汇添富成长焦点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:汇添富基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 送出日期: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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年3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。

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2008年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	添富焦点
交易代码	519068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月12日
报告期末基金份额总额	12,250,149,446.54份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是主动股票型基金,精选成长性较高,且估值有吸引力的股票进行布局,在有效管理风险的前提下,追求中长期较高的投资回报。
投资策略	本基金采用积极的资产配置和股票投资策略,在资产配置中,通过资产战略配置和战术配置来确定每一阶段投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例;在股票投资中,采用“自下而上”的策略,精选出成长性较高,且估值有吸引力的股票,精心构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为主动股票型基金,属于证券投资基金中风险偏上的品种。

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		汇添富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	蒋松云
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

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	http://www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼21层汇添富基金管理有限公司

§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3月12日至2007年12月31日
本期已实现收益	-2,589,117,780.88	4,057,016,114.90
本期利润	-11,637,779,370.08	12,297,114,487.76
加权平均基金份额本期利润	-0.8512	0.7085
本期加权平均净值利润率	-77.55%	51.41%
本期基金份额净值增长率	-50.85%	75.34%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年3月12日至2007年12月31日
期末可供分配利润	-2,641,911,750.91	1,268,446,056.87
期末可供分配基金份额利润	-0.2157	0.0747
期末基金资产净值	9,608,237,695.63	27,099,994,157.18
期末基金份额净值	0.7843	1.5958
3.1.3 累计期末指标	2008年	2007年3月12日至2007年12月31日
基金份额累计净值增长率	-13.82%	75.34%

注:1、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。

2、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:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

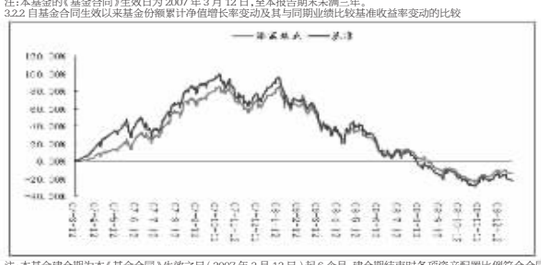
3.2 基金净值表现

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	-6.45%	1.57%	-14.33%	2.43%	7.88%	-0.86%
过去六个月	-20.55%	1.62%	-26.52%	2.38%	5.97%	-0.76%
过去一年	-50.85%	1.83%	-50.88%	2.41%	0.03%	-0.58%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效起至今	-13.82%	1.77%	-22.64%	2.14%	8.82%	-0.37%

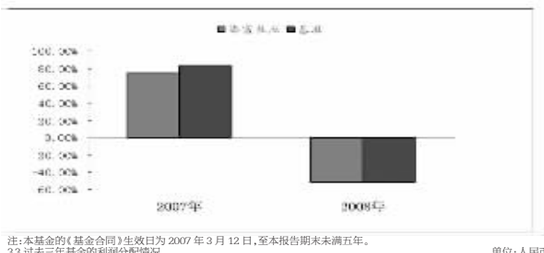
注:本基金的(基金合同)生效日为2007年3月12日,至本报告期末未满三年。

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:本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2007年3月12日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的(基金合同)生效日为2007年3月12日,至本报告期末未满五年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	—	—	—	—	—
2007年	1.500	700,905,551.14	2,061,851,428.46	2,762,756,979.60	—
合计	1.500	700,905,551.14	2,061,851,428.46	2,762,756,979.60	—

注:本基金的(基金合同)生效日为2007年3月12日,至本报告期末未满三年。

§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

汇添富基金管理有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字(2006)5号文批准,于2006年2月3日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。截止到2008年12月31日,公司管理证券投资基金规模达到472亿元,基金份额持有人户数超过193万,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理6只开放式证券投资基金,包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金(A级、B级)、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金。

2008年,汇添富基金凭借优异的业绩和稳健的经营,荣获多家机构评选的多个奖项:

