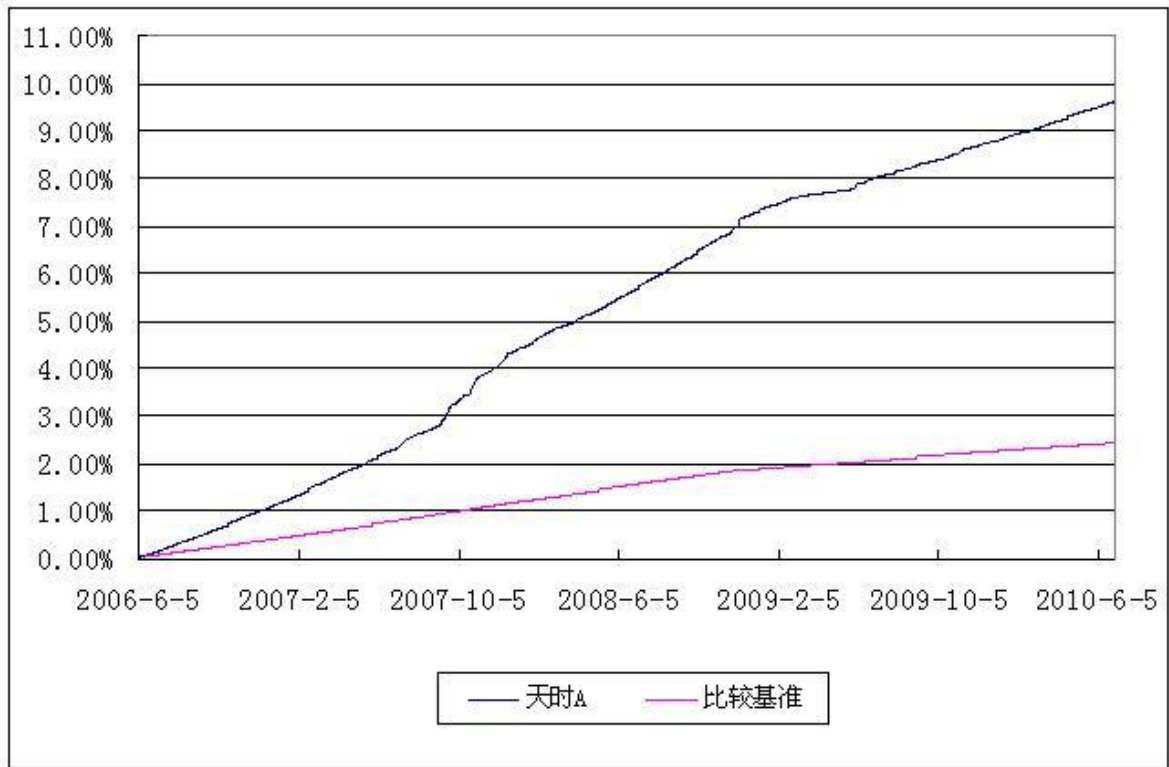
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1314%	0.0012%	0.0300%	0.0000%	0.1014%	0.0012%
过去三个月	0.3806%	0.0017%	0.0910%	0.0000%	0.2896%	0.0017%
过去六个月	0.7625%	0.0020%	0.1800%	0.0000%	0.5825%	0.0020%
过去一年	1.4781%	0.0030%	0.3640%	0.0000%	1.1141%	0.0030%
过去三年	7.1406%	0.0069%	1.6482%	0.0005%	5.4924%	0.0064%
自基金合同生 效起至今	9.6094%	0.0060%	2.4302%	0.0005%	7.1792%	0.0055%

## (2) 富国天时 B 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
过去一个月	0.1512%	0.0012%	0.0300%	0.0000%	0.1212%	0.0012%
过去三个月	0.4409%	0.0017%	0.0910%	0.0000%	0.3499%	0.0017%
过去六个月	0.8821%	0.0020%	0.1810%	0.0000%	0.7011%	0.0020%
过去一年	1.7220%	0.0030%	0.3650%	0.0000%	1.3570%	0.0030%
过去三年	7.9111%	0.0069%	1.6492%	0.0005%	6.2619%	0.0064%
自基金分级起 至今	9.5133%	0.0064%	2.0772%	0.0005%	7.4361%	0.0059%

