富兰克林国海中国收益证券投资基金 2007 年年度报告摘要

（上接 D84 版）

2007年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	30,912,743.21	–	–	–	30,912,743.21
结算备付金	2,418,396.46	–	–	–	2,418,396.46
存出保证金	98,780.49	–	–	872,446.38	971,226.87
交易性金融资产	110,674,400.00	273,598,000.00	461,981,431.48	1,432,674,159.21	2,278,927,990.69
应收利息	–	–	–	10,655,976.28	10,655,976.28
应收申购款	–	–	–	661,577.19	661,577.19
资产总计	144,104,320.16	273,598,000.00	461,981,431.48	1,444,864,159.06	2,324,547,910.70
负债					
应付赎回款	–	–	–	18,615,499.67	18,615,499.67
应付管理人报酬	–	–	–	2,668,209.53	2,668,209.53
应付托管费	–	–	–	483,371.28	483,371.28
应付交易费用	–	–	–	977,892.22	977,892.22
其他负债	–	–	–	863,861.93	863,861.93
负债总计	–	–	–	23,608,834.63	23,608,834.63
利率敏感度缺口	144,104,320.16	273,598,000.00	461,981,431.48	1,421,255,324.43	2,300,939,076.07
2006年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	64,041,019.47	–	–	–	64,041,019.47
结算备付金	105,741.79	–	–	–	105,741.79
存出保证金	98780.49	–	–	500,000.00	598,780.49
交易性金融资产	210,849.32	–	137,623,540.65	247,525,968.27	385,360,358.24
应收证券清算款	–	–	–	128,025.46	128,025.46
应收利息	–	–	–	1,581,509.94	1,581,509.94
应收申购款	–	–	–	126,080.00	126,080.00
资产总计	64,456,391.07	0.00	137,623,540.65	249,861,583.67	451,941,515.39
负债					
卖出回购金融资产	60,000,000.00				60,000,000.00
应付赎回款	–	–		1,283,885.67	1,283,885.67
应付管理人报酬	–	–		436,966.24	436,966.24
应付托管费	–	–		79,160.54	79,160.54
应付交易费用	–	–		32,881.81	32,881.81
应付利息		–	–	33,428.55	33,428.55
其他负债	–	–		823,316.59	823,316.59
负债总计	60,000,000.00	–	–	2,689,639.40	62,689,639.40
利率敏感度缺口	4,456,391.07	–	137,623,540.65	247,171,944.27	389,251,875.99

于2007年12月31日，若市场利率下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约2,470,317元(2006年:11,181.72元)；反之，若市场利率上升25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约2,470,317元(2006年:11,181.72元)。

③汇率风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无汇率风险。

26、首次执行新准则

如附注2所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关比较数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，并已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的2006年1月1日、2006年12月31日和2007年6月30日的所有者权益，以及2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

	2006年1月1日所有者权益	2006年度净损益	2006年12月31日所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	527,097,520.27	60,241,044.10	389,251,875.99
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注2(b))	–	116,346,361.74	–
按企业会计准则列报的金额	527,097,520.27	176,587,405.84	389,251,875.99
	2007年1月1日所有者权益	2007年1月1日至2007年6月30日止期间净损益(未经审计)	2007年6月30日所有者权益(未经审计)
按原会计准则和制度列报的金额	389,251,875.99	175,775,565.37	2,986,847,005.99
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注2(b))	–	(19,781,804.48)	–
按企业会计准则列报的金额	389,251,875.99	155,993,760.89	2,986,847,005.99

27 资产负债表日后事项

本基金无资产负债表日后事项需要披露

七、投资组合报告(基金会计)

(一)本报告期末基金资产组合情况

项目名称	项目市值（人民币元）	占基金资产总值比例
股 票	1,432,674,159.21	61.63%
债 券	846,253,831.48	36.41%
权证	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00
银行存款及清算备付金合计	33,331,139.67	1.43%
其他资产	12,288,780.34	0.53%
合 计	2,324,547,910.70	100.00%

