兴业全球视野股票型证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人:兴业全球人寿基金管理有限公司　基金托管人:兴业银行股份有限公司　送出日期:2008年8月28日

【重要提示】

本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。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。

本基金的托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本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。

本报告财务资料未经审计。本报告期自2008年1月1日起至2008年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金名称:兴业全球视野股票型证券投资基金

基金简称:兴业全球

基金交易代码:340006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2006年9月20日

报告期末基金份额总额:2,989,595,745.75份

(二)投资目标:本基金以全球视野的角度,主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司,追求当期收益实现与长期资本增值。

投资策略:本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略。以全球视野的角度挖掘中国证券市场投资的历史机遇,采取"自上而下"的方法,定性与定量研究相结合,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。

投资范围:本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合范围为:股票65%-95%,债券0%-30%,权证0%-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不少于5%。

业绩比较基准:80%×中信标普300指数+15%×中信标普国债指数+5%×同业存款利率

风险收益特征:较高风险、较高收益

(三)基金管理人:兴业全球人寿基金管理有限公司

注册地址:上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址:上海市张杨路500号时代广场20楼

邮政编码:200122

法定代表人:郑苏芬

信息披露负责人:杜建新

联系电话:021-58368998

传真:021-58368858

电子信箱:dujx@xyfunds.com.cn

(四)基金托管人:兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路154号

办公地址:福州市湖东路154号

资产托管部办公地址:上海江宁路168号兴业大厦20楼

邮政编码:200041

法定代表人:高建平

信息披露负责人:张志永

联系电话:021-62677777-212004

传真:021-62159217

电子信箱:zhangzhy@cib.com.cn

(五)信息披露指定报纸:中国证券报、上海证券报、证券时报

登载半年度报告正文的基金管理人互联网网址:www.xyfunds.com.cn

基金半年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人的办公场所

(六)其他有关资料

注册登记机构:兴业全球人寿基金管理有限公司

办公地址:上海市张杨路500号时代广场20楼

审计基金资产的会计师事务所:安永大华会计师事务所

办公地址:上海市长乐路989号

二、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标(未经审计)

单位:人民币元

序号	项目	金额
1	本期利润	-2,752,462,977.04
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	900,020,883.93
3	加权平均份额本期利润	-1.0426
4	期末可供分配利润	4,799,178,805.52
5	期末可供分配份额利润	1.6053
6	期末基金资产净值	7,788,774,551.27
7	期末基金份额净值	2.6053
8	加权平均净值利润率	-32.66%
9	本期份额净值增长率	-27.47%
10	份额累计净值增长率	160.53%

【提示】

1、以上财务指标中"本期"指2008年1月1日至2008年6月30日止期间。

2、上述财务指标采用的计算公式,详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第1号<主要财务指标的计算及披露>》及相关规定。

3、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:开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)基金净值表现

1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
过去一个月	-13.92%	2.18%	-17.53%	2.69%	3.61%	-0.51%
过去三个月	-14.34%	2.16%	-20.58%	2.60%	6.24%	-0.44%
过去六个月	-27.47%	2.04%	-38.46%	2.42%	10.99%	-0.38%
过去一年	-0.17%	1.86%	-18.47%	2.08%	18.30%	-0.22%
自基金合同成立起至今	160.53%	1.84%	82.13%	1.95%	78.40%	-0.11%

2、基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年9月20日——2008年6月30日)

注:按照《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金应自2006年9月20日成立起六个月内,达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围,目前本基金符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

三、管理人报告

(一)基金管理人情况

兴业全球人寿基金管理有限公司(原名:兴业基金管理有限公司)是经中国证监会(证监基字[2003]100号文)批准,于2003年9月30日成立。2008年1月,公司重大事项变更申请经中国证监会批准,2008年4月完成相关变更手续。变更完成后,公司注册资本为人民币1.2亿元,其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%,全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。

