

万家增强收益债券型证券投资基金 2008年年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司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责任。

§2 基金简介

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name) and 基金管理人 (Fund Manager). Includes details like 万家债券 (Wanjia Bond) and 万家基金管理有限公司 (Wanjia Fund Management Co., Ltd.).

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 4 columns: 项目 (Item), 2008年 (2008), 2007年 (2007), 2006年 (2006). Shows financial metrics like 本期利润总额 (Current Period Profit) and 基金份额净值 (Net Asset Value per Share).

§4 基金管理人及基金托管人

Table with 3 columns: 项目 (Item), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian). Lists names and contact info for 万家基金管理有限公司 and 中国农业银行股份有限公司.

§5 投资组合报告

5.1 报告期末本基金投资组合资产配置情况
本基金本报告期末投资组合资产配置情况如下：
债券资产 910,895,700.12 占基金资产净值的比例 92.58%

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
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(%)

5.3 报告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
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(%)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
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(%)

5.5 报告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指期货投资明细
序号 期货代码 期货名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细
序号 衍生品代码 衍生品名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

2008年12月31日

基金管理人: 万家基金管理有限公司 基金托管人: 中国农业银行股份有限公司 送出日期: 2009年3月28日

平,市场的降息预期大为减弱。我们认为,2009年适度宽松的货币政策基调不会改变,因此仍有较大的可能出现降息,但降息1.26%的利率水平上新一轮降息周期的最低点对于判断利率是否保持平稳方面具有很重要的参考价值。

年初以来收益率出现的大大上升可能说明了本债券投资组合的收益率偏低,这对于债券投资产生了不利的影响,尽管未来债券市场面临利率保持平稳、资金充裕的支持因素。利率水平处于低位,CPI很可能见底回升,宏观经济增长有望走向复苏,债券投资的重点在于获取超额收益并平衡风险与收益水平。

本基金整体上将采取积极投资策略,控制组合久期的债券投资策略,在大类资产配置上将更加积极、适度参与股票投资。一些具有较好特征的股票及其组合是我们关注的重点。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

2008年12月31日

基金管理人: 万家基金管理有限公司 基金托管人: 中国农业银行股份有限公司 送出日期: 2009年3月28日

平,市场的降息预期大为减弱。我们认为,2009年适度宽松的货币政策基调不会改变,因此仍有较大的可能出现降息,但降息1.26%的利率水平上新一轮降息周期的最低点对于判断利率是否保持平稳方面具有很重要的参考价值。

年初以来收益率出现的大大上升可能说明了本债券投资组合的收益率偏低,这对于债券投资产生了不利的影响,尽管未来债券市场面临利率保持平稳、资金充裕的支持因素。利率水平处于低位,CPI很可能见底回升,宏观经济增长有望走向复苏,债券投资的重点在于获取超额收益并平衡风险与收益水平。

本基金整体上将采取积极投资策略,控制组合久期的债券投资策略,在大类资产配置上将更加积极、适度参与股票投资。一些具有较好特征的股票及其组合是我们关注的重点。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人尚未就估值品种的定价服务签署任何协议。

5.2 托管人对报告期内本基金估值程序遵循情况、净值计算、利润分配等情况的说明
根据基金合同约定:“本基金收益按年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%”,2008年本基金全年实现可分配收益84,740,117.63元,2008年12月26日,本基金实施分红,每10份基金份额派发0.6元,共向持有人派发红利43,298,433.30元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值流程各方人员(或小组)的资质分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,估值委员会主要由中管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成,估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关工作经验,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和检查的责任。
会计师事务所
会计师事务所对基金管理人所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理不参与和决定基金估值。

3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计卖出金额 (Total Amount Sold This Period), 占期初基金资产净值比例(%) (Percentage of Beginning Net Asset Value). Lists various stocks like 兰花科创, 宝钢股份, etc.

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额 (Total Cost of Purchased Stocks), 卖出股票收入(成交)总额 (Total Income from Sold Stocks). Shows values in RMB Yuan.

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Lists bond types like 国债, 央行票据, etc.

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 本基金投资的前十名证券中,不存在投资于超出基金合同规定投资范围之外的股票。

8.9.3 本基金资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial No.), 名称 (Name), 金额 (Amount). Shows asset composition like 存出保证金, 应收债券利息, etc.

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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

Table with 3 columns: 持有人户数(户) (Number of Holders), 户均持有的基金份额 (Average Shares per Holder), 持有人结构 (Holder Structure). Shows institutional and individual investor percentages.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目 (Item), 持有份额总数(份) (Total Shares Held), 占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares). Shows shares held by management and staff.