（二）本报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	97,095,157.29	4.22%
C 制造业	630,128,665.02	27.38%
C0 食品、饮料	125,006,276.50	5.43%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	46,991,000.00	2.04%
C5 电子	27,627,022.10	1.20%
C6 金属、非金属	202,796,012.14	8.81%
C7 机械、设备、仪表	195,240,000.00	8.49%
C8 医药、生物制品	32,468,354.28	1.41%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	38,980,000.00	1.69%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	81,972,000.00	3.56%
G 信息技术业	45,572,112.30	1.98%
H 批发和零售贸易	93,897,100.65	4.08%
I 金融、保险业	306,147,123.95	13.31%
J 房地产业	112,077,000.00	4.87%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	26,805,000.00	1.16%
合计	1,432,674,159.21	62.26%

（三）本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

股票代码	股票名称	数 量（股数）	市 值（人民币元）	市值占净值%
000568	泸州老窖	1,300,259	95,569,036.50	4.1535%
002048	宁波华翔	3,600,000	93,960,000.00	4.0836%
002024	苏宁电器	1,306,849	93,897,100.65	4.0808%
600030	中信证券	1,000,000	89,270,000.00	3.8797%
600036	招商银行	2,200,000	87,186,000.00	3.7891%
000002	万 科 A	3,000,000	86,520,000.00	3.7602%
600000	浦发银行	1,400,000	73,920,000.00	3.2126%
000898	鞍钢股份	2,335,123	70,474,012.14	3.0628%
601006	大秦铁路	2,700,000	69,174,000.00	3.0063%
600348	国阳新能	1,200,009	64,224,481.68	2.7912%
600582	天地科技	1,200,000	61,656,000.00	2.6796%
600596	新安股份	700,000	46,991,000.00	2.0423%
000960	锡业股份	700,000	46,242,000.00	2.0097%
600271	航天信息	699,710	45,572,112.30	1.9806%
000401	冀东水泥	2,000,000	41,500,000.00	1.8036%
600900	长江电力	2,000,000	38,980,000.00	1.6941%
600660	福耀玻璃	1,000,000	35,860,000.00	1.5585%
601939	建设银行	3,500,143	34,476,408.55	1.4984%
601088	中国神华	501,001	32,870,675.61	1.4286%
600196	复星医药	2,199,753	32,468,354.28	1.4111%
600809	山西汾酒	799,925	29,437,240.00	1.2794%
002008	大族激光	899,903	27,627,022.10	1.2007%
600895	张江高科	1,500,000	26,805,000.00	1.1650%
600325	华发股份	700,000	25,557,000.00	1.1107%
000625	长安汽车	1,200,000	22,512,000.00	0.9784%
600031	三一重工	300,000	17,112,000.00	0.7437%
601919	中国远洋	300,000	12,798,000.00	0.5562%
601628	中国人寿	184,410	10,684,715.40	0.4644%
601318	中国平安	100,000	10,610,000.00	0.4611%
600019	宝钢股份	500,000	8,720,000.00	0.3790%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值前二十名的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比(%)
002048	宁波华翔	134,029,594.24	34.43%
600030	中信证券	112,989,152.73	29.03%
601318	中国平安	107,969,710.49	27.74%
000002	万 科 A	107,569,798.42	27.64%
600596	新安股份	92,301,571.27	23.71%
000898	鞍钢股份	87,585,775.96	22.50%
600325	华发股份	87,382,172.85	22.45%
601628	中国人寿	81,435,917.84	20.92%
600005	武钢股份	79,773,413.65	20.49%
002024	苏宁电器	74,656,494.48	19.18%
600675	中华企业	74,632,464.32	19.17%
600809	山西汾酒	72,893,295.89	18.73%
601111	中国国航	72,210,678.01	18.55%
000568	泸州老窖	70,895,525.93	18.21%
600036	招商银行	69,379,464.24	17.82%
601006	大秦铁路	67,852,475.44	17.43%
600660	福耀玻璃	66,191,558.71	17.00%
600028	中国石化	65,085,600.45	16.72%
600143	金发科技	64,733,846.46	16.63%
000401	冀东水泥	61,277,303.51	15.74%

