普丰证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008年12月31日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司　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27日

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。

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。

普华永道中天会计师事务所注册会计师对本基金出具了“无保留意见”的审计报告。

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	基金普丰
交易代码	184693
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999-07-14
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	至2014年7月14日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999-07-30

2.2 基金产品说明

投资目标	导入指数化投资概念，增加投资广度，分散投资风险，同时贯彻绩优、成长的选股原则。通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合，实现风险与收益的有效平衡，力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合，在进一步分散风险的同时，积极投资绩优股和成长股，将基金财产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和优化组合投资部分，力争在降低风险的同时，实现基金财产增值。

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		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程国洪	蒋松云
	联系电话	0755-82021186	010-66105799
	电子邮箱	ph@mail.phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	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.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

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	2006年
本期已实现收益	17,813,334.47	3,704,837,736.05	1,573,492,760.60
本期利润	-3,516,364,830.21	5,280,062,333.13	2,751,655,363.03
加权平均基金份额本期利润	-1.1721	1.7600	0.9172
本期基金份额净值增长率	-47.17%	108.14%	97.32%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.0356	1.1728	0.3829
期末基金资产净值	2,893,343,370.55	9,448,708,200.76	5,503,645,867.63
期末基金份额净值	0.9644	3.1496	1.8345

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）表中的“期末”均指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

（3）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（例如，封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-6.46%	4.16%	-	-	-	-
过去六个月	-16.53%	3.56%	-	-	-	-
过去一年	-47.17%	3.85%	-	-	-	-
过去三年	116.99%	3.45%	-	-	-	-
过去五年	107.73%	2.98%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	152.94%	2.55%	-	-	-	-

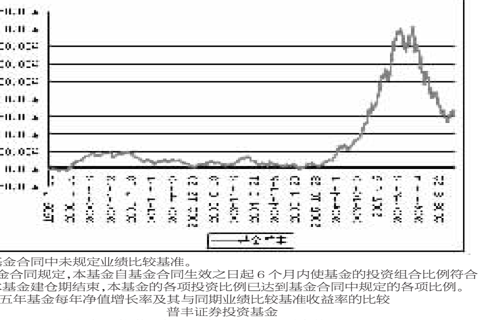
注：基金合同中未规定业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

普丰证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（1999年7月14日至2008年12月31日）



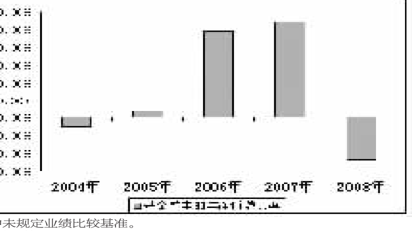
注：（1）基金合同中未规定业绩比较基准。

（2）按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至本基金建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年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

普丰证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：基金合同中未规定业绩比较基准。

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	10.130	3,039,000,000.00	-	3,039,000,000.00	2008年4月1日每10份分配3.000元；2008年4月15日每10份分配4.000元；2008年4月25日每10份分配3.130元
2007年	4.450	1,335,000,000.00	-	1,335,000,000.00	2007年4月3日每10份分配3.450元；2007年10月16日每10份分配1.000元
2006年	0.300	90,000,000.00	-	90,000,000.00	2006年11月24日每10份分配0.300元
合计	14.880	4,464,000,000.00	-	4,464,000,000.00	-

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

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、欧利盛金融集团（Eurizon Financial Group）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币，后于2001年9月完成增资扩股，增至15,000万元人民币。公司目前管理两只封闭式基金、十只开放式基金和六只社保组合。经过10年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面具备积累了丰富经验。伴随着中国证券市场的发展壮大，面对中国入世后的机遇和挑战，身处中国基金业高速发展的历史时刻，鹏华基金管理有限公司将在进一步提高基金管理水平、完善市场服务体系、新业务开发、国际合作等多方面加快步伐，努力进取，继续诚实信用、勤勉尽责地为广大基金投资者服务，为中国基金业的健康发展做出应有贡献。

