

富国天益价值证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接 D90 版)

2. 报告期内累计卖出金额占期初基金资产净值比例超过 2% 的股票明细

序号	证券代码	证券名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值比例(%)
1	002024	苏宁电器	1,011,493,228.25	1691
2	600519	贵州茅台	784,269,391.22	1311
3	600565	海澜控股	588,222,143.65	1000
4	600009	上海机场	575,289,943.60	961
5	600028	中国石化	555,787,212.07	929
6	600143	金发科技	517,373,392.80	865
7	600036	招商银行	493,212,929.59	808
8	600016	民生银行	424,148,720.23	709
9	600030	中信证券	36,436,195.35	661
10	000538	云南白药	346,448,292.22	579
11	600875	东方电气	335,380,641.83	560
12	000792	盐湖钾肥	239,136,653.13	400
13	000039	中集集团	225,462,460.94	383
14	600048	保利地产	230,317,154.65	385
15	601318	中国平安	230,219,687.04	386
16	600379	大商股份	212,548,201.78	355
17	601398	工商银行	193,576,856.69	326
18	600271	航天信息	194,624,397.79	329
19	600563	烟台万润	154,392,490.22	259
20	600000	浦发银行	149,567,882.22	250
21	000899	张裕 A	147,680,700.26	247
22	600066	宇通客车	143,657,382.28	248
23	002099	豫子鸟	142,920,643.23	239
24	600312	平安路桥	137,824,546.33	230
25	002076	晋美特	137,689,725.31	230
26	600399	烟台万华	135,081,715.44	227
27	600563	盐湖钾肥	120,234,829.26	211
28	000402	金鼎新	128,438,142.29	211
29	000028	中国石化	122,758,981.71	206

3. 整个报告期内买入股票的成本总额为 9,439,293,092.25 元; 卖出股票的收入总额为 10,280,111,279.68 元。

(五)、债券投资组合

序号	品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债		0.01
2	金融债		0.25
3	可转债	27,949,076.91	0.25
4	企业债	19,940,194.00	0.21
5	央行票据	288,390,000.00	2.15
合计		38,578,270.10	251

(六)、债券投资的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	07央票 139	288,390,000.00	2.15
2	普阳转债	27,949,076.10	0.21
3	06上国债	19,940,194.00	0.15
4			
5			

(七)、投资组合报告附注

1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票中不存在在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 截至本报告期末, 本基金的其他资产项目包括:

序号	其他资产项目	金额(元)
1	存出保证金	1,740,567.69
2	应收证券清算款	
3	应收利息	934,707.03
4	应收股利	
5	应收申购款	572,289,546.64
合计	其他资产项目合计	574,974,821.36

4. 截至本报告期末, 本基金未持有处于转股期的可转债。

5. 持有权证信息情况:

本基金报告期内持有权证及报告期末权证投资情况如下:

标的证券	权证代码	权证名称	持有原因	持有数量	成本总额	期末数量
日照港	580015	日照 CWB1	买债送配	217,140	468,160.91	217,140
上海汽车	580016	上汽 CWB1	买债送配	1,000,138	8,680,284.31	1,000,138
伊利股份	580009	伊利 CWB1	股权激励	466,980	0.00	0
华泰债 A	030101	华泰 H2C1	股权激励	142,622	0.00	0
烟台万华	580005	万华 H2B1	主动持有	980,000	22,044,503.88	0
深高速	580014	深高 CWB1	买债送配	156,744	667,278.89	0
云天化	580012	云天 CWB1	买债送配	280,854	1,910,330.62	0

6. 本基金报告期内及本报告期末均未持有资产支持证券。

7. 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项可能存在尾差。

八、基金份额持有人户数、持有人结构

基金份额持有人户数	平均每户持有基金份额	机构投资者持有的基金份额	机构投资者持有的基金份额比例	个人投资者持有的基金份额	个人投资者持有的基金份额比例
393,022	32,275.29	607,936,749.88	5.17%	11,146,179,088.14	94.83%

2. 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有开放式基金份额的总额(份)	占本基金总份额比例(%)
基金管理公司基金从业人员	5,268,624.73	0.0443%

九、基金份额变动

基金合同生效日基金总份额	期初基金总份额	期末基金总份额	报告期基金份额净增加额	报告期基金份额总增加额
1,033,708,022.89	3,913,982,500.89	11,753,114,948.02	15,869,433,760.12	7,850,307,412.89

十、重大事件提示

1. 本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

2. 基金托管人交通银行于 2007 年 10 月 19 日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》, 交通银行资产托管部原总经理阮虹同志不再担任资产托管部总经理职务, 目前暂由资产托管部谷静芬副经理主持资产托管工作。