2、累计卖出价值前二十名的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比(%)
601318	中国平安	151,841,696.37	39.01%
000983	西山煤电	124,689,420.20	32.03%
600005	武钢股份	111,255,287.50	28.58%
000002	万 科 A	110,129,634.21	28.29%
601919	中国远洋	107,412,663.28	27.59%
600028	中国石化	94,193,390.63	24.20%
600675	中华企业	93,869,264.71	24.12%
002048	宁波华翔	93,028,361.45	23.90%
600036	招商银行	89,128,745.14	22.90%
601111	中国国航	85,927,487.09	22.08%
600030	中信证券	84,964,199.36	21.83%
600900	长江电力	83,910,874.25	21.56%
600596	新安股份	83,845,720.16	21.54
601628	中国人寿	76,216,688.55	19.58
000625	长安汽车	68,819,086.54	17.68
601006	大秦铁路	67,191,659.76	17.26
600143	金发科技	64,217,922.83	16.50
000960	锡业股份	56,011,987.86	14.39
000898	鞍钢股份	55,681,409.46	14.30%
000895	双汇发展	54,495,640.76	14.00%

3、报告期内买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内买入股票总成本（人民币元）	报告期内卖出股票收入总额（人民币元）
2,663,125,897.56	2,438,069,893.97

（五）按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
交易所国债投资	152,015,278.80	6.61%
央行票据投资	319,663,000.00	13.89%
金融债券投资	297,316,000.00	12.92%
可转换债投资	77,259,552.68	3.36%
债券投资合计	846,253,831.48	36.78%

（六）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券代码	债券名称	市 值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
070181	07央行票据 81	164,152,000.00	7.1341%
070137	07央行票据 37	106,656,000.00	4.6353%
060218	06国开 18	99,390,000.00	4.3195%
070416	07农发 16	69,811,000.00	3.0340%
110026	中海转债	69,526,514.00	3.0217%

（七）投资组合报告附注

1. 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内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证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2. 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 基金其他资产的构成：

其他资产	金额（人民币元）
交易保证金	971,226.87
应收利息	10,655,976.28
应收申购款	661,577.19
合计	12,288,780.34

4. 报告期末本基金未持有资产支持证券。

5. 报告期末本基金未持有权证。

6. 报告期内本基金未主动投资股权分置改革中发行的权证。

7. 报告期末本基金未持有处于转换期的可转换债券。

八、基金份额持有人户数、持有人结构

期末基金总份额（份）	基金份额持有人总户数	户均持有份额（份）	个人持有情况		机构持有情况		我司员工持有情况	
			持有份额（份）	持有比例	持有份额（份）	持有比例	持有份额（份）	持有比例
1,776,151,025.67	72,995	24,332,508	1,540,711,150.30	86.74%	235,439,875.37	13.26%	0	0

九、基金管理公司从业人员投资基金情况披露

各类关键管理人员	期末持有基金份额（份）		占基金总份额的比例（%）	
	2007年	2006年	2007年	2006年
所有董事合计	34,006.49	69,165.80	0.0019%	0.0259%
管理层合计（总经理和副总经理）	0	0	0	0
本基金的基金经理	0	0	0	0

十、开放式基金份额变动（单位:份）

期初(合同生效日)基金份额	267,481,457.48
本期申购总份额	3,330,078,220.84
本期赎回总份额	2,076,861,107.90
本期红利再投资总份额	65,918,887.61
本期基金份额拆分增加总份额	189,533,567.64
期末基金份额	1,776,151,025.67

十、重大事件揭示

（一）本报告期内未召开基金份额持有人大会。

（二）本报告期内基金管理人发生如下重大人事变动：

1. 经公司经公司第一届董事会第二十次会议审议，同意张英辉先生辞去富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理职务，任命张惟闵先生、黄林先生共同担任富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理。(2007年3月20日公告)

2. 经公司第一届董事会第二十五次会议决议，同意张惟闵先生不再担任富兰克林国海中国收益证券投资基金（以下简称“国富收益基金”）的基金经理。现任富兰克林国海中国收益基金基金经理的黄林先生继续担任该基金的基金经理。（2007年11月22日公告）

（三）基金托管人中国工商银行资产托管业务在本报告期内未发生重大事件。（四）本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