截止2008年6月30日,公司旗下管理着五只基金,分别为兴业可转债混合型证券投资基金、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金和兴业社会责任股票型证券投资基金。

(二)基金经理介绍

董承非先生,1977年生,理工硕士。历任兴业全球人寿基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。现任本基金基金经理。

(三)本报告期遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其配套法规、《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

(四)本报告期内的基金的投资策略和业绩表现

1、行情回顾及分析

对于A股的投资者而言,07年和08年都是相当难忘的两年。"2007年上半年的中国股市继续大涨,超出了很多投资者的预期。上半年上证综指涨幅42.8%,在国际主要股指中涨幅第一。"这句话是本基金在07年中报的第一句话。而与之对应的是2008年上半年A股的跌幅高达48%,和越南股市一起位居全球08年上半年跌幅前两位。仅仅一年的时间间隔,A股呈现出冰火两重天。

整个A股在上半年呈现出普跌的态势,从行业上看,有色,汽车,房地产跌幅居前。医药,采掘,农业表现相对较好。

2、基金运作情况回顾

本基金08年上半年净值跌幅27.11%,幅度也是比较的大。虽然从07年年末开始,本基金就开始对市场比较谨慎,有意识的对基金的股票仓位进行了控制,但是上半年市场和本基金净值的跌幅还是超过原来的预想。

3、市场展望及投资策略分析

截至到现在,经过近十个月极其惨烈的下跌,应该说目前A股市场虽然局部存在一些高估,但是市场整体估值水平而言已经进入了合理的水平。但是连续下跌给投资者心理带来的消极影响需要时间化解,市场真正的反转可能需要时间。

环顾周边环境,整个全球经济都面临较大的不确定性。美国由于次级债最先暴露了问题,在政府不断给经济打气的情况下,经济增长要比原来预期的要好,但是扩张的货币和财政政策带来的是日益严重的通货膨胀;欧洲和日本经济体最先意识到通货膨胀的风险,实行了较为从紧的经济政策,通货膨胀的问题是得到了控制,但是却出现了经济较大幅度的下滑。经济增长和通货膨胀之间的矛盾是目前全球面临的共同问题。

虽然近期大宗原材料(油,农产品等)从高位有较大幅度的回落。但是由于供需矛盾之间供应占据了主动地位,在这个位置上希望这些大宗原材料的价格继续大幅度的回落是不太现实的。

对于中国,大宗原材料的回落暂时缓解了通货膨胀的压力。面临经济增速放缓的风险,政府的态度要比以前更加的主动,可以采用更加积极的经济政策。但是至少两个问题现在还看不到确定的答案:一是在目前的国际环境下,政府能否找到有效的经济手段;第二是如果中国经济增长的方式没有得到改善,在实行积极的经济政策后是否会出现又一轮的通货膨胀。

现在A股的投资面临一个很尴尬的境地:一个方面是跌了这么多,照理应该有很多的投资机会;另一个方面由于宏观的不确定性依然存在,在考虑具体投资品种时却发现很难找到具有较高安全边际的标的。

展望后市,我们的操作策略是"积极的心态,谨慎的选股"。不再将仓位放在第一要务,用更加积极的眼光去看市场,看经济;但是在具体挑选品种上,要非常的注重内在价值和安全边际。

(五)公平交易制度执行情况

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。本报告期内,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

本基金与本基金管理人旗下的兴业社会责任股票型证券投资基金同属股票型基金,但目前兴业社会责任基金成立不满六个月,仍处于建仓期,所以暂无法对上述两只基金的投资业绩进行比较。

四、基金托管人报告

本托管人依据《兴业全球视野股票型证券投资基金基金合同》与《兴业全球视野股票型证券投资基金托管协议》,自2006年9月20日起托管兴业全球视野股票型证券投资基金(以下称本基金)的全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,由于市场波动原因,个别交易日出现异常情况。本托管人及时对基金管理人进行了书面或电话的风险提示,基金管理人及时作了反馈,并在规定期限内对投资组合进行了调整。