4.1.2 基金经理简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈鹏	本基金基金经理	2008-08-14	-	5	陈鹏，国籍中国，硕士，5年证券从业经验，自2008年8月起担任普丰基金基金经理。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员，2006年5月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，2007年3月起担任价值优势基金（LOF）基金经理助理，2007年8月起担任鹏华行业成长基金基金经理。陈鹏先生具备基金从业资格。
高晓琴	本基金基金经理	2007-08-01	2008-10-11	8	高晓琴，国籍中国，经济学硕士，8年证券从业经验。曾在长城证券有限责任公司研究所任商贸旅游行业研究员、交通运输行业研究员、宏观策略部经理。2005年5月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，2006年担任鹏华基金管理有限公司研究总监助理，2006年10月起担任普丰基金和行业成长基金基金经理助理，2007年8月至2008年10月任普丰基金基金经理。高晓琴女士具备基金从业资格。

注：（1）本表内的任职日期和离任日期均指公司作出决定并公告上述人员担任本基金基金经理之日；

（2）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；

（3）上述基金经理情况为截至本报告期末的信息，若其后相关情况发生变化的，本基金管理人将及时公告。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的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。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人旗下基金严格按照公平交易法规及公司相关制度的规定执行了公平交易，未发生违反公平交易规定的行为。

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

本基金管理人旗下共有12只公募基金，除鹏华货币市场基金、普天债券基金、丰收债券基金三只固定收益类基金外，其余九只基金分别为封闭式基金、股票型基金和混合型基金。上述公募基金相互间投资风格不存在相同或类似的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金未发生任何违法违规并对基金财产造成损失的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2008年年末，本基金份额净值0.9644元，基金份额净值增长率为-47.17%。同期上证指数和深圳综指分别下跌了65.39%和61.76%。

2008年，全球资本市场都经历了历史罕见的动荡，国内A股市场亦大幅下跌。本基金在上半年仓位较高，基金净值下跌幅度较大；下半年降低了仓位避免了部分的损失。鉴于市场环境恶劣，经济不确定性较大，普丰非指数部分重点投资了投资医药行业，取得了较好的效果。但是由于非指数比例在整个基金组合中所占的比例有限，效果不够明显。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2009年，国内A股市场的最大悬疑仍然是经济何时见底，最大的投资机会和风险均来源于此。我们看到，从08年年末以来，市场在国家4万亿投资计划的刺激下，信心有所恢复；同时经济在经历了2008年四季度剧烈的“去库存化”过程后，也出现反弹。国家一边积极运用财政政策，另一边大幅放松货币政策，银行贷款迅猛增长。我们认为，以上的现象是否预示着我国经济正在走出谷底，仍有待未来观察。

展望后市，我们认为经过09年初以来的上涨，当前多数股票的股价已经反映了经济即将走出谷底的预期，如果未来3个月的经济数据不支持这一判断，市场可能将出现一定的调整；如果经济确实走出谷底，那么市场仍有上行空间。但后市上涨到一定水平后，市场可能陷入震荡，等待新的信息引导。

鉴于这种情况，在投资策略上，我们将偏重于防守，重点寻找业绩增长确定和政策受益明显的公司。待经济形势更为明朗之后，考虑再是否增加周期性股票的配置。在新的一年中，本基金一定勤勉尽职，精选个股，力争为基金持有人创造良好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

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》的相关规定，本公司成立长期停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。职责分工、专业胜任能力和相关工作经历要求如下：

基金经理：基金管理部负责人和相关基金经理参与估值小组的日常工作，主要参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定；相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验，熟悉相关法规和估值方法。

行业研究员：行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究，参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定，并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责；相关参与人员应当具有丰富的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法规和估值方法。

监察稽核部：监察稽核部参与估值流程的人员，应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改；参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验，熟悉与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法，并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

金融工程师负责估值相关数值的处理和计算，并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，具备基金绩效评估专业能力，并熟悉相关法规和估值方法。

登记结算部：登记结算部及其指派的参与人员在估值流程中的相关工作职责是参与基金组合停牌股票估值方法的确定，复核由估值小组提供的估值价格，并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现，立即向估值小组反映情况，并提出合理的调整建议。登记结算部及其指派的参与人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通，获悉的与基金估值的重大信息及时向公司及估值小组反馈。登记结算部指派的参与成员应当具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度：