（五）本报告期内未发生基金投资策略的改变。

（六）本基金本年度进行了一次收益分配，详见2007年8月13日中国证券报、上海证券报、证券时报关于富兰克林国海中国收益证券投资基金分红的公告。

（七）本报告期内本基金聘任的会计师事务所为普华永道会计师事务所有限公司，报告年度支付该所审计费用人民币100,000.00元。本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

（八）本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

（九）基金租用证券公司专用交易单元的有关情况

1、专用交易单元的选择标准和程序

1）选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

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，并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是：

①资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

②财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；

③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；

④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；

⑤研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2）租用基金专用交易单元的程序

①基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。

②之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系，每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

E 其他可评价的量化标准。

经过评价，对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

③交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

2、报告期内证券公司基金专用交易单元的租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计8个：国海证券2个、中金公司、广发证券、申银万国证券、国泰君安证券、海通证券和国金证券各1个。

3、报告期内租用各证券公司席位进行的股票成交量统计

证券公司名称	租用席位数量	股票成交金额（人民币元）	占股票总成交金额的比率	佣金（人民元）	占佣金总量比率
国海证券	2	1,433,557,757.37	28.30%	1,151,279.35	28.16%
中金公司	1	1,030,856,018.09	20.35%	843,554.84	20.64%
申银万国证券	1	1,072,863,497.05	21.18%	876,714.58	21.45%
国泰君安	1	868,255,672.71	17.14%	679,417.44	16.62%
海通证券	1	617,295,306.83	12.19%	502,255.85	12.29%
国金证券	1	42,196,248.50	0.83%	34,600.77	0.85%
招商证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广发证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%

4、报告期内租用各证券公司席位进行的债券和债券回购成交量统计

证券公司名称	债券成交金额（人民币元）	占债券总成交金额的比率	回购成交金额（人民币元）	占回购总成交金额的比率
国海证券	91,629,451.10	14.53%	770,700,000.00	45.88%
中金公司	161,650,576.10	25.63%	74,000,000.00	4.41%
申银万国证券	293,253,682.40	46.50%	110,000,000.00	6.55%
国泰君安	9,545,541.80	1.51%	0.00	0.00%
海通证券	74,607,267.80	11.83%	725,000,000.00	43.16%
国金证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广发证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%

5、报告期内未租用各证券公司席位进行权证交易。

（十）其他在报告期内发生的重大事件

1、2007年1月9日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于增加注册资本的公告”

2、2007年1月15日发布 “富兰克林国海中国收益证券投资基金更新招募说明书（2007年第1号）”

3、2007年1月19日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2006年第四季度报告”

4、2007年2月2日发布“关于通过中信建投证券网上交易系统申购国海富兰克林旗下开放式基金实行费率优惠的公告”

5、2007年3月20日发布 “国海富兰克林基金管理有限公司关于变更富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理的公告”

6、2007年3月30日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2006年年度报告及摘要”

7、2007年4月20日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2007年第一季度报告”

8、2007年5月10日发布 “富兰克林国海中国收益证券投资基金开展基金份额拆分及持续销售和修改基金合同公告”

9、2007年5月15日发布 “关于富兰克林国海中国收益证券投资基金申购费用及申购份额的计算采用外扣法的公告”

10、2007年5月15日发布“关于富兰克林国海中国收益证券投资基金新增代销机构的公告”

11、2007年5月16日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金基金份额拆分比例公告”

12、2007年5月30日发布“关于富兰克林国海中国收益证券投资基金新增代销机构的公告”

13、2007年6月19日发布“关于通过中国工商银行股份有限公司“金融@家”个人网上银行申购富兰克林国海中国收益证券投资基金实行费率优惠的公告”

14、2007年7月2日发布 “关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金执行新会计准则相关事宜的公告(仅在公司网站上公告)”

15、2007年7月14日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金更新招募说明书及其摘要（2007年第2号）”

16、2007年7月19日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2007年第二季度报告”

17、2007年7月27日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于开通中信银行、昆明市商业银行、长沙市商业银行网上交易业务支付的公告”

18、2007年8月7日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金第六次分红预告”

19、2007年8月13日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金第六次分红公告”

20、2007年8月17日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于开通中国农业银行金穗卡基金网上交易业务支付的公告”

21、2007年8月27日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2007年半年度报告及摘要”

22、2007年9月15日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于开通建设银行龙卡基金网上交易支付及其推广活动的公告”

