# 华宝兴业先进成长股票型证券投资基金 2008年年度报告摘要

## 2008年12月31日

**基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司 送出日期:2009年3月26日**

### 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年3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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

### 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 先进成长基金 |
| 交易代码 | 240009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年11月07日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,757,619,360.29份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。 |
| 投资策略 | 本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。 |
| 业绩比较基准 | 新上证综指收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。 |

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 | | 华宝兴业基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘月华 | 宁敏 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 010-66594977 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | tgxxpl@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 | | 021-38924558;4007005588 | 95566 |
| 传真 | | 021-38505777 | 010-66594942 |

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.fsfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人住所。 |

### 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

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2008年 | 2007年 | 2006年11月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -2,039,152,405.62 | 5,769,492,040.39 | 136,906,204.88 |
| 本期利润 | -4,244,474,835.29 | 5,630,211,022.98 | 1,218,708,972.55 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -1.4720 | 1.6888 | 0.1967 |
| 本期基金份额净值增长率 | -51.21% | 139.51% | 19.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2008年 | 2007年 | 2006年11月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3961 | 1.7366 | 0.0218 |
| 期末基金资产净值 | 3,849,989,473.80 | 7,817,570,589.76 | 7,752,169,427.83 |
| 期末基金份额净值 | 1.3961 | 2.8614 | 1.1947 |

注:1、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。

2、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

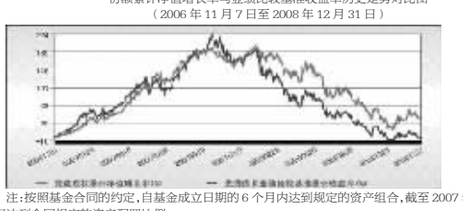
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -13.00% | 2.91% | -20.74% | 2.77% | 7.74% | 0.14% |
| 过去六个月 | -26.69% | 2.78% | -33.46% | 2.81% | 6.77% | -0.03% |
| 过去一年 | -51.21% | 2.53% | -65.42% | 2.85% | 14.21% | -0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.61% | 2.14% | -3.35% | 2.53% | 42.96% | -0.39% |

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

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006年11月7日至2008年12月31日)

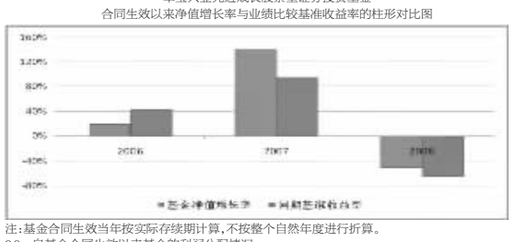


注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2007年5月7日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注:基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

### 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

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2008年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、本基金、行业精选基金、海外中国成长基金和大盘精选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计48,153,927,673.66元。

4.1.2 基金经理简介

| 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 | | |
| 魏东 | 本基金基金经理,宝康灵活配置基金基金经理,公司投资副总监,公司国内投资部总经理 | 2006-11-07 | - | 11年 | 硕士。1997年至2002年,在平安证券公司、国信证券有限责任公司和深圳市深投科技创业投资有限公司从事证券研究工作和资产管理等工作。2003年初加入本公司,曾任交易部总经理。 |

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,先进成长投资基金在短期内出现过现金及一年内到期债券比例略低于5%的情况。发生此类情况后,基金在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

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,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;完成了交易价差分析和异常交易行为监控系统开发,加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

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

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的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,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明,管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2008年确实是值得本基金深刻反思的一年。

在2008年年初,由于对宏观过热的担忧和对行情的谨慎,我们在一季度末和二季度初都保持着相对较低的仓位,以此获得了较大的超额收益。但在四月份之后,我们的投资出现了较大的失误。

当时国内市场已经率先大幅下挫近一半,国内政策利好频出,同时海外市场在美国减税等措施刺激下各项指标已经有所好转,而且国外证券市场走势相对平稳,我们判断市场在3000点附近有可能形成较重要底部,因此大幅加仓。虽然在初期获得了一定收益,但在随后的市场大幅下跌中,并没有充分意识到市场存在的巨大风险,导致在随后的下跌中损失较重,给持有人带来了较大损失。事后来看,从3000点到1600点并没有比从6000点到3000点差多少。对市场反弹存在幻想、同时对宏观缺乏深入认识是我们此次误判所应当接受的教训。

