

富国天时货币市场基金  
二〇一一年年度报告  
(摘要)

2011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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2012年03月28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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 26 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 2011 年 1 月 1 日起至 2011 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      | 5,425,049,162.36 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属两级基金的基金简称     | 富国天时 A 级           | 富国天时 B 级           |
| 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 | 1,442,105,127.30 份 | 3,982,944,035.06 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。<br>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 | 021-20361858           | 010-66060069          |
|         | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话  |      | 95105686、4008880688    | 95599                 |
| 传真      |      | 021-20361634           | 010-63201816          |

## 2.4 信息披露方式

|                         |   |
|-------------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的<br>管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn   |
| 基金年度报告备置地点              | 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼<br>中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街<br>28 号凯晨世贸中心东座 F9 |

## § 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) 富国天时 A 级

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2011 年           | 2010 年           | 2009 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 20,172,462.32    | 5,685,673.88     | 12,059,855.22    |
| 本期利润          | 20,172,462.32    | 5,685,673.88     | 12,059,855.22    |
| 本期净值收益率       | 3.7014%          | 1.6578%          | 1.4299%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011 年 12 月 31 日 | 2010 年 12 月 31 日 | 2009 年 12 月 31 日 |
| 期末基金资产净值      | 1,442,105,127.30 | 219,310,845.03   | 401,085,257.69   |
| 期末基金份额净值      | 1.0000           | 1.0000           | 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 | 2011 年           | 2010 年           | 2009 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 68,707,730.29    | 28,886,308.84    | 12,571,811.98    |
| 本期利润          | 68,707,730.29    | 28,886,308.84    | 12,571,811.98    |
| 本期净值收益率       | 3.9488%          | 1.9025%          | 1.6663%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011 年 12 月 31 日 | 2010 年 12 月 31 日 | 2009 年 12 月 31 日 |
| 期末基金资产净值      | 3,982,944,035.06 | 1,075,516,164.78 | 2,329,739,608.40 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000           | 1.0000           | 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 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|------|------|-------|-----|-----|
|----|------|------|------|-------|-----|-----|

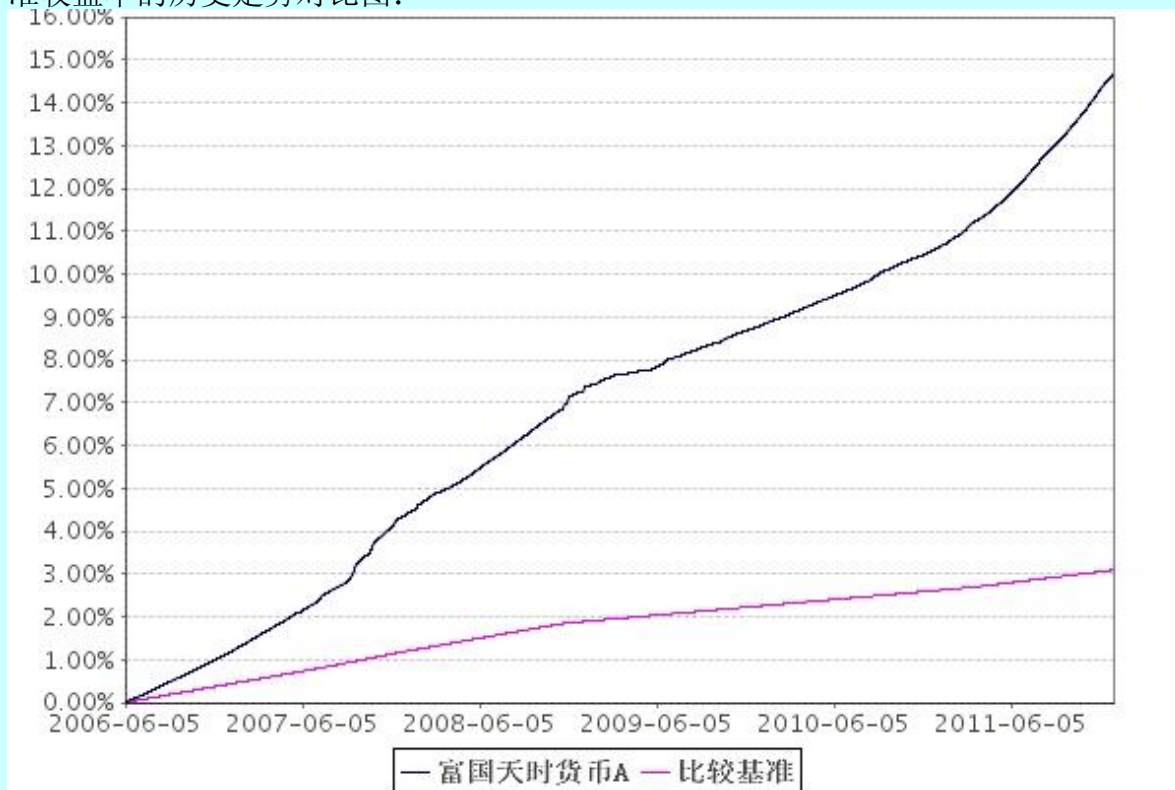
|       | 收益率①     | 收益率标准差② | 基准收益率③  | 准收益率标准差④ |          |         |
|-------|----------|---------|---------|----------|----------|---------|
| 过去三个月 | 1.1696%  | 0.0031% | 0.1278% | 0.0000%  | 1.0418%  | 0.0031% |
| 过去六个月 | 2.2150%  | 0.0024% | 0.2556% | 0.0000%  | 1.9594%  | 0.0024% |
| 过去一年  | 3.7014%  | 0.0036% | 0.4762% | 0.0001%  | 3.2252%  | 0.0035% |
| 过去三年  | 6.9205%  | 0.0052% | 1.2062% | 0.0002%  | 5.7143%  | 0.0050% |
| 过去五年  | 13.3862% | 0.0059% | 2.6715% | 0.0005%  | 10.7147% | 0.0054% |
| 自成立以来 | 14.6765% | 0.0056% | 3.0915% | 0.0005%  | 11.5850% | 0.0051% |