23、2007年9月15日发布“关于台风韦帕所可能造成的影响致广大投资者的紧急通知”

24、2007年9月29日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于修改富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同的公告”

25、2007年10月24日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2007年第三季度报告”

26、2007年11月22日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于基金经理变更的公告”

27、2007年12月6日发布“国海富兰克林基金管理有限公司运用公司固有资金进行基金投资的公告”

28、2007年12月20日发布“关于通过中国农业银行开办国海富兰克林基金管理有限公司旗下开放式基金定期定额投资业务的公告”

29、2007年12月28日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于增加注册资本的公告”

注:以上事项已在中国证券报、上海证券报、证券时报上分别进行了公告，并同时在公司网站上披露。

（十一）报告期后至年报披露日期间发生的重大事件

1、本基金管理人于2008年1月4日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于聘任金哲非女士担任总经理的公告”

2、本基金于2008年1月15日对外发布了“富兰克林国海中国收益证券投资基金更新招募说明书及其摘要(2008年第1号)”

3、2008年1月16日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告”

4、2008年1月22日发布“富兰克林国海中国收益证券投资基金2007年第四季度报告”

5、2008年2月27日发布“国海富兰克林基金管理有限公司关于变更公司章程的公告”

6、2008年2月29日发布 “关于通过兴业银行股份有限公司开办富兰克林国海中国收益证券投资基金定期定额投资业务的公告”

注:以上事项已在中国证券报、上海证券报、证券时报上分别进行了公告，并同时在公司网站上披露。

国海富兰克林基金管理有限公司

2008年3月27日

富国天博创新主题股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

（上接 96 版）

④由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行间同业利率计息。

由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入明细如下：

年 份	银行存款余额（元）	年 份	银行存款利息收入（元）
2007-04-26	3,137,823.98	2007年1月1日至2007年4月26日	100,391.48
2006-12-31	140,472,460.78	2006年度	282,990.45

（3）关联方持有基金份额

A.基金管理人所持有的本基金份额

项目名称	基金份额（份）
报告期期初持有基金份额	21,904,143.00
报告期间买入基金份额	0
报告期间卖出基金份额	0
报告期末持有基金份额	21,904,143.00

B.基金托管人、基金管理人的主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

股东名称	2007-04-26		2006-12-31	
	持有份额（份）	占基金总份额的比例（%）	持有份额（份）	占基金总份额的比例（%）
海通证券股份有限公司	1,250,000.00	0.25	1,250,000.00	0.25
天同证券有限责任公司	1,250,000.00	0.25	1,250,000.00	0.25

（4）关联方转让本基金管理公司股权情况

基金管理人的股东及其控制的机构本期未转让本基金管理公司股权。

4、期末流通受限的基金资产

A.截至2007年4月26日，本基金流通受限制的基金资产明细如下：

序号	证券名称	受限原因	数量（股）	成本（元）	市价（元）	估值方法	申购确定日	上市日	可流通日
1	三维通信	新股网下中签	26,071	238,549.65	545,666.03	均价	2007-2-5	2007-2-15	2007-5-15
2	紫鑫药业	新股网下中签	40,188	384,197.28	818,629.56	均价	2007-2-12	2007-3-2	2007-6-4
3	康强电子	新股网下中签	52,367	581,273.70	1,276,183.79	均价	2007-2-12	2007-3-2	2007-6-4
4	兴业银行	新股网下中签	133,000	2,125,340.00	4,237,380.00	均价	2007-1-26	2007-2-5	2007-5-8
5	中国平安	新股网下中签	130,536	4,412,116.80	7,575,004.08	均价	2007-2-14	2007-3-1	2007-6-1

B.截止2007年4月26日，因股权分置改革暂时停牌的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	数量（股）	投资成本(元)	期末估值单价（元）	期末估值总额(元)	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价（元）
000895	双汇发展	799,957	10,385,659.89	31.02	24,814,666.14	2006-5-31	2007-6-29	57.88

八、富国天博基金投资组合报告(2007年12月31日)

（报告期末为2007年12月31日，报告期间为2007年4月27日至2007年12月31日）

（一）、基金资产组合情况

截至2007年12月31日，富国天博创新主题股票型证券投资基金资产净值为15,824,227,649.63元，基金份额净值为1.1273元，基金份额累计净值为3.7072元。其资产组合情况如下：