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

兴业银行股份有限公司资产托管部

2008年8月26日

五、财务会计报告

(一)半年度会计报表(未经审计)

1、资产负债表

单位:人民币元

项目	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
资产			
银行存款		1,165,924,936.49	1,249,693,077.17
结算备付金		5,749,931.68	3,189,056.89
存出保证金		4,756,554.74	3,750,000.00
交易性金融资产		6,805,027,731.27	7,165,672,676.79
其中:股票投资		5,485,728,732.17	6,673,635,262.30
债券投资		1,319,298,999.10	492,037,414.49
衍生金融资产		9,101,988.00	—
应收证券请算款		139,000,000.00	49,949,285.80
应收利息		11,904,664.48	7,963,318.44
应收股利		282,098.70	—
应收申购款		6,496,898.24	28,796,320.91
资产总计		8,148,244,803.60	8,509,013,736.00
负债及持有人权益			
负债			
应付证券请算款		331,660,950.76	16,110,818.02
应付赎回款		10,956,607.04	27,982,739.00
应付管理人报酬		10,371,959.05	10,039,006.97
应付托管费		1,728,659.85	1,673,167.82
应付交易费用		3,021,184.21	2,245,416.45
其他负债		1,730,891.42	1,676,094.99
负债合计		359,470,252.33	59,727,243.25
持有人权益			
实收基金		2,989,595,745.75	2,352,091,577.09
未分配利润		4,799,178,805.52	6,097,194,915.66
所有者权益合计		7,788,774,551.27	8,449,286,492.75
负债与持有人权益总计		8,148,244,803.60	8,509,013,736.00

2、利润表

单位:人民币元

项目	附注	2008年上半年	2007年上半年
一、收入		-2,648,248,707.84	2,519,387,142.80
1.利息收入		22,699,353.42	4,670,043.19
其中:存款利息收入		6,368,054.69	2,052,196.85
债券利息收入		15,302,744.22	2,617,846.34
买入返售金融资产收入		1,028,554.51	—
2.投资收益(损失以"-"填列)		978,963,442.48	1,681,605,810.71
其中:股票投资收益		932,723,027.21	1,606,836,867.50
债券投资收益		7,038,048.31	3,975,476.16
衍生工具收益		3,161,789.19	49,132,757.77
股利收益		36,040,577.77	21,660,709.28
3.公允价值变动收益		-3,652,483,860.97	826,981,405.38
4.其他收入		2,572,357.23	6,129,883.52
二、费用		104,214,269.20	53,824,279.02
1.管理人报酬		62,975,769.23	32,892,089.16
2.托管费		10,495,961.56	5,482,014.95
3.交易费用		28,653,772.07	14,655,847.12
4.利息支出		1,859,385.01	562,897.93
其中:卖出回购金融资产支出		1,859,385.01	562,897.93
5.其他费用		229,381.33	231,429.86
三、利润总额		-2,752,462,977.04	2,465,562,863.78

3、所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元

项目	附注	2008年上半年			2007年上半年		
		实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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)		2,352,091,577.09	6,097,194,915.66	8,449,286,492.75	2,596,467,843.33	1,097,957,220.88	3,694,425,074.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)		—	-2,752,462,977.04	-2,752,462,977.04	—	2,465,562,863.78	2,465,562,863.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		637,504,168.66	1,454,446,866.90	2,091,951,035.56	-347,296,950.83	56,964,680.66	-290,322,270.17
其中:1.基金申购款		1,389,568,234.94	3,053,378,351.52	4,442,946,586.46	1,886,804,585.36	2,227,788,495.91	4,114,593,081.27
2.基金赎回款		-752,064,066.28	-1,598,931,484.62	-2,350,995,550.90	-2,234,091,536.19	-2,170,823,815.25	-4,404,915,351.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		—	—	—	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)		2,989,595,745.75	4,799,178,805.52	7,788,774,551.27	2,249,170,892.50	3,620,484,775.32	5,869,665,667.82