奖项	颁奖单位	获奖日期
汇添富基金管理有限公司荣获2007年度最具成长性基金公司——第五届财经风云榜	和讯网	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具价值基金公司(吉林地区)——2007年度理财公评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具竞争力基金公司(陕西地区)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具价值基金公司(全国)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具竞争力基金公司(重庆地区)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年度“金牛基金管理公司”称号——第五届中国基金业金牛奖评选	《中国证券报》	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金管理公司综合实力大奖——“中国赢基金奖”综合奖	《21世纪经济报道》	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金管理公司最佳公司治理奖——“中国赢基金奖”综合奖	《21世纪经济报道》	2008年1月
汇添富400客户服务中心荣获用户满意电子金融服务品牌——中国电子金融发展年会	中国电子商务协会	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金公司投资回报优秀奖——中国基金十年高峰论坛	网易财经	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国最受尊敬基金公司——中国基金十年高峰论坛	网易财经	2008年1月
添富回荣获用户满意电子金融品牌——中国电子金融发展年会	中国电子商务协会	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年度“金牛基金管理公司”称号——第五届中国基金业金牛奖评选	《中国证券报》	2008年1月
汇添富基金管理有限公司获得“2007年十大最受欢迎的基金公司”	《新民晚报》、东方财富网	2008年2月
汇添富基金管理有限公司获得“十大最受信赖基金公司”——2008年度《新闻晨报”十大基金评选	新闻晨报	2008年9月
汇添富基金管理有限公司获得“2008中国最受尊敬基金公司”	21世纪报系《理财周报》	2008年9月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金管理公司最佳投资团队奖——“中国赢基金奖”综合奖	《21世纪经济报道》	2008年10月
汇添富基金管理有限公司荣获2008第一财经金融价值榜(CFV)——年度社会责任奖	《第一财经日报》	2008年11月
汇添富基金获2008年“最有影响力基金投资者教育奖”	搜狐理财	2008年12月

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
袁建军	本基金的基金经理。	2006年9月5日	-	11年	国籍:中国。学历:上海交通大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任华夏证券研究所高级分析师,2005年4月加入汇添富基金管理有限公司,历任高级行业研究员、研究主管、投资决策委员会成员,2006年9月5日至今任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人已依照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制,涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

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

本基金为成长风格的股票型基金,截止报告期,与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司公平交易制度执行情况良好,未发生任何异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

回顾2008年,中国宏观经济跌宕起伏:上半年经济动力减弱,总需求空间旺盛,通胀率不断创新高,央行不断出台从紧的货币政策抑制经济过热;下半年形势急转直下,次贷危机升级演发了全球性经济危机,中国的外需增速开始明显放缓,同时国内房地产市场依然处于严厉调控中,中国经济增长的双引擎熄火直接造成宏观经济在下半年出现了罕见的硬着陆。从第四季度开始,中国政府迅速启动了庞大的经济刺激方案,实施宽松的货币政策和积极的财政政策。

A股市场提前反映了对宏观经济可能变化的担忧,投资者预期恶化直接导致了A股市场贵穿全年的往下调整格局。直到政府在年末宣布了庞大的4万亿元经济刺激计划和迅速放松货币政策之后,股票市场才在最后两个月逐步稳定下来。

回顾整个2008年的操作,本基金采用相对低仓位运作的资产配置策略,在年初降低了股票投资比例,并在余下时间内有效控制住了这一比例。行业配置和个股选择方面,针对市场的结构性变化预期,本基金实施了结构调整,降低了与外需紧密相关的行业的配置,调低了周期性行业的仓位,适度加大了直接受益财政政策拉动的行业的投资,包括铁路施工、铁路设备和电网设备等;在有吸引力的估值水平上增持了与内需相关的竞争能力较强、业绩增长较为明确的优质股票。这一积极调整结构的策略取得了较好的效果。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一投资年度,我们将面临着一个不确定性的经济和资本市场环境,全球经济衰退将持续一段时间,中国的外需将受到不小的冲击;内需的私人部门投资和消费的增速也在放缓。政府的经济刺激方案将以政府主导项目为先导,带动内需增长,有效实现内需替代外需的目标,平抑经济硬着陆的巨大冲击。大幅度调整之后,A股市场的整体估值泡沫也得到了充分的挤压,宽松的货币政策和积极的财政政策明显改善了流动性;但是,上市公司盈利企稳回升将需要一个过程,大小非减持的压力也还在释放中。

结合上述基本面和政策面的预期,本基金认为A股市场2009年将逐步进入结构性投资机会阶段,主要把握两个方面的投资方向:一是具备持续成长能力、短期增速受影响导致估值下降、但成长性能迅速恢复的龙头公司;二是受益于国家产业政策和经济刺激计划的基本面趋势向好的行业。

因此,本基金依然坚持一贯的投资理念和风格,积极调整行业结构,努力寻找代表未来成长方向的投资机会,并秉承自下而上的选股思路,继续选择在宏观经济逐步回升背景下业绩增长确晰度高、持续性强和估值有吸引力的优质成长股进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行(企业会计准则)估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、产品与金融工程部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金(基金合同)约定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的25%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。

基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账;若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的25%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

(4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

(5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

(6) 每一基金份额享有同等分配权;

(7) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本年度本基金未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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》(以下简称“指导意见”)的要求,本基金自2008年9月16日起,对特定投资品种变更了估值方法,具体如下:

(1) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,做潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值进行估值;

(2) 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值进行估值。

另外,根据《指导意见》的要求,本基金的管理人对管理的不同基金持有的同一投资品种采用一致的估值政策、程序及相关的方法。对于该会计估计变更,本基金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更于2008年度均系因股票长期停牌而引起,对本基金2008年9月16日的净利润和资产净值的影响为减少人民币108,725,221.12元,对本基金2008年度净利润和2008年末资产净值的影响为减少人民币1,191,631.50元。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本年度不存在重大会计差错。