展望未来,我们已经意识到此次危机对未来全球经济循环的深刻影响。从中长期来看,虽然中国仍然处于相对优势,但是难以独善其身。四万亿的财政刺激虽能够起到一时缓解投资迅速下滑的影响,但近数年累积投资所增加的过剩产能,仍有待于内需的提升与出口的回升,而这恰恰是短期所无法解决的问题。从欧美经济危机不断恶化来看,中国经济所面临的真正考验可能还没有开始。出口恶化、失业增加,消费下滑等矛盾在2009年年中时将表现得更为突出。流动性有望成为2009年最大的支持,全球性质的货币超量投放,对虚拟经济将起到有力的支撑。

考虑到诸多有利不利因素,2009年股市大幅波动估计无法避免,相应我们的操作策略也将更为灵活。市场总是矫枉过正,正如6000点超出我们想象力一样,1600点也一样跌出了市场可能应有的水平,中国企业虽然2008年业绩会大幅下滑,但并没有到崩溃的边缘。在泥沙俱下之时,可能正是我们寻找黄金的好时机。考虑到中国特殊的国情、考虑到全球性的充沛的流动性,我们仍然对2009年抱有期望,希望稳中求进,以我们的努力给投资者带来真正的收益。

4.5 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中,各部门参与如下:

(一)基金会计:根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算,并对基金投资品种进行估值。

(二)金融工程部:对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下,为估值提供相关模型。

(三)估值委员会:定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时,评价现有估值政策和程序的适用性。

(四)必要时基金经理参与制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损,本报告期末可供分配基金份额利润为人民币0.3961元。

### 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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在华宝兴业动力组合股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过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:华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

| | 附注号 | 2008年12月31日 | 2007年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 788,762,085.98 | 2,476,484,501.40 |
| 结算备付金 | | 5,658,269.84 | 7,052,813.39 |
| 存出保证金 | | 1,197,813.66 | 3,185,293.40 |
| 交易性金融资产 | | 3,051,171,535.17 | 5,424,985,272.71 |
| 其中:股票投资 | | 2,857,751,535.17 | 5,421,099,304.91 |
| 债券投资 | | 193,420,000.00 | 3,885,967.80 |
| 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 | | 3,408,021.02 | 2,534,603.12 |
| 应收利息 | | 6,319,404.04 | 726,286.61 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 11,340,527.22 | 2,587,169.47 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | 45,348.60 |
| 资产总计 | | 3,867,857,656.93 | 7,917,601,288.70 |
| 负债和所有者权益 | | | |
| 负 债: | | | |
| 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 | | 275,399.38 | 55,936,717.98 |
| 应付赎回款 | | 5,148,628.77 | 23,125,050.14 |
| 应付管理人报酬 | 7.4.3.2.1 | 5,172,996.72 | 9,073,592.49 |
| 应付托管费 | 7.4.3.2.2 | 862,166.12 | 1,512,265.43 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 5,506,948.71 | 9,524,518.78 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 902,043.43 | 858,554.12 |
| 负债合计 | | 17,868,183.13 | 100,030,698.94 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 2,757,619,360.29 | 2,732,059,686.04 |
| 未分配利润 | | 1,092,370,113.51 | 5,085,510,903.72 |
| 所有者权益合计 | | 3,849,989,473.80 | 7,817,570,589.76 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,867,857,656.93 | 7,917,601,288.70 |