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对长期停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末，本基金已实现收益为17,813,334.47元。根据《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规的规定及本基金基金合同的规定，本基金本年度收益分配比例应不低于已实现收益的90%，即16,032,001.02元。

4.7.2 本基金本报告期内共进行了3次利润分配，2008年4月1日每10份分配3.000元，分红金额为900,000,000.00元；2008年4月15日每10份分配4.000元，分红金额为1,200,000,000.00元；2008年4月25日每10份分配3.130元，分红金额为939,000,000.00元；加上2007年10月16日分红，每10份分配1.000元，分红金额为300,000,000.00元，共分配3,339,000,000.00元，占2007年度已实现收益的90.13%。

4.7.3 本基金将严格按照基金合同的规定，在本报告期结束后四个月内对基金应分配收益进行分配。

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

2008年，本基金托管人在对普丰证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2008年，普丰证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在普丰证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，普丰证券投资基金对基金份额持有人进行了三次利润分配，分配金额共计3,039,000,000.00元。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的普丰证券投资基金2008年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2009年3月20日

6 审计报告

普华永道中天会计师事务所注册会计师对本基金出具了“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：普丰证券投资基金

报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产：			
银行存款		481,042,397.81	176,937,436.83
结算备付金		1,560,766.16	8,890,175.26
存出保证金		1,098,780.49	3,499,845.00
交易性金融资产		2,407,311,318.21	9,294,218,502.74
其中：股票投资		1,371,392,006.74	7,325,306,332.71
债券投资		1,035,919,311.47	1,968,912,170.03
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		394,989.79	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	25,330,043.90
应收利息		9,445,158.89	16,428,937.17
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,900,853,411.35	9,525,304,940.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
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		-	57,491,002.78
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,159,377.61	9,569,621.19
应付托管费		631,875.53	1,913,924.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		491,137.49	4,469,541.78
应交税费		2,802,650.17	2,802,650.17
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		425,000.00	350,000.00
负债合计		7,510,040.80	76,596,740.14
所有者权益：			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润		-106,656,629.45	6,448,708,200.76
所有者权益合计		2,893,343,370.55	9,448,708,200.76
负债和所有者权益总计		2,900,853,411.35	9,525,304,940.90

注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值0.9644元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体：普丰证券投资基金

本报告期：2008年01月01日－2008年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2008年01月01日－2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日－2007年12月31日
一、收入		-3,395,271,700.24	5,530,829,279.79
1.利息收入		42,444,414.78	53,377,122.82
其中：存款利息收入		4,211,316.21	5,720,096.20
债券利息收入		37,947,641.17	47,582,594.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		285,457.40	74,432.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		96,286,266.57	3,902,162,781.72
其中：股票投资收益		64,431,726.09	3,811,402,281.14
债券投资收益		8,565,277.37	-8,234,091.64
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		755,732.36	64,771,945.80
股利收益		22,533,530.75	34,222,646.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-3,534,178,164.68	1,575,224,597.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		175,783.09	64,778.17
二、费用（以“-”号填列）		-121,093,129.97	-250,766,946.66
1. 管理人报酬	7.4.4.2.1	-60,778,040.10	-98,252,438.46
2. 托管费	7.4.4.2.2	-12,155,948.07	-19,650,487.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		-33,734,012.00	-82,028,738.62
5. 利息支出		-5,453,006.83	-46,437,242.06
其中：卖出回购金融资产支出		-5,453,006.83	-46,437,242.06
6. 其他费用		-8,972,122.97	-4,398,039.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,516,364,830.21	5,280,062,333.13
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		-3,516,364,830.21	5,280,062,333.13

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：普丰证券投资基金

本报告期：2008年01月01日－2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年01月01日－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）	3,000,000,000.00	6,448,708,200.76	9,448,708,200.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,516,364,830.21	-3,516,364,830.21
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-3,039,000,000.00	-3,039,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-106,656,629.45	2,893,343,370.55

项目	上年度可比期间 2007年01月01日－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）	3,000,000,000.00	2,503,645,867.63	5,503,645,867.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,280,062,333.13	5,280,062,333.13
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-1,335,000,000.00	-1,335,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	6,448,708,200.76	9,448,708,200.76