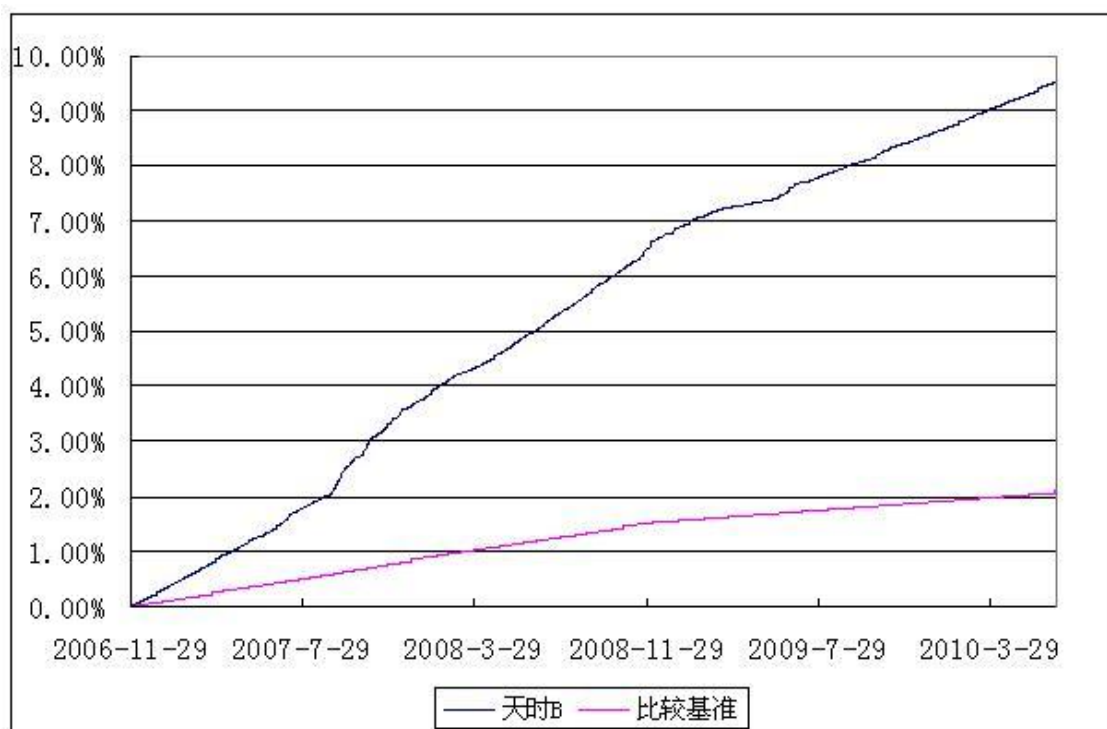
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1) 自基金合同生效以来富国天时货币市场 A 级基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注：截止日期为 2010 年 06 月 30 日。本基金于 2006 年 6 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2006 年 6 月 5 日至 2006 年 12 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金分级以来富国天时货币市场 B 级基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：起始日期为 2006 年 11 月 29 日，截止日期为 2010 年 06 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 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 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、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金和富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金十三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		
刁羽	本基金基金经理	2010-06-23	—	4年	博士，曾任国泰君安证券股份有限公司固定收益部研究员、交易员，浦银安盛基金管理有限公司基金经理助理，2009年6月任富国基金管理有限公司富国天时货币市场基金基金经理助理，2010年6月至今任富国天时货币市场基金基金经理。
杨贵宾	本基金前任基金经理	2009-03-03	2010-06-22	6年	博士，2005年9月任富国基金管理有限公司债券研究员、策略分析师；2009年3月至2010年6月任富国天时基金经理；2009年9月至今任富国天利基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

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2010年6月23日在上海证券报及公司网站上做公告，聘任刁羽先生担任本基金基金经理，免去杨贵宾先生本基金基金经理职务。

#### 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时货币市场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》、《富国天时货币市场基金基金合同》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。

#### 4.3 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 年之初宏观经济继续呈现回升走势，物价指数也出现恢复性上涨，银行间短期利率水平不断抬升。尽管 4 月份开始宏观经济在紧缩政策影响下出现冲高回落走势，但受到货币当局持续性紧缩政策以及外汇占款缩减等的累积影响，货币市场利率出现大幅度上行，随后在央行持续投放流动性下，流动性重回宽松局面，但短期利率较年初底部已抬升。