7.4.6 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[2006]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。

7.4.7 关联方关系

7.4.7.1 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
汇添富基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人股东

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年3月12日(基金合同生效日)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
东方证券股份有限公司	5,559,801,826.94	23.52%	14,514,991,964.57	25.96%

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年3月12日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	26,701,065.54	59.74%	—	—

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年3月12日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	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
东方证券股份有限公司	76,792,744.40	97.83%	589,970,432.10	92.72%

7.4.8.1.4 债券回购

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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
东方证券股份有限公司	4,685,363.42	23.58%	407,990.77	12.97%

关联方名称	上年度可比期间 2007年3月12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
东方证券股份有限公司	11,635,080.19	25.73%	1,052,154.29	12.85%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年3月12日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	226,698,442.42	291,454,118.06
其中:当期已支付	214,352,896.97	258,393,548.59
期末支付	12,345,545.45	33,060,569.47

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:H=E×1.50%/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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起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。

2、上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本期和上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于2008年年末及2007年年末均未投资本基金。

7.4.8.5 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 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年3月12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
中国工商银行有限公司	449,582,366.27	19,070,154.21	2,450,570,802.25	24,726,046.43

注:用关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

本基金本期末持有流通受限证券。

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000792	盐湖钾肥	2008-06-26	重大资产重组	56.78	2008-12-26	78.23	4,766,526	176,437,604.12	270,643,346.28

注:本基金年末持有的盐湖钾肥因重大资产重组事项自2008年6月26日至2008年12月25日止期间停牌。本基金自2008年9月16日起采用指数收益法对该股票进行估值。虽然该股票于2008年12月26日复牌,但截至2008年12月31日该股票仍然处于不活跃的市场交易状态,2008年12月31日的收盘价为57.03元,该价格由于交易所涨跌幅限制而无法充分反映其公允价值,故本基金于2008年12月31日仍按照指数收益法对该股票进行估值,估值价格为56.78元。该股票至2009年1月8日恢复活跃市场交易。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.10 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重要事项。

§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	权益投资	6,304,424,547.84	65.25
	其中:股票	6,304,424,547.84	65.25
2	固定收益投资	2,343,172,000.00	24.25
	其中:债券	2,343,172,000.00	24.25
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	479,200,918.80	4.96
	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	451,504,616.77	4.67
6	其他资产	83,829,194.07	0.87
7	合计	9,662,131,277.48	100

8.2 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	399,239,054.78	4.16
C	制造业	3,043,350,083.61	31.67
C0	食品、饮料	1,174,261,015.61	12.22
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	310,037,114.11	3.23
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	24,720,591.28	0.26
C7	机械、设备、仪表	808,543,687.59	8.42
C8	医药、生物制品	725,787,675.02	7.55
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	433,163,404.84	4.51
F	交通运输、仓储业	321,760,233.80	3.35
G	信息技术业	227,990,508.52	2.37
H	批发和零售贸易	798,293,499.74	8.31
I	金融、保险业	479,956,194.11	5.00
J	房地产业	86,400,000.00	0.90
K	社会服务业	46,414,890.56	0.48
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	467,856,677.88	4.87
	合计	6,304,424,547.84	65.61

8.3 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	600519	贵州茅台	6,672,137	725,261,291.90	7.55
2	002024	苏宁电器	34,972,944	626,365,427.04	6.52
3	600415	小商品城	6,403,527	351,425,561.76	3.66
4	601186	中国铁建	33,738,143	338,730,955.72	3.53
5	000869	张 裕A	6,587,938	319,514,993.00	3.33
6	000792	盐湖钾肥	4,766,526	270,643,346.28	2.82
7	600036	招商银行	21,794,283	265,018,481.28	2.76
8	002007	华兰生物	6,197,471	238,602,633.50	2.48
9	601766	中国南车	50,449,685	217,438,142.35	2.26
10	600267	海正药业	14,442,193	215,766,363.42	2.25

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于汇添富基金管理有限公司网站www.99fund.com网站的年度报告/半年度报告正文。

8.4 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	601088	中国神华	462,341,529.77	1.71
2	600005	武钢股份	404,382,400.47	1.49
3	601939	建设银行	399,034,708.78	1.47
4	601808	中海油服	355,967,723.94	1.31
5	601186	中国铁建	318,788,686.95	1.18
6	600415	小商品城	317,536,889.60	1.17
7	601766	中国南车	264,259,333.39	0.98
8	601166	兴业银行	260,560,205.97	0.96
9	600267	海正药业	214,734,026.00	0.79
10	600748	上实发展