## (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     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 1.2300%  | 0.0031%     | 0.1278%    | 0.0000%       | 1.1022%  | 0.0031% |
| 过去六个月 | 2.3373%  | 0.0024%     | 0.2556%    | 0.0000%       | 2.0817%  | 0.0024% |
| 过去一年  | 3.9488%  | 0.0036%     | 0.4762%    | 0.0001%       | 3.4726%  | 0.0035% |
| 过去三年  | 7.6911%  | 0.0052%     | 1.2062%    | 0.0002%       | 6.4849%  | 0.0050% |
| 过去五年  | 14.7494% | 0.0059%     | 2.6715%    | 0.0005%       | 12.0779% | 0.0054% |
| 自成立以来 | 14.9887% | 0.0059%     | 2.7375%    | 0.0005%       | 12.2512% | 0.0054% |

### 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

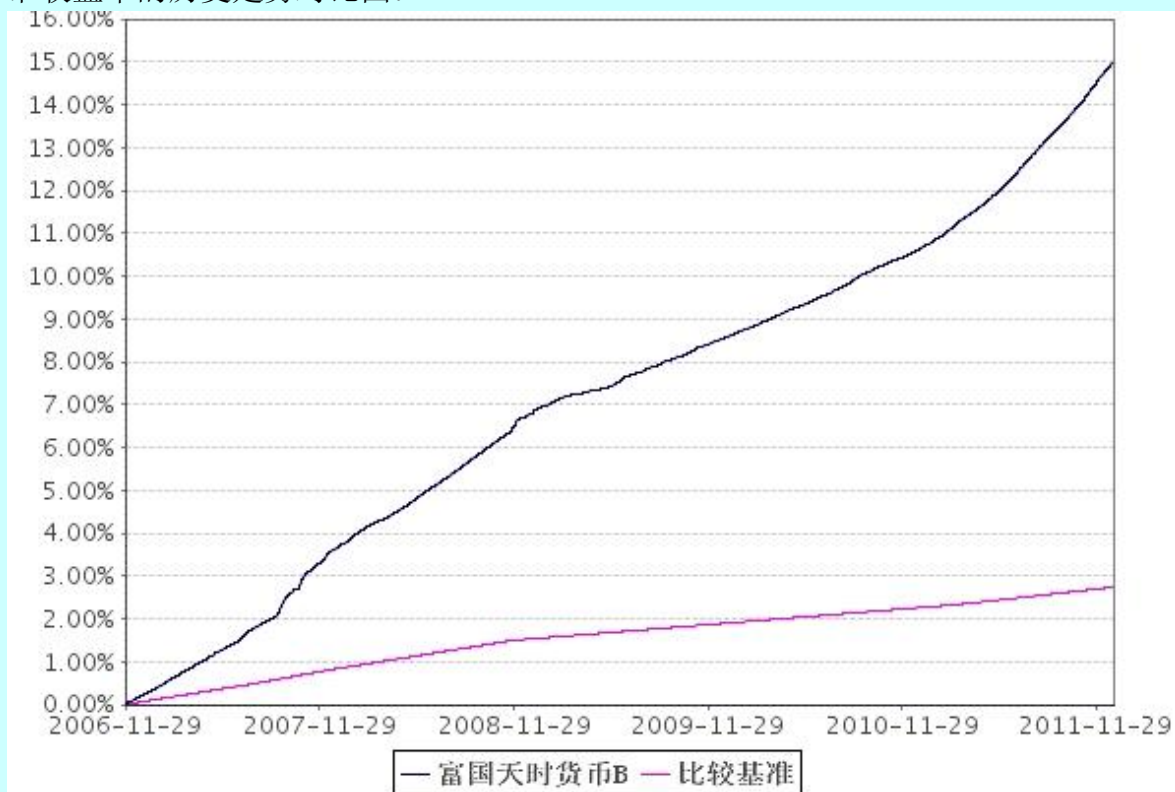
(1) 自基金合同生效以来富国天时货币市场 A 级基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注: 截止日期为 2011 年 12 月 31 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。

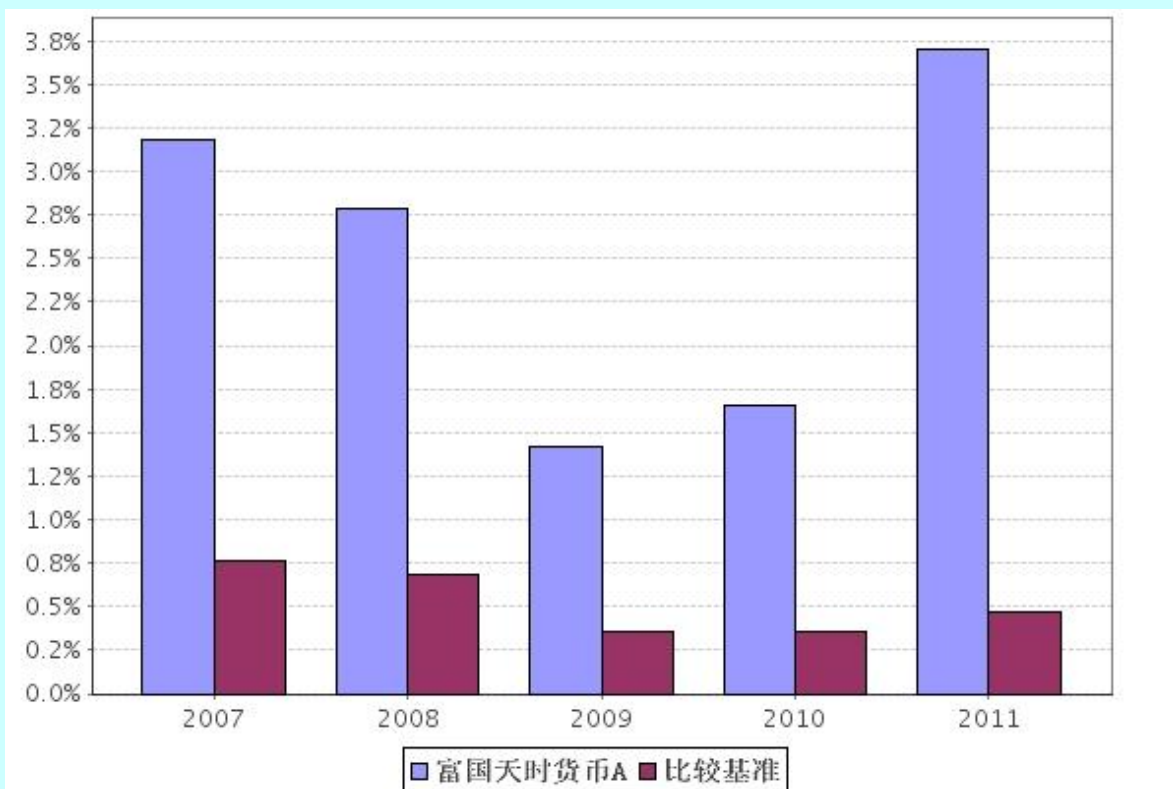
(2) 自基金合同生效以来富国天时货币市场 B 级基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