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计除会计估计变更外与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，2008年9月16日之前按停牌前最后交易日的收盘价估值；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”），本基金自2008年9月16日起采用《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”对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述“指数收益法”的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

根据中国证券监督管理委员会《指导意见》的规定，鹏华基金管理有限公司经与本基金托管人协商一致后，决定自2008年9月16日起（含该日）对本基金所涉及投资品种的估值方法按照《指导意见》进行调整。调整结果如下：

金额单位：人民币元

调整时间	股票代码	股票名称	原估值价	新估值价	对基金资产净值的影响（%）	对基金当期损益的影响
2008年9月16日	600001	邯郸钢铁	3.76	3.22	-0.01	-379,037.88
	600096	云天化	61.60	30.10	-0.14	-4,291,906.50
	600357	承德钒钛	5.50	4.81	-0.01	-159,065.70
	600900	长江电力	14.35	7.85	-0.48	-14,317,582.50
	000709	唐钢股份	4.55	4.09	-0.01	-295,660.86
	000792	盐湖钾肥	86.92	65.12	-0.19	-5,605,979.00

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》规定，基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金发起人、基金管理人的股东
欧利盛金融集团（Eurizon Financial Group）	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
方正证券有限责任公司（“方正证券”）	基金发起人
安徽国元信托投资有限责任公司（“安徽国元信托”）	基金发起人
安信信托投资股份有限公司	基金发起人

7.4.3.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日－2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日－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
国信证券	2,868,025,939.49	29.09%	5,796,907,703.06	21.15%

7.4.4.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日－2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日－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
国信证券	446,467.67	2.09%	-	-

7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日－2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日－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
国信证券	935,098.04	1.05%	-	-

7.4.4.1.4 债券回购交易

本基金2008、2007年未通过关联方发生债券回购交易。

7.4.4.1.5 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01月01日－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
国信证券	2,408,441.50	29.09%	257,558.14	52.48%

关联方名称	上年度可比期间 2007年01月01日－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
国信证券	4,681,868.13	21.29%	736,578.81	16.54%

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金＝买（卖）成交金额×1‰－买（卖）经手费－买（卖）证管费

深圳证券交易所的交易佣金＝买（卖）成交金额×1‰－买（卖）经手费

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年01月01日－2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日－2007年12月31日
当期应支付的管理费	60,778,040.10	98,252,438.46
其中：当期已支付	57,618,662.49	88,682,817.27
期末未支付	3,159,377.61	9,569,621.19

注：支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.25%，逐日计提，按月支付。日管理费＝前一日基金资产净值×1.25%÷当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年01月01日－2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日－2007年12月31日
当期应支付的托管费	12,155,948.07	19,650,487.68
其中：当期已支付	11,524,072.54	17,736,563.46
期末未支付	631,875.53	1,913,924.22

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.4.3 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	本期 2008年01月01日－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
工商银行	-	569,435,249.83	-	-	-	-

注：（1）本基金2007年没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

（2）与关联方之间通过银行间市场进行的债券(含回购)交易，该类交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期 2008年01月01日－2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日－2007年12月31日
期初持有的基金份额	3,750,000.00	3,750,000.00
期间认购总份额	-	-
期间申购／买入总份额	-	-
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	3,750,000.00	3,750,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1250%	0.1250%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.4.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2008年12月31日		上年度末 2007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
国信证券	15,000,000.00	0.5000%	15,000,000.00	0.5000%
安徽国元信托	3,750,000.00	0.1250%	3,750,000.00	0.1250%
方正证券	1,875,000.00	0.0625%	1,875,000.00	0.0625%

注：（1）安徽国元信托与方正证券为本基金发起人。

（2）关联方投资本基金为基金发行期间按统一认购费率认购。

7.4.4.5 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01月01日－2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日－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
工商银行	481,042,397.81	4,131,604.08	176,937,436.83	5,257,650.10