(二)半年度会计报表附注(除特别标明外,金额单位为人民币元)

1、基金基本情况

兴业全球视野股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2006]149号文《关于同意兴业全球视野股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴业全球人寿基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2006年9月20日正式生效,首次设立募集规模为3,289,724,684.59份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为兴业全球人寿基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金以全球视野的角度,主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司,追求当期收益实现与长期资本增值。本基金的业绩比较基准为:80%×中信标普300指数+15%×中信标普国债指数+5%×同业存款利率。

2、会计报表编制基础及遵循企业会计准则的声明

本财务报表系按照中国财政部2006年颁布的企业会计准则及应用指南、中国证券业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会发布的相关规定而编制。

根据中国证监会发布的证监会计字[2006]23号《关于基金管理公司及证券投资基金执行<企业会计准则>的通知》,本基金自2007年7月1日起执行财政部2006年发布的《企业会计准则》。本财务报表按照《企业会计准则第38号——首次执行企业会计准则》以及其他相关规定,对要求追溯调整的项目在相关会计年度进行了追溯调整,并对财务报表进行了重新表述。

可比年度财务报表的列报方式已按照企业会计准则的要求进行了重述。

按新会计准则调整原会计准则的所有者权益及净收益

项目	2007年年初所有者权益	2007年上半年净损益(未经审计)	2007年上半年末所有者权益(未经审计)
按原会计准则列报的金额	3,694,425,074.21	1,638,581,458.40	5,869,665,667.82
金融资产公允价值变动的调整数	—	826,981,405.38	—
按新会计准则列报的金额	3,694,425,074.21	2,465,562,863.78	5,869,665,667.82

3、会计政策

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与2007年7月1日起,会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

4、本报告期重大会计差错

无。

5、主要税项

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》,财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作的规定,主要税项为:

A. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,自2005年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的2‰调整为1‰。

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‰;

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。

B. 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》,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、债券的投资收益,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。

C. 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》,对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息等收入,由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]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。

6、重大关联方关系及关联交易

(1)关联方关系

企业名称	与本基金的关系
兴业全球人寿基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记机构、直销机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
兴业证券股份有限公司(以下简称"兴业证券")	基金管理人的股东、代销机构
全球人寿保险国际公司	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

关联方名称	2008年上半年		2007年上半年	
股票买卖	本期成交金额	占本期交易金额的比例	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券	1,274,992,417.10	15.41%	2,741,180,392.05	44.08%
债券买卖	本期成交金额	占本期交易金额的比例	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券	64,663,489.00	70.62%	330,558,768.25	64.15%
权证买卖	本期成交金额	占本期交易金额的比例	本期成交金额	占本期交易金额的比例
兴业证券	26,125,413.35	32.89%	111,162,449.98	42.14%
佣金	本期佣金	占本期佣金总量的比例	本期佣金	占本期佣金总量的比例
兴业证券	1,078,498.93	15.47%	2,190,529.01	43.63%

注:① 上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

② 股票交易佣金及债券现券的交易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)。证券公司不向本基金收取债券回购交易佣金,但交易的经手费和上海证券交易所证管费由本基金交纳,其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的,符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获取的服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3)与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金2008年上半年度未通过银行间同业市场与关联方进行债券(含回购)交易。

(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兴业银行股份有限公司保管,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如下:

项目	2008-06-30	2007-06-30
银行存款余额	1,165,924,936.49	637,280,842.43
	2008年上半年度	2007年上半年度
银行存款产生的利息收入	5,953,060.70	1,595,770.62