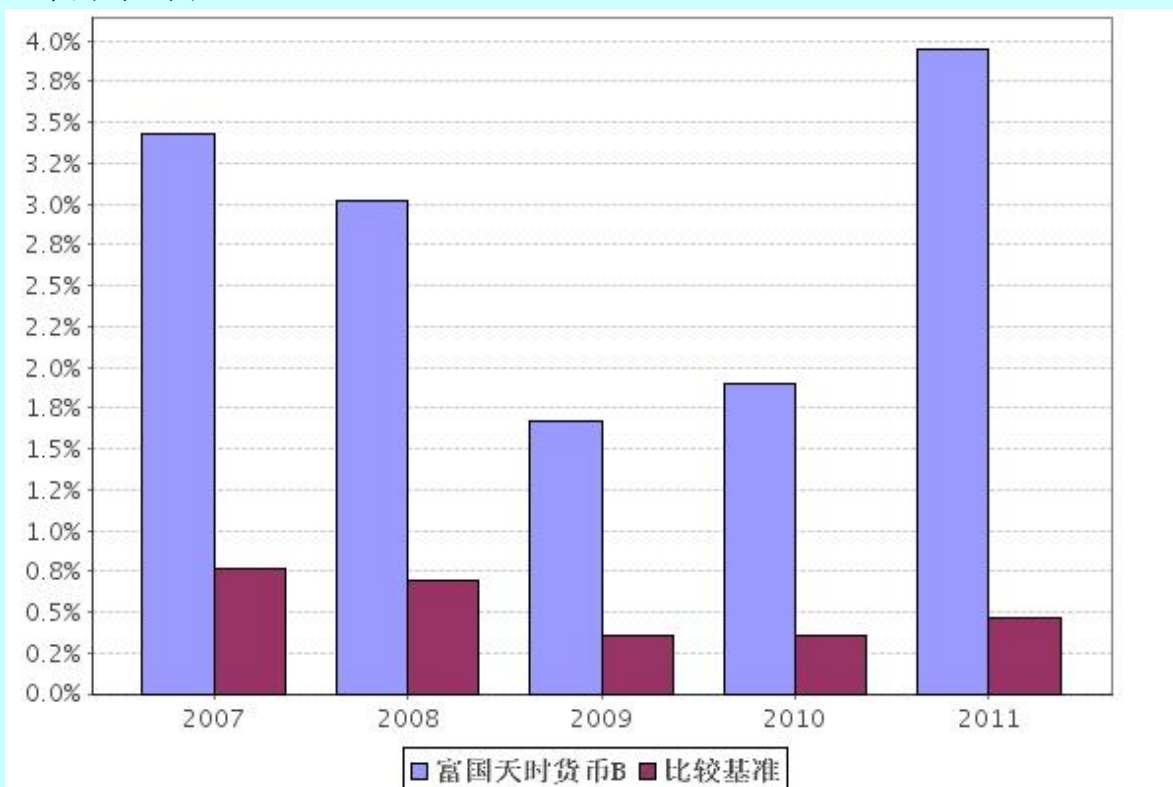
注：起始日期为 2006 年 11 月 29 日，截止日期为 2011 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

(1) 自基金合同生效以来富国天时货币市场 A 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) 自基金分级以来富国天时货币市场 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### (1) 富国天时 A 级

金额单位：人民币元

| 年度    | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
|-------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2011年 | 14,760,606.55    | 3,537,706.29      | 1,874,149.48 | 20,172,462.32 | —  |
| 2010年 | 5,375,975.02     | 1,048,423.53      | -738,724.67  | 5,685,673.88  | —  |
| 2009年 | 9,374,819.62     | 3,239,975.69      | -554,940.09  | 12,059,855.22 | —  |
| 合计    | 29,511,401.19    | 7,826,105.51      | 580,484.72   | 37,917,991.42 | —  |