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股／张）	总金额
本期 2008年01月01日－2008年12月31日					
国信证券	126011	08石化债	配售	35,630	3,563,000.00
国信证券	126011	08石化债	网下申购	657,330	65,733,000.00
国信证券	112005	08万科G1	配售	1,141	114,100.00
国信证券	112006	08万科G2	配售	857	85,700.00
国信证券、方正证券	601898	中煤能源	网上申购	794,000	13,363,020.00
国信证券	601186	中国铁建	网上申购	1,235,000	11,213,800.00
上年度可比期间 2007年01月01日－2007年12月31日					
国信证券	010711	07国债11	招标	1,000,000	99,950,000.00
国信证券	126005	07武钢债	配售	46,480	4,648,000.00
国信证券	126005	07武钢债	网上申购	371,000	37,100,000.00
方正证券	002136	安纳达	网上申购	4,000	32,320.00
方正证券	601002	晋亿实业	网下申购	392,671	1,672,778.46
方正证券	601002	晋亿实业	网上申购	235,000	1,001,100.00
国信证券	601166	兴业银行	网下申购	1,232,000	19,687,360.00
方正证券	601318	中国平安	网下申购	786,324	26,577,751.20
方正证券	601318	中国平安	网上申购	254,000	8,585,200.00
方正证券	601328	交通银行	网上申购	1,216,000	9,606,400.00
方正证券	601169	北京银行	网上申购	850,000	10,625,000.00
国信证券、方正证券	601939	建设银行	网下申购	948,224	6,116,044.80
国信证券、方正证券	601939	建设银行	网上申购	2,000,000	12,900,000.00
国信证券	601857	中国石油	网下申购	675,747	11,284,974.90
国信证券	601857	中国石油	网上申购	631,000	10,537,700.00
国信证券	601390	中国中铁	网上申购	2,075,000	9,960,000.00
国信证券	601808	中海油服	网下申购	132,632	1,787,879.36
国信证券	601808	中海油服	网上申购	131,000	1,765,880.00
国信证券	002142	宁波银行	网下申购	693,100	6,376,520.00
国信证券	601919	中国远洋	网上申购	800,000	6,784,000.00
国信证券	601008	连云港	网上申购	122,000	607,560.00
方正证券	601866	中海集运	网上申购	1,073,000	7,103,260.00
方正证券	002187	广百股份	网上申购	11,000	128,480.00
方正证券	002187	广百股份	网下申购	19,759	230,785.12
国信证券	601088	中国神华	网下申购	604,368	22,355,572.32
国信证券	601088	中国神华	网上申购	283,000	10,468,170.00

注：方正证券为本基金发起人。

7.4.5 期末（2008年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发／增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
600169	太原重工	2008-12-31	2009-12-29	非公开发行流通受限	12.67	12.68	1,000,000	12,670,000.00	12,680,000.00

注：截至本报告期末2008年12月31日止，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：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
600741	巴士股份	2008-12-30	公告重大事项	3.20	2009-01-05	3.44	480,799	1,859,610.56	1,538,556.80
600886	国投电力	2008-12-09	公告重大事项	9.13	2009-03-04	10.04	2,338,066	18,221,504.51	21,346,542.58
600900	长江电力	2008-05-08	公告重大事项	7.35	未知	-	2,202,705	22,331,275.69	16,189,881.75
601918	国投新集	2008-12-09	公告重大事项	7.55	2009-02-27	8.31	152,269	1,096,921.67	1,149,630.95
000517	*ST成功	2006-03-03	未按时披露信息	2.00	未知	-	101	1,064.27	202.00
000625	长安汽车	2008-10-10	公告重大事项	3.67	2009-02-16	4.04	269,169	2,649,039.11	987,850.23
000652	泰达股份	2008-12-30	公告重大事项	5.33	2009-01-20	5.28	420,509	3,685,736.34	2,241,312.97
000776	S延边路	2006-10-20	股改	10.55	未知	-	100	268.54	1,055.00
000792	盐湖钾肥	2008-06-26	公告重大事项	56.78	2008-12-26	78.23	257,155	6,570,427.50	14,601,260.90