注:报告截止日2008年12月31日,基金份额净值1.3961元,基金份额总额2,757,619,360.29份。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | 2007年1月1日至2007年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -4,065,742,933.12 | 5,874,887,738.88 |
| 1.利息收入 | | 22,845,007.34 | 12,995,125.09 |
| 其中:存款利息收入 | | 9,110,353.08 | 11,387,664.40 |
| 债券利息收入 | | 13,016,304.26 | 1,607,460.69 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 718,350.00 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | -1,887,827,402.94 | 5,985,972,159.23 |
| 其中:股票投资收益 | | -1,943,969,691.11 | 5,953,138,544.21 |
| 债券投资收益 | | 4,120,613.46 | 2,978,522.77 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | 2,828,030.87 | -2,752,185.35 |
| 股利收益 | | 49,193,643.84 | 32,607,277.60 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | -2,205,322,429.67 | -139,281,017.41 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 4,561,892.15 | 15,201,471.97 |
| 二、费用(以"-"号填列) | | -178,731,902.17 | -244,676,715.90 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.3.2.1 | -88,271,790.40 | -104,207,444.84 |
| 2. 托管费 | 7.4.3.2.2 | -14,711,965.07 | -17,367,907.55 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | -74,686,038.84 | -122,074,547.01 |
| 5. 利息支出 | | -585,974.92 | -521,858.53 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | -585,974.92 | -521,858.53 |
| 6. 其他费用 | | -476,132.94 | -504,957.97 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -4,244,474,835.29 | 5,630,211,022.98 |
| 所得税费用(以"-"号填列) | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列 | | -4,244,474,835.29 | 5,630,211,022.98 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 2008年1月1日至2008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) | 2,732,059,686.04 | 5,085,510,903.72 | 7,817,570,589.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -4,244,474,835.29 | -4,244,474,835.29 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列) | 25,559,674.25 | 251,334,045.08 | 276,893,719.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,906,244,585.40 | 2,001,197,055.56 | 3,907,441,640.96 |
| 2.基金赎回款 | -1,880,684,911.15 | -1,749,863,010.48 | -3,630,547,921.63 |
| 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) | 2,757,619,360.29 | 1,092,370,113.51 | 3,849,989,473.80 |
| 项目 | 2007年1月1日至2007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) | 6,488,818,650.26 | 1,263,350,777.57 | 7,752,169,427.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 5,630,211,022.98 | 5,630,211,022.98 |
| 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) | -3,756,758,964.22 | -1,808,050,896.83 | -5,564,809,861.05 |
| 其中:1.基金申购款 | 3,212,114,438.27 | 3,419,681,513.44 | 6,631,795,951.71 |
| 2.基金赎回款 | -6,968,873,402.49 | -5,227,732,410.27 | -12,196,605,812.76 |
| 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) | 2,732,059,686.04 | 5,085,510,903.72 | 7,817,570,589.76 |

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年期年度报告相一致的说明

与最近一期年度报告相比,本报告期所采用的会计政策保持一致,但所采用的会计估计发生了变更。

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金自2008年9月16日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法,从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2008年9月16日下调65,000,000.00元,相应调减本基金的净利润65,000,000.00元和基金资产净值65,000,000.00元。

7.4.2 关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华宝兴业基金管理有限公司("华宝兴业") | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司("中国银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华宝信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 法国兴业资产管理有限公司 (Société Générale Asset Management SA) | 基金管理人的股东 |
| 上海宝钢集团公司("宝钢集团") | 基金管理人的股东的母公司 |
| 华宝证券经纪有限责任公司("华宝证券") | 受基金管理人的股东控制的公司 |

7.4.2.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.2.2 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 |
|---|---|
| 华宝兴业 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华宝证券 | 受基金管理人的股东控制的公司 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | | 2007年1月1日至2007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 |
| 华宝证券 | 2,243,621,373.85 | 8.36% | 8,591,377,583.94 | 22.47% |

7.4.3.1.2 应支付关联方的佣金

单位:人民币元

| 关联方名称 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 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 |
| 华宝证券 | 1,907,076.77 | 8.45% | 223,608.88 | 4.06% |
| 关联方名称 | 2007年1月1日至2007年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 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 |
| 华宝证券 | 7,044,889.43 | 22.78% | 2,929,580.62 | 30.76% |

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | 2007年1月1日至2007年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期应支付的管理费 | 88,271,790.40 | 104,207,444.84 |
| 其中:当期已支付 | 83,098,793.68 | 95,133,852.35 |
| 期末未支付 | 5,172,996.72 | 9,073,592.49 |