## (2) 富国天时 B 级

金额单位：人民币元

| 年度    | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
|-------|------------------|-------------------|---------------|----------------|----|
| 2011年 | 42,413,314.67    | 14,432,527.69     | 11,861,887.93 | 68,707,730.29  | —  |
| 2010年 | 23,567,380.26    | 4,968,946.42      | 349,982.16    | 28,886,308.84  | —  |
| 2009年 | 9,889,192.58     | 1,991,857.80      | 690,761.60    | 12,571,811.98  | —  |
| 合计    | 75,869,887.51    | 21,393,331.91     | 12,902,631.69 | 110,165,851.11 | —  |

## § 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2011年12月31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、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金二十六只证券投资基金。

#### 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 |        |                |
| 刁羽 | 本基金基 | 2010-06-23  | —    | 5年     | 博士，曾任国泰君安证券股份有 |



|    |  |            |   |     |  |
|----|--|------------|---|-----|--|
|    | 金 经 理 兼<br>任 富 国 汇<br>利 分 级 债<br>券 型 证 券<br>投 资 基 金<br>基 金 经 理、<br>富 国 天 盈<br>分 级 债 券<br>型 证 券 投<br>资 基 金 基<br>金 经 理 |            |   |     | 限公司固定收益部研究员、交易<br>员，浦银安盛基金管理有限公司<br>基金经理助理，2009年6月任富<br>国基金管理有限公司富国天时货<br>币市场基金基金经理助理，2010<br>年6月至今任富国天时货币市场<br>基金基金经理，2010年11月起兼<br>任富国汇利分级债券型证券投资<br>基金基金经理，2011年5月起兼<br>任富国天盈分级债券型证券投资<br>基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 邹卉 | 本 基 金 基<br>金 经 理   | 2011-08-01 | — | 6 年 | 硕士，自2006年3月至2007年8<br>月任上海国泰人寿保险有限公司<br>投资部投资助理，自2007年8月<br>至2008年8月任东方基金管理有<br>限公司债券研究员，自2008年9<br>月至2011年7月任富国基金管理<br>有限公司债券研究员，自2011年<br>8月起任富国天时货币市场基金<br>基金经理。具有基金从业资格，<br>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2011年8月1日在上海证券报及公司网站上做公告，聘任邹卉女士担任本基金基金经理，与刁羽先生共同管理本基金。

#### 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，严格执行交易系统中的公平交易程序，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

2011 年国内经济形势出现非典型滞胀局面，一方面 2008 年 4 万亿的超常规信贷投放，导致上半年通胀压力剧增，另一方面，实体经济却因房地产市场的调控和国外欧债危机等拖累下行。高企的存款准备金率，加上今年监管层对商业银行表外业务的严厉监管，导致银行间资金面数次“发烧”，回购利率飙升。复杂的经济和资金形势使得 2011 年的债券市场一波三折，尤其是对资金敏感的短融、央票等短期债券品种波动加大。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金 A 级每万份基金净收益为 1.1761 元，7 日年化收益率（按月结转）为 4.368%；本基金 B 级每万份基金净收益为 1.2419 元，7 日年化收益率（按月结转）为 4.599%。报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为 3.7014%，同期业绩比较基准收益率为 0.4762%；本基金 B 级份额净值增长率为 3.9488%，同期业绩比较基准收益率为 0.4762%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本年度，基金管理人坚持严格按照基金合同进行投资管理，在利率剧烈波动的环境中，兼顾基金资产的安全性、流动性和收益性。本年度上半年，基金配置主要坚持谨慎性原则，实行短久期和轻仓位策略，尽量规避了利率上行带来的冲击，并通过回购和协议存款操作获得了较高收益，四季度，随着通胀的见顶回落，管理人积极把握短融的较好配置机会，进行了仓位调整。另外，基金管理人 also 通过严密的资金安排，保证了组合的流动性管理需要。

#### 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**

本基金本报告期已按《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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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、基金费用开支及利润分配等问题上，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，未发现有关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