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自2008年12月26日复牌至2008年12月31日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于2008年12月31日继续采用指数收益法估值，2009年1月5日根据该股票复牌后的市场交易特征，对该股票采用估值日所在交易所的收盘价进行估值，当日收盘价为51.33元。该股票于2009年1月8日打开跌停板，当日的收盘价为每股37.99元。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末2008年12月31日止，本基金没有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，也没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	1,371,392,006.74	47.28
	其中：股票	1,371,392,006.74	47.28
2	固定收益投资	1,035,919,311.47	35.71
	其中：债券	1,035,919,311.47	35.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	394,989.79	0.01
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	482,603,163.97	16.64
6	其他资产	10,543,939.38	0.36
7	合计	2,900,853,411.35	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资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	3,698,659.50	0.13
B	采掘业	105,664,888.71	3.65
C	制造业	283,619,789.95	9.80
C0	食品、饮料	47,591,259.97	1.64
C1	纺织、服装、皮毛	6,514,791.02	0.23
C2	木材、家具	459,570.54	0.02
C3	造纸、印刷	3,638,632.90	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	36,890,400.57	1.28
C5	电子	3,049,119.08	0.11
C6	金属、非金属	90,794,231.03	3.14
C7	机械、设备、仪表	76,487,362.34	2.64
C8	医药、生物制品	13,953,531.29	0.48
C99	其他制造业	4,240,891.21	0.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	50,945,362.34	1.76
E	建筑业	21,438,746.06	0.74
F	交通运输、仓储业	74,305,658.40	2.57
G	信息技术业	37,401,430.18	1.29
H	批发和零售贸易	33,275,851.83	1.15
I	金融、保险业	267,864,275.20	9.26
J	房地产业	60,758,402.55	2.10
K	社会服务业	16,271,160.40	0.56
L	传播与文化产业	4,110,900.65	0.14
M	综合类	24,103,260.97	0.83
	合计	983,458,386.74	33.99

8.2.2 积极投资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	-	-
C	制造业	179,124,188.44	6.19
C0	食品、饮料	18,676,000.00	0.65
C1	纺织、服装、皮毛	3,185,575.42	0.11
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	992,000.00	0.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	26,430,892.00	0.91
C7	机械、设备、仪表	16,123,187.50	0.56
C8	医药、生物制品	113,716,533.52	3.93
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,187,790.60	0.66
E	建筑业	8,032,000.00	0.28
F	交通运输、仓储业	11,497,499.68	0.40
G	信息技术业	460,100.32	0.02
H	批发和零售贸易	9,412,016.20	0.33
I	金融、保险业	76,052,990.30	2.63
J	房地产业	41,459,584.50	1.43
K	社会服务业	42,707,449.96	1.48
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	387,933,620.00	13.41

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资与指数投资的各前五名投资明细

8.3.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	3,622,432	44,048,773.12	1.52
2	600030	中信证券	1,951,424	35,067,089.28	1.21
3	601318	中国平安	1,101,729	29,294,974.11	1.01
4	600016	民生银行	6,860,763	27,923,305.41	0.97
5	600000	浦发银行	2,078,430	27,539,197.50	0.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限网站http://www.phfund.com.cn的年度报告正文。

8.3.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600518	康美药业	5,200,000	47,372,000.00	1.64
2	000069	华侨城A	5,212,522	42,638,429.96	1.47
3	600812	华北制药	7,009,096	42,545,212.72	1.47
4	600016	民生银行	10,049,746	40,902,466.22	1.41
5	000012	南玻A	3,100,000	26,350,000.00	0.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限网站http://www.phfund.com.cn的年度报告正文。

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	600123	兰花科创	382,194,167.07	4.04
2	601318	中国平安	265,087,470.22	2.81
3	600016	民生银行	130,562,208.74	1.38
4	601006	大秦铁路	124,721,680.01	1.32
5	601939	建设银行	121,147,343.69	1.28
6	000629	攀钢钢钒	112,865,467.71	1.19
7	000002	万科A	103,711,983.33	1.10
8	000012	南玻A	102,050,357.95	1.08
9	601166	兴业银行	101,072,066.73	1.07
10	600887	伊利股份	95,693,620.59	1.01
11	600036	招商银行	90,457,797.91	0.96
12	600518	康美药业	81,208,230.26	0.86
13	601628	中国人寿	80,680,611.95	0.85
14	600030	中信证券	80,651,699.17	0.85
15	000858	五粮液	73,385,499.36	0.78
16	600100	同方股份	70,534,616.17	0.75
17	601601	中国太保	67,830,956.71	0.72
18	601088	中国神华	65,343,521.98	0.69
19	600812	华北制药	63,961,960.65	0.68
20	601857	中国石油	59,863,975.86	0.63