(5)基金管理人及托管人报酬

A. 基金管理人报酬——基金管理费

a. 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%/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

b. 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2008年上半年度	10,039,006.97	62,975,769.23	62,642,817.15	10,371,959.05
2007年上半年度	4,611,033.86	32,892,089.16	30,210,749.30	7,292,373.72

B. 基金托管人报酬——基金托管费

a. 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

b. 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2008年上半年度	1,673,167.82	10,495,961.56	10,440,469.53	1,728,659.85
2007年上半年度	768,505.68	5,482,014.95	5,035,125.00	1,215,395.63

(6)关联方持有基金份额

本基金的基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构于2008年上半年末及2007年上半年末均未持有本基金份额。

7、报告期末流通转让受到限制的基金资产

(1)报告期末持有的流通转让受到限制的股票如下:

a. 因认购新发或增发而于期末持有的流通受限股票

单位:人民币元

股票代码	股票名称	成功认购日(年/月/日)	可流通日(年/月/日)	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
601899	紫金矿业	2008/04/18	2008/07/25	网下新股申购	7.13	7.8	5,095,612	36,331,713.56	39,745,773.60
002223	鱼跃医疗	2008/04/10	2008/07/18	网下新股申购	9.48	20.00	19,071	180,793.08	381,420.00
002224	三力士	2008/04/17	2008/07/25	网下新股申购	9.38	13.77	18,444	173,004.72	253,973.88
002225	濮耐股份	2008/04/17	2008/07/25	网下新股申购	4.79	6.50	46,153	221,072.87	299,994.50
002227	奥特迅	2008/04/24	2008/08/06	网下新股申购	14.37	14.05	24,134	346,805.58	339,082.70
002228	合兴包装	2008/04/24	2008/08/08	网下新股申购	10.15	10.74	26,049	264,397.35	279,766.26
002229	鸿博股份	2008/04/24	2008/08/08	网下新股申购	13.88	13.58	19,853	275,559.64	269,603.74
002230	科大讯飞	2008/04/29	2008/08/12	网下新股申购	12.66	30.09	17,585	222,626.10	529,132.65
002231	奥维通信	2008/04/29	2008/08/12	网下新股申购	8.46	8.50	21,837	184,741.02	185,614.50
002232	启明信息	2008/04/29	2008/08/11	网下新股申购	9.44	12.65	23,382	220,726.08	295,782.30
002233	塔牌集团	2008/05/08	2008/08/18	网下新股申购	10.03	9.70	81,297	815,408.91	788,580.90
002235	安妮股份	2008/05/08	2008/08/18	网下新股申购	10.91	10.82	22,243	242,671.13	240,669.26
002236	大华股份	2008/05/12	2008/08/20	网下新股申购	24.24	36.00	12,573	304,769.52	452,628.00
002237	恒邦股份	2008/05/12	2008/08/20	网下新股申购	25.98	40.97	21,890	568,702.20	896,833.30
002238	天威视讯	2008/05/14	2008/08/26	网下新股申购	6.98	12.25	39,463	275,451.74	483,421.75
002239	金飞达	2008/05/14	2008/08/22	网下新股申购	9.33	8.98	26,180	244,259.40	235,096.40
002240	威华股份	2008/05/15	2008/08/25	网下新股申购	15.70	12.19	79,719	1,251,588.30	971,774.61
002241	歌尔声学	2008/05/16	2008/08/22	网下新股申购	18.78	26.84	24,635	462,645.30	661,203.40
002242	九阳股份	2008/05/20	2008/08/28	网下新股申购	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
002244	滨江集团	2008/05/21	2008/08/29	网下新股申购	20.31	15.68	129,717	2,634,552.27	2,033,962.56
002245	澳洋顺昌	2008/05/28	2008/09/05	网下新股申购	16.38	16.02	10,566	173,071.08	169,267.32
002246	北化股份	2008/05/29	2008/09/05	网下新股申购	6.95	8.22	37,754	262,390.30	310,337.88
002247	帝龙新材	2008/05/30	2008/09/12	网下新股申购	16.05	14.65	13,026	209,067.30	190,830.90
002248	华东数控	2008/06/05	2008/09/12	网下新股申购	9.80	10.97	18,001	176,409.80	197,470.97
002249	大洋电机	2008/06/10	2008/09/19	网下新股申购	25.60	24.21	29,830	763,648.00	722,184.30
002250	联化科技	2008/06/10	2008/09/19	网下新股申购	10.52	12.80	26,001	273,530.52	332,812.80
002251	步步高	2008/06/11	2008/09/19	网下新股申购	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
002252	上海莱士	2008/06/13	2008/09/23	网下新股申购	12.81	24.87	27,141	347,676.21	674,996.67
002253	川大智胜	2008/06/13	2008/09/23	网上增发新股	14.75	21.11	11,905	175,598.75	251,314.55
002254	烟台显华	2008/06/18	2008/09/25	网下新股申购	18.59	27.41	36,308	674,965.72	995,202.28
002255	海陆重工	2008/06/18	2008/09/25	网下新股申购	10.46	19.64	19,865	207,787.90	390,148.60
002256	彩虹精化	2008/06/18	2008/09/25	网下新股申购	12.56	13.33	36,032	452,561.92	480,306.56
002257	立立电子	2008/06/30	未知	网下新股申购	21.81	21.81	43,974	959,072.94	959,072.94
002258	利尔化学	2008/06/30	2008/10/08	网下新股申购	16.06	16.06	51,434	826,030.04	826,030.04
合计							6,181,304	52,371,142.13	58,839,698.94