注:支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.5%/当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | 2007年1月1日至2007年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期应支付的托管费 | 14,711,965.07 | 17,367,907.55 |
| 其中:当期已支付 | 13,849,798.95 | 15,855,642.12 |
| 期末未支付 | 862,166.12 | 1,512,265.43 |

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X 0.25%/当年天数。

7.4.3.3 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

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 |
| 中国银行 | - | 196,182,564.38 | - | - | 361,000,000.00 | 381,442.32 |
| | 2007年1月1日至2007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 |
| 中国银行 | - | 499,278,000.00 | - | - | - | - |

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | 2007年1月1日至2007年12月31日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 95,565.74 | - |
| 期间认购总份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | 126,164.79 | 95,565.74 |
| 期间因拆分增加的份额 | - | - |
| 期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 221,730.53 | 95,565.74 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.0080% | 0.0035% |

注:基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.3.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

7.4.3.5 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 | 2008年1月1日至2008年12月31日 | | 2007年1月1日至2007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 |
| 中国银行 | 788,762,085.98 | 8,828,629.88 | 2,476,484,501.40 | 11,049,109.73 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内,本基金无参与关联方承销证券的情况。

7.4.4 期末本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600900 | 长江电力 | 08/05/08 | 资产重组 | 7.35 | 未知 | 未知 | 10,000,000 | 141,958,634.58 | 73,500,000.00 |

注:本基金截至2008年12月31日止持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在消除所公布事项的重大影响后,经交易所批准复牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 8 投资组合报告

1.1 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 | 2,857,751,535.17 | 73.88 |
| | 其中:股票 | 2,857,751,535.17 | 73.88 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | 193,420,000.00 | 5.00 |
| | 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 | 794,420,355.82 | 20.54 |
| 6 | 其他资产 | 22,265,765.94 | 0.58 |
| 7 | 合计 | 3,867,857,656.93 | 100.00 |

1.2 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 | 213,500,000.00 | 5.55 |
| C | 制造业 | 1,157,433,587.49 | 30.07 |
| C0 | 食品、饮料 | 122,317,397.92 | 3.18 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 105,707,600.00 | 2.75 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 300,678,000.00 | 7.81 |
| C5 | 电子 | 31,999,520.00 | 0.83 |
| C6 | 金属、非金属 | 223,230,000.00 | 5.80 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 327,941,069.57 | 8.52 |
| C8 | 医药、生物制品 | 45,560,000.00 | 1.18 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 73,500,000.00 | 1.91 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 7,500,000.00 | 0.19 |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售贸易 | 170,112,200.00 | 4.42 |
| I | 金融、保险业 | 755,973,698.11 | 19.64 |
| J | 房地产业 | 284,540,049.57 | 7.39 |
| K | 社会服务业 | 147,240,000.00 | 3.82 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 47,952,000.00 | 1.25 |
| | 合计 | 2,857,751,535.17 | 74.23 |

1.3 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 | 600036 | 招商银行 | 16,000,000 | 194,560,000.00 | 5.05 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 14,500,000 | 192,125,000.00 | 4.99 |
| 3 | 600309 | 烟台万华 | 16,400,000 | 164,000,000.00 | 4.26 |
| 4 | 000069 | 华侨城A | 18,000,000 | 147,240,000.00 | 3.82 |
| 5 | 000001 | 深发展A | 11,800,941 | 111,636,901.86 | 2.90 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 7,500,999 | 108,014,385.60 | 2.81 |
| 7 | 000338 | 潍柴动力 | 6,000,000 | 107,880,000.00 | 2.80 |
| 8 | 000002 | 万 科A | 16,000,000 | 103,200,000.00 | 2.68 |
| 9 | 600547 | 山东黄金 | 1,800,000 | 87,408,000.00 | 2.27 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 4,800,000 | 87,360,000.00 | 2.27 |