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	000002	万科A	314,579,083.70	3.33
2	600123	兰花科创	280,915,003.13	2.97
3	000709	唐钢股份	268,869,865.27	2.85
4	601006	大秦铁路	258,520,097.46	2.74
5	000629	攀钢钢钒	221,974,837.22	2.35
6	600150	中国船舶	202,749,493.78	2.15
7	601919	中国远洋	164,120,173.83	1.74
8	600518	康美药业	157,656,678.50	1.67
9	000527	美的电器	146,221,966.43	1.55
10	601166	兴业银行	144,118,790.92	1.53
11	601318	中国平安	133,419,666.03	1.41
12	600028	中国石化	126,585,105.17	1.34
13	600031	三一重工	122,947,434.89	1.30
14	601390	中国中铁	98,253,918.93	1.04
15	600069	银鸽投资	93,193,114.41	0.99
16	600019	宝钢股份	91,053,362.71	0.96
17	600030	中信证券	89,320,665.20	0.95
18	601939	建设银行	83,704,444.63	0.89
19	600887	伊利股份	77,194,641.46	0.82
20	601088	中国神华	76,978,138.53	0.81

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,745,209,890.97
卖出股票的收入（成交）总额	6,179,148,241.04

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	196,810,692.80	6.80
2	央行票据	97,940,000.00	3.39
3	金融债券	739,924,000.00	25.57
	其中：政策性金融债	739,924,000.00	25.57
4	企业债券	1,094,704.97	0.04
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	149,913.70	0.01
7	其他	-	-
8	合计	1,035,919,311.47	35.80

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	080215	08国开15	3,000,000	335,430,000.00	11.59
2	080219	08国开19	1,500,000	154,695,000.00	5.35
3	010210	02国债⑽	1,196,720	120,629,376.00	4.17
4	080225	08国开25	1,000,000	102,150,000.00	3.53
5	050207	05国开07	1,000,000	100,750,000.00	3.48

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	031007	阿胶EJC1	45,349	394,989.79	0.01

注：上述权证为本基金本报告期末持有的全部权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

8.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,098,780.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,445,158.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,543,939.38

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	125528	柳工转债	149,913.70	0.01

8.9.5 期末指数投资及积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资及积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

单位：份

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
61,026	49,159.37	1,494,068,391.00	49.80%	1,505,931,609.00	50.20%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	170,619,371.00	5.69%
2	中国人寿保险股份有限公司	167,173,494.00	5.57%
3	UBS AG	99,248,527.00	3.31%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	87,605,889.00	2.92%
5	全国社保基金六零二组合	86,144,559.00	2.87%
6	中国人民财产保险股份有限公司	71,653,159.00	2.39%
7	全国社保基金六零一组合	58,659,407.00	1.96%
8	全国社保基金六零四组合	53,128,368.00	1.77%
9	全国社保基金一零九组合	44,316,269.00	1.48%
10	中国平安保险（集团）股份有限公司	41,620,893.00	1.39%

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

10.2.1 本基金管理人的重大人事变动情况

（1）经本公司第三届董事会第二十六次会议审议通过，同意孙煜扬先生辞去本公司总经理职务，同意由邓召明先生担任本公司总经理。上述变更事项已经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]122号文核准并于2008年2月1日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

（2）经本公司第三届董事会第三十次会议审议通过，同意聘请曹毅先生担任本公司副总经理。上述变更事项已经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1015号文核准并于2008年8月16日在《证券时报》公告。

（3）经本公司董事会审议通过，殷克胜先生、于波先生不再担任本公司副总经理职务。上述变更事项已按有关规定向相关监管部门报备并于2008年8月9日在《证券时报》公告。