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	股 票	14,270,757,401.40	89.40
2	债 券	664,507,685.20	4.16
3	权 证	4,130,431.91	0.03
4	银行存款及结算备付金	971,585,470.39	6.09
5	其他资产	51,210,399.30	0.32
	合 计	15,962,191,388.20	100.00

（二）、2007年12月31日按行业分类的股票投资组合

序号	证券板块名称	市 值（元）	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	827,355.90	0.01
2	B 采掘业	1,138,419,168.23	7.19
3	C 制造业	5,373,460,946.34	33.96
	C0 食品、饮料	967,256,347.08	6.11
	C1 纺织、服装、皮毛		
	C2 木材、家具		
	C3 造纸、印刷	4,353,018.00	0.03
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,114,964,098.25	7.05
	C5 电子	13,940,709.08	0.09
	C6 金属、非金属	1,986,753,900.67	12.56
	C7 机械、设备、仪表	955,812,317.11	6.04
	C8 医药、生物制品	330,380,556.15	2.09
	C9 其他制造业		
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	241,158,840.12	1.52
5	E 建筑业	44,810,482.95	0.28
6	F 交通运输、仓储业	884,390,505.78	5.59
7	G 信息技术业	826,288,685.34	5.22
8	H 批发和零售贸易	1,041,482,697.47	6.58
9	I 金融、保险业	3,788,340,242.60	23.94
10	J 房地产业	869,533,358.94	5.49
11	K 社会服务业	61,713,698.77	0.39
12	L 传播与文化产业	331,418.96	0.00
13	M 综合类		
	合计:	14,270,757,401.40	90.18

（三）、截至2007年12月31日前十名股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	30,002,486	1,188,998,520.18	7.51
2	600519	贵州茅台	3,208,760	738,014,800.00	4.66
3	002024	苏宁电器	10,271,188	737,984,857.80	4.66
4	600030	中信证券	6,757,062	603,202,924.74	3.81
5	600019	宝钢股份	32,454,618	566,008,537.92	3.58
6	600271	航天信息	7,009,612	456,536,029.56	2.89
7	601318	中国平安	4,200,000	445,620,000.00	2.82
8	601398	工商银行	50,042,160	406,842,760.80	2.57
9	600596	新安股份	6,060,317	406,829,080.21	2.57
10	000983	西山煤电	5,485,635	348,173,253.45	2.20

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

（四）、报告期内（2007年4月27日－2007年12月31日）股票投资组合的重大变动

1、报告期内（2007年4月27日－2007年12月31日）累计买入价值前20名的股票明细

序号	证券代码	证券名称	累计买入金额（元）	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	1,374,962,304.14	8.69
2	600030	中信证券	747,551,495.19	4.72
3	000002	万 科 A	491,310,140.64	3.10
4	600019	宝钢股份	472,750,914.39	2.99
5	002024	苏宁电器	471,709,715.75	2.98
6	600309	烟台万华	424,809,800.35	2.68
7	601398	工商银行	417,545,003.07	2.64
8	600219	南山铝业	389,204,004.01	2.46
9	601628	中国人寿	379,360,873.52	2.40
10	600900	长江电力	346,589,685.57	2.19
11	600519	贵州茅台	333,161,283.20	2.11
12	601318	中国平安	329,269,413.99	2.08
13	600596	新安股份	285,149,562.96	1.80
14	000063	中兴通讯	270,984,667.33	1.71
15	000024	招商地产	259,730,831.25	1.64
16	600000	浦发银行	254,200,766.87	1.61
17	600009	上海机场	252,903,333.49	1.60
18	600271	航天信息	239,364,581.20	1.51
19	600028	中国石化	230,665,415.13	1.46
20	000338	潍柴动力	217,860,652.52	1.38

2.报告期内（2007年4月27日－2007年12月31日）累计卖出价值前20名的股票明细

序号	证券代码	证券名称	累计卖出金额（元）	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	592,326,496.48	3.74
2	600030	中信证券	316,757,786.23	2.00
3	000002	万 科 A	234,415,469.91