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www.fsfund.com的年度报告正文。

1.4 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 | 601318 | 中国平安 | 545,672,793.44 | 6.98 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 531,313,606.94 | 6.80 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 438,139,786.62 | 5.60 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 423,090,505.32 | 5.41 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 347,392,920.49 | 4.44 |
| 6 | 600309 | 烟台万华 | 346,680,538.28 | 4.43 |
| 7 | 600005 | 武钢股份 | 338,761,606.99 | 4.33 |
| 8 | 000001 | 深发展A | 305,129,009.72 | 3.90 |
| 9 | 600547 | 山东黄金 | 276,438,443.49 | 3.54 |
| 10 | 601628 | 中国人寿 | 259,141,642.59 | 3.31 |
| 11 | 000338 | 潍柴动力 | 248,411,594.47 | 3.18 |
| 12 | 601919 | 中国远洋 | 246,164,855.43 | 3.15 |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 237,801,556.04 | 3.04 |
| 14 | 000069 | 华侨城A | 234,939,529.45 | 3.01 |
| 15 | 600739 | 辽宁成大 | 232,103,340.41 | 2.97 |
| 16 | 600028 | 中国石化 | 229,907,071.65 | 2.94 |
| 17 | 600761 | 安徽合力 | 229,025,191.79 | 2.93 |
| 18 | 600058 | 五矿发展 | 219,424,290.62 | 2.81 |
| 19 | 600585 | 海螺水泥 | 217,040,322.09 | 2.78 |
| 20 | 600361 | 华联综超 | 213,526,180.54 | 2.73 |
| 21 | 601186 | 中国铁建 | 207,238,178.87 | 2.65 |
| 22 | 600153 | 建发股份 | 191,913,689.24 | 2.45% |
| 23 | 601898 | 中煤能源 | 189,438,742.43 | 2.42% |
| 24 | 600016 | 民生银行 | 186,517,354.34 | 2.39% |
| 25 | 600879 | 火箭股份 | 182,725,508.43 | 2.34% |
| 26 | 000157 | 中联重科 | 181,985,981.96 | 2.33% |
| 27 | 601939 | 建设银行 | 176,442,170.66 | 2.26% |
| 28 | 601390 | 中国中铁 | 172,564,070.09 | 2.21% |
| 29 | 600895 | 张江高科 | 171,585,515.25 | 2.19% |
| 30 | 000680 | 山推股份 | 171,283,468.39 | 2.19% |
| 31 | 600748 | 上实发展 | 170,443,059.39 | 2.18% |
| 32 | 600048 | 保利地产 | 164,223,921.89 | 2.10% |
| 33 | 000012 | 南 玻A | 159,108,185.11 | 2.04% |
| 34 | 600308 | 华泰股份 | 156,536,677.68 | 2.00% |

注:买入金额不包括相关交易费用。

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 | 600879 | 火箭股份 | 455,770,621.56 | 5.83 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 435,986,597.91 | 5.58 |
| 3 | 601939 | 建设银行 | 435,479,309.84 | 5.57 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 362,806,787.37 | 4.64 |
| 5 | 000338 | 潍柴动力 | 348,521,176.44 | 4.46 |
| 6 | 002022 | 科华生物 | 289,818,723.91 | 3.71 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 282,650,591.60 | 3.62 |
| 8 | 600428 | 中远航运 | 265,440,980.92 | 3.40 |
| 9 | 600005 | 武钢股份 | 258,100,877.19 | 3.30 |
| 10 | 000680 | 山推股份 | 255,942,984.48 | 3.27 |
| 11 | 600028 | 中国石化 | 246,541,524.90 | 3.15 |
| 12 | 000069 | 华侨城A | 240,614,313.49 | 3.08 |
| 13 | 601328 | 交通银行 | 240,330,304.82 | 3.07 |
| 14 | 600153 | 建发股份 | 236,341,046.46 | 3.02 |
| 15 | 600423 | 柳化股份 | 226,890,895.42 | 2.90 |
| 16 | 600036 | 招商银行 | 211,278,940.27 | 2.70 |
| 17 | 600118 | 中国卫星 | 210,721,178.33 | 2.70 |
| 18 | 600309 | 烟台万华 | 202,642,975.09 | 2.59 |
| 19 | 601919 | 中国远洋 | 183,850,774.83 | 2.35 |
| 20 | 601186 | 中国铁建 | 180,520,375.59 | 2.31 |
| 21 | 000709 | 唐钢股份 | 171,226,849.40 | 2.19 |
| 22 | 600547 | 山东黄金 | 169,813,089