上半年货币市场的剧烈波动加大了基金的操作难度，但本基金管理人仍然坚持严格按照基金合同进行投资管理，兼顾基金资产的安全性、流动性和收益性。上半年本基金投资的主要策略是坚持对短期融资券的价值判断，充分获取骑乘和票息收益，同时积极把握市场波动的波段机会。在积极把握短期融资券获得较高收益的同时，也适时配置一部分央行票据增强组合的流动性。流动性管理方面还进行了回购的滚动操作，并积极把握交易所和银行间的回购利差进行套利交易。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为 0.7625%，同期业绩比较基准收益率为 0.1800%；B 级份额净值增长率为 0.8821%，同期业绩比较基准收益率为 0.1810%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济在经济结构调整和适度宽松货币政策下总体将平稳运行，经济发展速度可能会有所降低，通胀总体在可控范围内，加息预期开始减弱。货币市场利率走势将在新的均衡水平上总体保持平稳或窄幅波动。在由回购利率、3 个月央票和 Shibor 利率以及 1 年期央票利率构成的利率体系下，短期利率的波动将主要视央行的公开操作节奏、准备金和利率政策的影响而定。而国际资本流动形势和季节性因素等将带来短期波动，流动性仍可能会出现短期性紧张局面。

#### 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**

本基金本报告期已按本基金《基金合同》的约定：“1、基金收益分配方式为红利再投资，每日进行收益分配；2、‘每日分配、按月支付’”，的条款进行收益分配。

### **§ 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**

在托管富国天时货币市场基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国天时货币市场基金合同》、《富国天时货币市场基金托管协议》的约定，对富国天时货币市场基金管理人—富国基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算等情况的说明**

本托管人认为，富国基金管理有限公司在富国天时货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **5.3 托管人对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**

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的富国天时货币市场基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部  
2010 年 8 月 20 日

### **§ 6 半年度财务报表(未经审计)**

#### **6.1 资产负债表**

会计主体：富国天时货币市场基金

报告截止日：2010 年 06 月 30 日

金额单位：人民币元

资 产	本期末 (2010年06月30日)	上年度末 (2009年12月31日)
<b>资 产:</b>		
银行存款	39,112,984.80	119,308,962.37
结算备付金	19,626,100.00	1,012,637,890.48
存出保证金	—	—
交易性金融资产	1,004,077,829.00	379,294,584.40
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	1,004,077,829.00	379,294,584.40
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	777,258,729.65	1,335,000,195.93
应收证券清算款	—	400,200.00
应收利息	3,983,720.32	2,666,937.57
应收股利	—	—
应收申购款	34,979,323.17	228,758.82
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,879,038,686.94	2,849,537,529.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> (2010年06月30日)	<b>上年度末</b> (2009年12月31日)
<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	394,898,887.65	—
应付证券清算款	28,348,716.86	115,948,545.64
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	504,972.66	460,683.78
应付托管费	153,022.02	139,601.13
应付销售服务费	83,382.17	98,411.10
应付交易费用	43,505.47	12,819.93
应交税费	374,400.00	255,200.00
应付利息	194,497.66	—
应付利润	2,108,617.11	1,742,901.90
递延所得税负债	—	—
其他负债	78,810.68	54,500.00
负债合计	426,788,812.28	118,712,663.48
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,452,249,874.66	2,730,824,866.09
未分配利润	—	—
所有者权益合计	1,452,249,874.66	2,730,824,866.09

负债和所有者权益总计	1, 879, 038, 686. 94	2, 849, 537, 529. 57
------------	----------------------	----------------------

注：报告截止日 2010 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1452249874.66 份，其中 A 级基金份额总额 301481161.68 份，其中 B 级基金份额总额 1150768712.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国天时货币市场基金