（4）因本公司第三届董事会任期届满，经2008年第一次临时股东会会议审议通过，由何如先生、胡继之先生、孙煜扬先生、Francis Candylaftis先生、Ciro Beffi先生、史际春先生、李相启先生、宋泓先生、张新民先生担任第四届董事会董事，其中史际春先生、李相启先生、宋泓先生、张新民先生为独立董事。第三届董事会董事孙枫先生及独立董事郝珠江先生、方兆本先生、柳青先生、黄世忠先生不再继续担任公司董事职务。本公司已就上述变更事项依法向监管部门备案，详见2008年10月9日《证券时报》公告及随后更新的招募说明书。

（5）经本公司第三届董事会第三十四次会议审议通过，同意聘请高阳先生担任本公司副总经理。上述变更事项已经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1335号文核准并于2008年12月5日在《证券时报》公告。

（6）因本公司第三届董事会届满到期，经本公司董事会会议选举，一致同意由何如先生担任第四届董事会董事长；孙枫先生不再担任本公司董事长。上述变更事项已经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1408号文核准并于2008年12月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

10.2.2 本基金托管人——中国工商银行股份有限公司的基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司常规审计费用100,000.00元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为10年。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 股票交易

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	215,416,287.11	2.18%	183,101.97	2.21%	
长城证券	1	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	
国泰君安	2	1,506,726,905.04	15.28%	1,280,712.10	15.47%	
国信证券	3	2,868,025,939.49	29.09%	2,408,441.50	29.09%	
国元证券	3	222,136,118.67	2.25%	185,809.95	2.24%	
华创证券	1	-	-	-	-	
红塔证券	1	172,835,527.10	1.75%	146,909.17	1.77%	
宏源证券	1	-	-	-	-	
联合证券	1	203,176,676.82	2.06%	172,698.25	2.09%	
平安证券	2	200,197,006.99	2.03%	162,662.61	1.96%	
申银万国	2	2,460,376,679.16	24.95%	2,091,309.85	25.26%	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	147,635,543.63	1.50%	125,487.38	1.52%	
招商证券	1	1,590,831,806.63	16.13%	1,292,564.36	15.61%	
中山证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	227,969,823.06	2.31%	192,913.65	2.33%	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	44,432,742.52	0.45%	37,767.74	0.46%	
合计	27	9,859,761,056.22	100.00%	8,280,378.53	100.00%	

10.7.2 权证交易

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	
国泰君安	2	7,606,592.69	35.58%	-	-	
国信证券	3	446,467.67	2.09%	-	-	
国元证券	3	-	-	-	-	
华创证券	1	-	-	-	-	
红塔证券	1	-	-	-	-	
宏源证券	1	-	-	-	-	
联合证券	1	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申银万国	2	13,327,392.97	62.33%	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中山证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	
合计	27	21,380,453.33	100.00%	-	-	

10.7.3 债券交易

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	
国泰君安	2	6,809,475.70	7.62%	-	-	
国信证券	3	935,098.04	1.05%	-	-	
国元证券	3	9,166,412.00	10.25%	-	-	
华创证券	1	-	-	-	-	
红塔证券	1	-	-	-	-	
宏源证券	1	-	-	-	-	
联合证券	1	62,336,025.70	69.72%	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申银万国	2	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	10,156,285.80	11.36%	-	-	
中山证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	
合计	27	89,403,297.24	100.00%	-	-	

10.7.4 债券回购交易

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	占当期债券回购交易成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	
国泰君安	2	289,000,000.00	50.79%	-	-	
国信证券	3	-	-	-	-	
国元证券	3	-	-	-	-	
华创证券	1	-	-	-	-	
红塔证券	1	-	-	-	-	
宏源证券	1	-	-	-	-	
联合证券	1	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申银万国	2	280,000,000.00	49.21%	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中山证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	
合计	27	569,000,000.00	100.00%	-	-	

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定的证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，分别向国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、华创证券经纪有限责任公司（由汉唐证券有限责任公司更名）、财通证券经纪有限责任公司、长城证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司和东海证券有限责任公司、中山证券有限责任公司租用交易单元作为基金专用交易单元，并从1999年7月开始陆续使用。上述交易单元在本报告期内未发生变化。