

(上接D018版)

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、处罚的情形。

(2)申购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备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	598,780.49
2	应付证券清算款	0.00
3	应收股利	-
4	应收利息	58,021,372.95
5	应收申购款	7,869,243.03
6	其他应收款	49,512.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,538,609.31

注:1)本基金期末持有的处于转股期的可转债明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120801	太极转债	8,653,146.24	0.24
2	110971	恒源转债	4,641,337.40	0.13
3	110368	五洲转债	4,575,570.30	0.13
4	110567	山鹰转债	759,420.30	0.02
5	125960	锡业转债	169,339.41	0.01
6	125960	太极转债	66,538,609.31	

注:2)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601766	中国国电	5,898,819.50	0.17
2	002269	美邦服饰	1,520,106.00	0.04
3	002267	陕天然气	1,251,283.46	0.04
4	002257	立讯电子	959,072.94	0.03
5	002273	水晶光电	829,26.25	0.02
6	002258	利尔化纤	562,684.16	0.01
7	002258	利尔化纤	66,538,609.31	

注:3)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601766	中国国电	5,898,819.50	0.17
2	002269	美邦服饰	1,520,106.00	0.04
3	002267	陕天然气	1,251,283.46	0.04
4	002257	立讯电子	959,072.94	0.03
5	002273	水晶光电	829,26.25	0.02
6	002258	利尔化纤	562,684.16	0.01
7	002258	利尔化纤	66,538,609.31	

注:4)报告期末持有的处于转股期的可转债明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120801	太极转债	8,653,146.24	0.24
2	110971	恒源转债	4,641,337.40	0.13
3	110368	五洲转债	4,575,570.30	0.13
4	110567	山鹰转债	759,420.30	0.02
5	125960	锡业转债	169,339.41	0.01
6	125960	太极转债	66,538,609.31	

注:5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601766	中国国电	5,898,819.50	0.17
2	002269	美邦服饰	1,520,106.00	0.04
3	002267	陕天然气	1,251,283.46	0.04
4	002257	立讯电子	959,072.94	0.03
5	002273	水晶光电	829,26.25	0.02
6	002258	利尔化纤	562,684.16	0.01
7	002258	利尔化纤	66,538,609.31	

注: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,投资组合中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

二、基金的业绩

基金管理人恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的履行基金管理职责,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1.富国天利增长债券投资基金历史各时间阶段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
2003.12.2至2004.1.31	0.14%	0.01%	1.71%	0.34%
2004.1.31至2004.12.31	-2.63%	0.29%	-2.42%	0.35%
2005.1.1至2005.12.31	11.57%	0.28%	10.26%	0.18%
2006.1.1至2006.12.31	27.56%	0.40%	28.89%	0.40%
2007.1.1至2007.12.31	38.70%	0.40%	41.80%	0.32%
2008.1.1至2008.6.30	-3.03%	0.24%	1.81%	0.10%
2008.7.1至2008.9.30	-0.52%	0.21%	7.09%	0.14%
2008.10.1至2008.12.28	91.49%	0.33%	18.42%	0.20%

2.自基金成立以来收益情况如富国天利增长债券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
2003.12.2至2004.1.31	0.14%	0.01%	1.71%	0.34%
2004.1.31至2004.12.31	-2.63%	0.29%	-2.42%	0.35%
2005.1.1至2005.12.31	11.57%	0.28%	10.26%	0.18%
2006.1.1至2006.12.31	27.56%	0.40%	28.89%	0.40%
2007.1.1至2007.12.31	38.70%	0.40%	41.80%	0.32%
2008.1.1至2008.6.30	-3.03%	0.24%	1.81%	0.10%
2008.7.1至2008.9.30	-0.52%	0.21%	7.09%	0.14%
2008.10.1至2008.12.28	91.49%	0.33%	18.42%	0.20%

3.自基金成立以来收益情况如富国天利增长债券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
2003.12.2至2004.1.31	0.14%	0.01%	1.71%	0.34%
2004.1.31至2004.12.31	-2.63%	0.29%	-2.42%	0.35%
2005.1.1至2005.12.31	11.57%	0.28%	10.26%	0.18%
2006.1.1至2006.12.31	27.56%	0.40%	28.89%	0.40%
2007.1.1至2007.12.31	38.70%	0.40%	41.80%	0.32%
2008.1.1至2008.6.30	-3.03%	0.24%	1.81%	0.10%
2008.7.1至2008.9.30	-0.52%	0.21%	7.09%	0.14%
2008.10.1至2008.12.28	91.49%	0.33%	18.42%	0.20%

注:7)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(
----	------	------	--------------