2012 年 3 月 26 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：富国天时货币市场基金

报告截止日：2011年12月31日

金额单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>(2011年12月31日)         | 上年度末<br>(2010年12月31日)         |
|-----------------|------------------------------|-------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                              |                               |
| 银行存款            | 3,104,136,447.42             | 591,091,530.93                |
| 结算备付金           | —                            | 18,625,909.09                 |
| 存出保证金           | —                            | 478,848.48                    |
| 交易性金融资产         | 1,574,216,752.88             | 475,706,133.60                |
| 其中：股票投资         | —                            | —                             |
| 基金投资            | —                            | —                             |
| 债券投资            | 1,574,216,752.88             | 475,706,133.60                |
| 资产支持证券投资        | —                            | —                             |
| 衍生金融资产          | —                            | —                             |
| 买入返售金融资产        | 465,371,658.06               | 341,124,943.62                |
| 应收证券清算款         | —                            | —                             |
| 应收利息            | 33,481,207.02                | 5,155,931.80                  |
| 应收股利            | —                            | —                             |
| 应收申购款           | 266,076,273.58               | 361,386.53                    |
| 递延所得税资产         | —                            | —                             |
| 其他资产            | —                            | —                             |
| 资产总计            | 5,443,282,338.96             | 1,432,544,684.05              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>(2011年12月31日)</b> | <b>上年度末<br/>(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          | —                            | —                             |
| 卖出回购金融资产款       | —                            | —                             |
| 应付证券清算款         | —                            | 135,000,004.30                |
| 应付赎回款           | —                            | —                             |
| 应付管理人报酬         | 1,347,713.06                 | 319,079.08                    |
| 应付托管费           | 408,397.87                   | 96,690.61                     |
| 应付销售服务费         | 234,618.28                   | 56,363.26                     |
| 应付交易费用          | 48,028.09                    | 12,055.10                     |
| 应交税费            | 949,722.50                   | 724,822.50                    |
| 应付利息            | —                            | —                             |
| 应付利润            | 15,090,196.80                | 1,354,159.39                  |
| 递延所得税负债         | —                            | —                             |
| 其他负债            | 154,500.00                   | 154,500.00                    |
| 负债合计            | 18,233,176.60                | 137,717,674.24                |
| <b>所有者权益：</b>   |                              |                               |

|            |                  |                  |
|------------|------------------|------------------|
| 实收基金       | 5,425,049,162.36 | 1,294,827,009.81 |
| 未分配利润      | —                | —                |
| 所有者权益合计    | 5,425,049,162.36 | 1,294,827,009.81 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,443,282,338.96 | 1,432,544,684.05 |

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,425,049,162.36 份，其中 A 级基金份额总额 1,442,105,127.30 份，其中 B 级基金份额总额 3,982,944,035.06 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天时货币市场基金

本报告期：2011 年 01 月 01 日至 2011 年 12 月 31 日

金额单位：人民币元

| 项 目                    | 本期<br>(2011 年 01 月 01 日至<br>2011 年 12 月 31 日) | 上年度可比期间<br>(2010 年 01 月 01 日至<br>2010 年 12 月 31 日) |
|------------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            | 100,243,836.02                                | 44,527,014.21                                      |
| 1. 利息收入                | 94,606,966.05                                 | 35,745,216.65                                      |
| 其中：存款利息收入              | 41,059,333.33                                 | 4,742,325.94                                       |
| 债券利息收入                 | 33,775,631.22                                 | 14,671,267.59                                      |
| 资产支持证券利息收入             | —   | —  |
| 买入返售金融资产收入             | 19,772,001.50                                 | 16,331,623.12                                      |
| 其他利息收入                 | —   | —  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 5,606,869.97                                  | 8,781,797.56                                       |
| 其中：股票投资收益              | —   | —  |
| 基金投资收益                 | —   | —  |
| 债券投资收益                 | 5,606,869.97                                  | 8,781,797.56                                       |
| 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）     | 30,000.00                                     | —  |
| <b>减：二、费用</b>          | 11,363,643.41                                 | 9,955,031.49                                       |
| 1. 管理人报酬               | 7,213,891.59                                  | 6,307,276.51                                       |
| 2. 托管费                 | 2,186,027.80                                  | 1,911,295.88                                       |
| 3. 销售服务费               | 1,471,918.29                                  | 1,030,632.77                                       |
| 4. 交易费用                | —   | —  |
| 5. 利息支出                | 235,006.95                                    | 479,088.15   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          | 235,006.95                                    | 479,088.15   |
| 6. 其他费用                | 256,798.78                                    | 226,738.18   |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 88,880,192.61 | 34,571,982.72 |
| 减：所得税费用             | —             | —             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 88,880,192.61 | 34,571,982.72 |