本报告期：2010 年 01 月 01 日至 2010 年 06 月 30 日

金额单位：人民币元

项 目	本期 (2010 年 01 月 01 日至 2010 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2009 年 01 月 01 日至 2009 年 06 月 30 日)
<b>一、收入</b>	26, 473, 596. 41	19, 982, 063. 48
1. 利息收入	20, 419, 447. 83	10, 641, 917. 99
其中：存款利息收入	2, 739, 375. 06	2, 604, 941. 81
债券利息收入	7, 848, 369. 49	7, 003, 396. 05
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	9, 831, 703. 28	1, 033, 580. 13
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	6, 054, 148. 58	9, 340, 145. 49
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	6, 054, 148. 58	9, 340, 145. 49
资产支持证券投资收益	—	—
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）	—	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—	—
<b>减：二、费用</b>	6, 184, 738. 63	6, 209, 696. 09
1. 管理人报酬	3, 899, 016. 51	3, 323, 367. 30
2. 托管费	1, 181, 520. 10	1, 007, 080. 98
3. 销售服务费	611, 018. 48	1, 783, 981. 13
4. 交易费用	—	—
5. 利息支出	374, 791. 39	—
其中：卖出回购金融资产支出	374, 791. 39	—
6. 其他费用	118, 392. 15	95, 266. 68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	20, 288, 857. 78	13, 772, 367. 39
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	20, 288, 857. 78	13, 772, 367. 39

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天时货币市场基金

本报告期：2010年01月01日至2010年06月30日

金额单位：人民币元

项目	本期 (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）	2,730,824,866.09	—	2,730,824,866.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	20,288,857.78	20,288,857.78
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）	-1,278,574,991.43	—	-1,278,574,991.43
其中：1. 基金申购款	8,670,930,892.40	—	8,670,930,892.40
2. 基金赎回款	-9,949,505,883.83	—	-9,949,505,883.83
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）	—	-20,288,857.78	-20,288,857.78
五、期末所有者权益（基金净值）	1,452,249,874.66	—	1,452,249,874.66
项目	上年度可比期间 (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）	1,091,140,414.11	—	1,091,140,414.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	13,772,367.39	13,772,367.39
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）	511,354,124.78	—	511,354,124.78
其中：1. 基金申购款	10,333,511,651.06	—	10,333,511,651.06
2. 基金赎回款	-9,822,157,526.28	—	-9,822,157,526.28
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）	—	-13,772,367.39	-13,772,367.39
五、期末所有者权益（基金净值）	1,602,494,538.89	—	1,602,494,538.89

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 年度会计报表附注

**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

本基金本期末未发生重大会计差错，无需更正。

### 6.4.3 税项

#### 1、 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》，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[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；

#### 2、 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》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%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

本基金本报告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。

#### 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、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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。

### 6.4.5 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 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.5.1.2 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间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（2010年01月01日至2010年06月30日）	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	3,899,016.51	3,323,367.30
其中：支付销售机构的客户维护费	419,350.04	915,633.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费在基金合同生效后每日计提，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。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,181,520.10	1,007,080.98

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费在基金合同生效后每日计提，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。

6.4.5.2.3 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06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A级	B级	合计
富国基金管理有限公司	513,402.64	97,615.84	611,018.48
合计	513,402.64	97,615.84	611,018.48

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01月01日至2009年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A级	B级	合计

富国基金管理有限公司	1,753,409.41	30,571.72	1,783,981.13
合计	1,753,409.41	30,571.72	1,783,981.13

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。

本基金 A 级的基金销售服务费按前一日 A 级基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的 A 级基金资产净值

本基金 B 级的基金销售服务费按前一日 B 级基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的 B 级基金资产净值

基金销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，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。

#### 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

单位：人民币元

本期（2010年01月01日至2010年06月30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
—	—	—	—	—	—	—
上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30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
中国农业银行	—	359,145,275.49	—	—	—	—

#### 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：本基金的管理人本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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本报告期末和上年度末均未投资本基金。

#### 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 (2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间 (2009年01月01日至2009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
中国农业银行	39,112,984.80	452,260.14	109,089,748.84	702,685.28



#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.6 期末（2010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：债券