具体内容参阅在 2007 年 10 月 19 日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

2007 年 12 月 21 日, 交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷静芬基金托管行业高管任职资格的公告》, 谷静芬同志担任交通银行资产托管部总经理, 主持资产托管工作。

具体内容参阅在 2007 年 12 月 21 日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于谷静芬基金托管行业高管任职资格的公告》。

本报告期本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

3. 本年度无涉及基金管理人、基金资产、基金托管人、基金托管业务的诉讼。

4. 本报告期本基金投资策略未发生变更。

5. 本报告期本基金总共进行了 1 次收益分配, 情况如下:

分红公告日	权益登记日	每 10 份基金份额应分派金额(元)	收益分配金额(元)	
本年度 1 次分红	2007-11-02	2007-11-06	20548	6,359,415,094.89

对上次分红本公司于相应日期在指定报刊公司网站上公告。

6. 报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所, 本年度基金支付给审计机构安永大华会计师事务所的报酬为 10 万元人民币, 其已为本基金管理人提供审计服务的连续年限为 5 年。

7. 报告期内基金管理人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

8. 富国天益价值证券投资基金在本报告期内新增了安信证券一个席位, 分别向申银万国证券股份有限公司增加了 2 个基金专用交易席位, 向海通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司和中国国际金融有限公司、光大证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司和恒泰证券股份有限公司七家证券经营机构各租用了 1 个基金专用交易席位, 总共租用了 11 个交易席位, 我公司对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的, 有关专用交易席位的 2007 年全年交易情况见下表:

交易席位	股票	债券	回购	权证	佣金(元)
银河证券	954,328,751.94	4,088,607.38			783,083.68
光大证券	2,465,729,197.94			879,407.3	2,013,687.48
海通证券	4,067,774,904.74	2,294,568.89			3,335,589.46
中金公司	4,800,285,536.69	7,929,725.01			3,662,949.76
申银万国	3,843,894,531.70	1,646,465.10			3,127,642.74
东方证券	1,123,381,782.77				824,684.41
华泰证券	288,790,442.03				222,176.25
安信证券	2,171,915,538.22	11,367,961.90			1,780,967.27
合计	19,556,449,656.76	27,917,379.1			22,474,838.19

汉兴证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接 D91 版)

2. 报告期内累计卖出前 20 名的股票明细

序号	证券代码	证券名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值比例(%)
1	600298	安琪酵母	343,016,421.31	753
2	000829	天奇控股	320,861,691.97	705
3	600312	平安路桥	213,490,652.68	469
4	600028	中国石化	178,987,021.07	393
5	600143	金发科技	177,041,739.79	389
6	600066	宇通客车	152,142,224.32	334
7	600050	中国联通	119,506,115.20	262
8	600227	大雁股份	103,775,838.24	228
9	600036	招商银行	99,107,503.29	218
10	600030	中信证券	91,828,436.32	202
11	600389	鲁商高速	91,139,582.55	200
12	600331	宏达股份	75,808,814.18	167
13	600436	丹邦股份	75,239,320.61	165
14	600900	长江电力	72,520,687.91	159
15	000978	桂林旅游	72,322,768.24	159
16	000402	金鼎新	69,661,397.14	153
17	600019	宝钢股份	67,143,072.02	147
18	600000	浦发银行	61,956,850.45	136
19	000039	中集集团	60,523,308.15	133
20	600009	上海机场	54,318,494.58	119

3. 整个报告期内买入股票的成本总额为 2,023,800,506.72 元; 卖出股票的收入总额为 3,628,056,543.46 元。

(五)、债券投资组合

序号	品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	200,621,422.40	8.97
2	政策性金融债	437,443,600.00	5.40
3	可转债		
4	企业债	10,500,022.00	0.13
5	央行票据	476,372,000.00	5.89
合计		1,650,675,466.10	20.38

(六)、债券投资的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	21国债09	200,621,422.40	2.49
2	99国债08	188,632,466.40	2.33
3	07央行票据02	96,240,000.00	1.21
4	07央行票据31	96,990,000.00	1.20
5	21国债03	88,970,389.80	1.10

(七)、投资组合报告附注

1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2. 截至 2007 年 12 月 31 日, 本基金的其他资产项目包括:

其他资产项目 金 额(元)

存出保证金	1,050,804.88
应收利息	20,591,444.94
应收证券交易清算款	
应收股利	
待摊费用	
其他应收款	
合计	21,642,249.72

4. 截至本报告期末, 本基金未持有处于转股期的可转债。

5. 本基金报告期内及本报告期末均未持有资产支持证券。

6. 本基金报告期内持有权证及报告期末权证投资情况如下:

标的证券	权证代码	权证名称	持有原因	持有数量	成本总额	期末数量
上海汽车	580016	上汽 CWB1	买债送配	525,464	4,569,019.28	525,464
云天化	580012	云天 CWB1	买债送配	280,854	1,910,330.62	0
烟台万华	580005	万华 H2B1	主动持有	1,180,937	29,983,045.18	0
武钢股份	580013	武钢 CWB1	买债送配	2,998,949	7,363,919.27	0
深高速	580014	深高 CWB1	买债送配	156,744	667,278.89	0
日照港	580015	日照 CWB1	买债送配	172,690	364,372.33	0

7. 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项可能存在尾差。

八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

基金份额持有人户数	平均每户持有基金份额	机构投资者持有的基金份额	机构投资者持有的基金份额比例	个人投资者持有的基金份额	个人投资者持有的基金份额比例
94,722	31,671.63	1,335,480,296	44.52%	1,664,519,704	55.48%

2. 基金前十名持有人情况(封闭式)

序号	持有人	持有份额(份)	持有份额占总额比例(%)
1	中国人寿保险股份有限公司	291,804,465	9.73
2	中国人寿保险(集团)公司	182,689,881.70	6.25
3	太平人寿保险有限公司	67,622,508	2.02
4	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	59,457,397	1.98
5	中国平安保险(集团)股份有限公司	59,049,868	1.97
6	中国平安人寿保险股份有限公司	42,999,913	1.43
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司	41,906,864	1.40
8	中信证券-招商银行-中管理财 2 号集合资产管理计划	40,340,700	1.34
9	中国太平洋保险(集团)有限公司	38,040,393	1.27
10	全国社保基金六零三期组合	32,378,394	1.08

九、重大事件提示

1. 报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

2. 基金托管人交通银行于 2007 年 10 月 19 日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》, 交通银行资产托管部原总经理阮虹同志不再担任资产托管部总经理职务, 目前暂由资产托管部谷静芬副经理主持资产托管工作。

具体内容参阅在 2007 年 10 月 19 日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

2007 年 12 月 21 日, 交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷静芬基金托管行业高管任职资格的公告》, 谷静芬同志担任交通银行资产托管部总经理, 主持资产托管工作。

汉盛证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接 D92 版)

2. 报告期内累计买入价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	证券名称	证券数量(股)	证券市值(元)	市值占基金净值比例(%)
1	600660	福耀玻璃	13,807,012	495,119,450.32	6.52
2	600000	浦发银行	8,903,916	470,126,764.80	6.11
3	600036	招商银行	11,700,000	463,671,000.00	6.11
4	000002	万科 A	10,500,000	302,820,000.00	3.99
5	002007	华兰生物	5,120,500	272,871,445.00	3.60
6	600248	宁波华翔	9,162,151	239,132,141.10	3.15
7	600963	岳阳纸业	9,000,000	215,010,000.00	2.83
8	600519	贵州茅台	712,944	163,977,120.00	2.16
9	000829	天奇控股	6,084,950	160,399,282.00	2.11
10	600426	华鲁恒升	6,000,000	159,000,000.00	2.09

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读刊登于富国基金管理有限公司网站上的年度报告正文。

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1. 报告期内累计买入价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例(%)
1	600015	华夏银行	298,726,957.50	7.25
2	600030	中信证券	293,396,120.42	7.12
3	600050	中国联通	181,464,055.22	4.41
4	601318	中国平安	179,087,243.79	4.35
5	600019	宝钢股份	171,422,411.48	4.16
6	600123	兰花科创	126,195,096.39	3.06
7	000338	潍柴动力	114,260,969.22	2.77
8	600963	岳阳纸业	99,900,000.00	2.43
9	601006	大秦铁路	97,907,911.19	2.38
10	600016	民生银行	93,643,930.93	2.27
11	600036	招商银行	88,108,915.35	2.14
12	600406	国电南瑞	85,365,587.47	2.07
13	600208	新湖中宝	80,300,000.00	1.95
14	000898	鞍钢股份	79,404,515.67	1.93
15	600000	浦发银行	74,586,677.15	1.81
16	600009	上海机场	72,957,783.16	1.77
17	600673	武钢股份	70,000,000.00	1.70
18	600005	民生银行	69,812,155.20	1.69
19	600693	东百集团	60,672,664.88	1.47
20	600408	安泰集团	55,900,000.00	1.36

2. 报告期内累计卖出价值前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例(%)
1	600030	中信证券	582,666,140.58	14.14
2	600000	浦发银行	487,830,597.14	11.84
3	601318	中国平安	325,111,212.09	7.89
4	600036	招商银行	302,634,048.42	7.36
5	000895	双汇发展	266,960,263.53	6.48
6	600015	华夏银行	241,967,416.05	5.87