### 7.3 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：2011年01月01日至2011年12月31日

金额单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>(2011年01月01日至2011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）                        | 1,294,827,009.81                     | —              | 1,294,827,009.81   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | —                                    | 88,880,192.61  | 88,880,192.61      |
| 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）      | 4,130,222,152.55                     | —              | 4,130,222,152.55   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 22,138,563,219.93                    | —              | 22,138,563,219.93  |
| 2. 基金赎回款                               | -18,008,341,067.38                   | —              | -18,008,341,067.38 |
| 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） | —                                    | -88,880,192.61 | -88,880,192.61     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 5,425,049,162.36                     | —              | 5,425,049,162.36   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>(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）                        | 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）               | —                                    | 34,571,982.72  | 34,571,982.72      |
| 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）      | -1,435,997,856.28                    | —              | -1,435,997,856.28  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 13,360,492,541.60                    | —              | 13,360,492,541.60  |
| 2. 基金赎回款                               | -14,796,490,397.88                   | —              | -14,796,490,397.88 |
| 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） | —                                    | -34,571,982.72 | -34,571,982.72     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,294,827,009.81                     | —              | 1,294,827,009.81   |

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     |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

#### 7.4 年度会计报表附注

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

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. 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。

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。

#### 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 债券交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

###### 7.4.5.1.2 回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

###### 7.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易，无应支付关联方的佣金。

##### 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（2011年01月01日至2011年12月31日） | 上年度可比期间（2010年01月01日至2010年12月31日） |
|-----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,213,891.59                | 6,307,276.51                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 942,468.94                  | 671,168.60                       |

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

###### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期(2011年01月01日至2011年12月31日) | 上年度可比期间（2010年01月01日至2010年12月31日） |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,186,027.80                | 1,911,295.88                     |

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

###### 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（2011年01月01日至2011年12月31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     | 1,305,536.98                | 166,381.31 | 1,471,918.29 |
| 合计             | 1,305,536.98                | 166,381.31 | 1,471,918.29 |

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（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                 |            |              |
|                | A级                               | B级         | 合计           |
| 富国基金管理有限公司     | 874,482.58                       | 156,150.19 | 1,030,632.77 |
| 合计             | 874,482.58                       | 156,150.19 | 1,030,632.77 |

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、公休日等，支付日期顺延。

#### 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（2011年01月01日至2011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 |
| 中国农业银行                           | —      | 40,343,646.23  | —     | —    | —     | —    |
| 上年度可比期间（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 |
| 中国农业银行                           | —      | 161,423,606.44 | —     | —    | —     | —    |

#### 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2011年度及2010年度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

富国天时B级：

份额单位：份

| 关联方名称    | 本期末（2011年12月31日） |                     | 上期末（2010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(%) |
| 山东省国际信托有 | —                | —                   | 250,000,000.00   | 19.31               |

|     |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|
| 限公司 |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|

#### 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<br>(2011年01月01日至2011年12月31日) |            | 上年度可比期间<br>(2010年01月01日至2010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     |
| 中国农业银行股份有限公司 | 4,136,447.42                    | 521,303.45 | 341,091,530.93                       | 855,750.44 |

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券

#### 7.4.6 期末（2011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：债券

注：本基金末不存在因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.6.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.6.2.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末无正回购余额，没有因正回购而作为抵押的债券。

###### 7.4.6.2.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本期末无交易所正回购余额。

#### 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  | 固定收益投资            | 1,574,216,752.88 | 28.92        |
|    | 其中：债券             | 1,574,216,752.88 | 28.92        |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 465,371,658.06   | 8.55         |
|    | 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      | 3,104,136,447.42 | 57.03        |
| 4  | 其他资产              | 299,557,480.60   | 5.50         |
| 5  | 合计                | 5,443,282,338.96 | 100.00       |

## 8.2 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 | 0.44          |               |
|    | 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 | —             | —             |
|    | 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

注：本报告期内本基金证券正回购的资金余额未超过基金资产净值 20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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    | 104 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 132 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 33  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