注：本基金本报告期末不存在因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.6.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.6.2.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2010年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额394,898,887.65元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
090213	09国开13	2010-07-02	101.08	400,000	40,433,227.30
1001021	10央行票据21	2010-07-02	98.62	500,000	49,311,672.66
090218	09国开18	2010-07-02	100.11	100,000	10,011,139.47
0901048	09央行票据48	2010-07-02	99.55	1,000,000	99,548,289.29
0901038	09央行票据38	2010-07-05	99.74	1,000,000	99,735,920.51
0901042	09央行票据42	2010-07-05	99.67	1,000,000	99,666,081.22
合计				4,000,000.00	398,706,330.45

###### 6.4.6.2.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本期末交易所债券正回购余额为零。

#### 6.4.7 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	固定收益投资	1,004,077,829.00	53.44
	其中：债券	1,004,077,829.00	53.44
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	777,258,729.65	41.36

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	58,739,084.80	3.13
4	其他资产	38,963,043.49	2.07
5	合计	1,879,038,686.94	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.09	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	394,898,887.65	27.19
	其中：买断式回购融资	—	—

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2010-06-28	24.18	应对大额赎回	2010-7-2
2	2010-06-29	27.55	应对大额赎回	2010-7-2
3	2010-06-30	27.19	应对大额赎回	2010-7-2

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	60.35	29.14
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.78	—
2	30 天(含)—60 天	6.87	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—

3	60天(含)—90天	6.86	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	23.39	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	29.24	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		126.71	29.14

#### 7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,973,155.75	2.06
2	央行票据	398,036,108.32	27.41
3	金融债券	90,488,924.64	6.23
	其中：政策性金融债	90,488,924.64	6.23
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	485,579,640.29	33.44
6	其他	—	—
7	合计	1,004,077,829.00	69.14
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	40,433,227.30	2.78

#### 7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	0901048	09 央票 48	1,500,000.00	149,322,433.93	10.28
2	0901038	09 央票 38	1,000,000.00	99,735,920.51	6.87
3	0901042	09 央行票据 42	1,000,000.00	99,666,081.22	6.86
4	1081081	10 沪大众 CP01	500,000.00	50,165,211.66	3.45
5	090218	09 国开 18	500,000.00	50,055,697.34	3.45
6	1081152	10 建发集 CP01	500,000.00	50,010,086.52	3.44
7	1001021	10 央行票据 21	500,000.00	49,311,672.66	3.40
8	090213	09 国开 13	400,000.00	40,433,227.30	2.78
9	0981236	09 顺鑫 CP01	300,000.00	30,207,601.26	2.08
10	1081162	10 宁交投 CP01	300,000.00	30,044,078.60	2.07

#### 7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
----	------

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	—
报告期内偏离度的最高值	0.0670%
报告期内偏离度的最低值	-0.1214%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0433%

注：以上数据按工作日统计

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 投资组合报告附注

### 7.8.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

### 7.8.2 本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的声明

本报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况。

### 7.8.3 声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。

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.8.4 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	3,983,720.32
4	应收申购款	34,979,323.17
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	38,963,043.49

### 7.8.5 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

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	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国天时货币 A	12020	25,081.63	54,929,453.35	18.22	246,551,708.33	81.78
富国天时货币 B	50	23,015,374.26	1,119,794,455.81	97.31	30,974,257.17	2.69
合计	12070	120,318.96	1,174,723,909.16	80.89	277,525,965.50	19.11

### 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	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	富国天时 A 级	1,132,246.48	0.3756
	富国天时 B 级	—	—
	合计	1,132,246.48	0.0780

## § 9 开放式基金份额变动

份额单位：份

	富国天时 A 级	富国天时 B 级
基金合同生效日(2006年06月05日)基金份额总额	3,518,813,010.23	—
报告期初基金份额总额	401,085,257.69	2,329,739,608.40
报告期基金总申购份额	1,935,361,156.00	6,735,569,736.40
减：报告期基金总赎回份额	2,034,965,252.01	7,914,540,631.82
本报告期末基金份额总额	301,481,161.68	1,150,768,712.98

注：基金合同生效日为 2006 年 6 月 5 日。红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。分级基金份额转换也计入申购、赎回份额。

## § 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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

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。

## 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无受到监管部门稽查或处罚的情况。

## 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	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
东方证券	1	26,786,900,000.00	94.34	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—
中银国际	1	1,607,937,000.00	5.66	—	—	—

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他相关因素后决定的。本报告期内本基金租用的交易单元未发生变更。

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。