### 8.3.2 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                 | 41.83              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 2.76               | —                  |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 3.69               | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 10.87              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.92               | —                  |
| 4  | 90 天(含)—180 天          | 22.84              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.37               | —                  |
| 5  | 180 天(含)—397 天(含)      | 15.59              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 合计 |                        | 94.82              | —                  |

#### 8.4 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                 | —                | —             |
| 2  | 央行票据                 | 273,562,486.94   | 5.04          |
| 3  | 金融债券                 | 250,004,671.69   | 4.61          |
|    | 其中：政策性金融债            | 149,212,026.41   | 2.75          |
| 4  | 企业债券                 | 19,988,239.18    | 0.37          |
| 5  | 企业短期融资券              | 1,030,661,355.07 | 19.00         |
| 6  | 中期票据                 | —                | —             |
| 7  | 其他                   | —                | —             |
| 8  | 合计                   | 1,574,216,752.88 | 29.02         |
| 9  | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 219,634,560.81   | 4.05          |

#### 8.5 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  | 1101094   | 11 央行票据 94   | 1,500,000.00 | 145,331,283.24 | 2.68          |
| 2  | 090213    | 09 国开 13     | 1,000,000.00 | 100,792,645.28 | 1.86          |
| 3  | 1101022   | 11 央行票据 22   | 1,000,000.00 | 99,091,107.89  | 1.83          |
| 4  | 041159016 | 11 丝绸 CP002  | 600,000.00   | 60,137,775.07  | 1.11          |
| 5  | 041151010 | 11 玉柴股 CP003 | 600,000.00   | 60,018,535.01  | 1.11          |
| 6  | 070311    | 07 进出 11     | 500,000.00   | 50,358,350.06  | 0.93          |
| 7  | 041159014 | 11 苏汇鸿 CP002 | 500,000.00   | 50,099,729.51  | 0.92          |
| 8  | 041159012 | 11 九州通 CP001 | 500,000.00   | 50,006,148.88  | 0.92          |
| 9  | 041164012 | 11 农六师 CP001 | 500,000.00   | 50,000,906.61  | 0.92          |
| 10 | 1181276   | 11 陕电子 CP01  | 500,000.00   | 49,852,945.00  | 0.92          |

#### 8.6 “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 | 6        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0846%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.2552% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0866%  |

注：以上数据按工作日统计。

#### 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 投资组合报告附注

### 8.8.1 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。

### 8.8.2 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。

### 8.8.3 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。

### 8.8.4 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    | 33,481,207.02  |
| 4  | 应收申购款   | 266,076,273.58 |
| 5  | 其他应收款   | —              |
| 6  | 待摊费用    | —              |
| 7  | 其他      | —              |
| 8  | 合计      | 299,557,480.60 |

### 8.8.5 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。

## § 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 |           |
|      |          |           | 持有份额  | 占总份额比例(%) | 持有份额  | 占总份额比例(%) |

|          |       |               |                  |       |                  |       |
|----------|-------|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 富国天时 A 级 | 18029 | 79,988.08     | 207,501,609.03   | 14.39 | 1,234,603,518.27 | 85.61 |
| 富国天时 B 级 | 147   | 27,094,857.38 | 3,611,400,500.64 | 90.67 | 371,543,534.42   | 9.33  |
| 合计       | 18176 | 298,473.22    | 3,818,902,109.67 | 70.39 | 1,606,147,052.69 | 29.61 |

## 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 | 富国天时 A 级 | 8,233,012.50 | 0.5709      |
|                      | 富国天时 B 级 | 0.00         | 0.0000      |
|                      | 合计       | 8,233,012.50 | 0.1518      |

## § 10 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                 | 219,310,845.03   | 1,075,516,164.78  |
| 报告期基金总申购份额                 | 4,943,854,857.06 | 17,194,708,362.87 |
| 减：报告期基金总赎回份额               | 3,721,060,574.79 | 14,287,280,492.59 |
| 本报告期末基金份额总额                | 1,442,105,127.30 | 3,982,944,035.06  |

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。

## § 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。

2011 年 1 月 21 日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许可[2011]116 号)，张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 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 5 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 9 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 | 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      | 7,212,700,000.00 | 92.31              | —         | —              | —  |

#### 11.8 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。