b. 因非公开发行处于锁定期而流通受限的股票

单位:人民币元

股票代码	股票名称	成功认购日(年/月/日)	可流通日(年/月/日)	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600366	宁波韵升	2007/12/19	未知	非公开发行	8.05	5.94	5,000,000	40,250,000.00	29,700,000.00
600383	金地集团	2007/07/09	2008/07/04	非公开发行	13.00	9.07	8,000,000	104,000,000.00	72,560,000.00
600798	宁波海运	2008/01/10	未知	非公开发行	9.00	7.39	5,000,000	45,000,000.00	36,950,000.00
合计							18,000,000	189,250,000.00	139,210,000.00

注:上述该些非公开发行股票锁定期均为1年

c. 期末持有的暂时停牌的股票

单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期(年/月/日)	停牌原因	期末估值单价	复牌日期(年/月/日)	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600089	特变电工	2008/06/30	召开股东大会	14.96	2008/07/01	15.24	5,529,693	30,522,913.27	82,724,207.28
600337	美克股份	2008/06/30	召开股东大会	5.38	2008/07/01	5.36	4,433,805	53,041,175.08	23,853,870.90
600729	重庆百货	2008/06/30	召开股东大会	19.00	2008/07/01	19.05	967,437	11,360,872.72	18,381,303.00
600900	长江电力	2008/05/08	重大事项公告	14.65	未知	未知	5,000,000	74,982,744.55	73,250,000.00
000024	招商地产	2008/06/30	审核期复公告	14.94	2008/07/01	14.50	1,000,000	18,475,956.92	14,940,000.00
000628	高 工	2008/06/30	召开股东大会	19.25	2008/07/01	19.05	2,896,028	25,785,818.77	55,749,539.00
002254	烟台显华	2008/06/30	召开股东大会	27.41	2008/07/01	28.28	36,308	674,965.72	995,202.28
合计							19,863,271	214,845,447.03	269,893,122.46

(2)报告期末持有的流通转让受到限制的债券

因认购新发或增发而于期末持有的流通受限债券

单位:人民币元

债券代码	债券名称	成功认购日(年/月/日)	可流通日(年/月/日)	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额
126016	08宝钢债	2008/06/20	2008/07/04	老股东配售	76.27	75.08	475,250	36,248,007.70	35,681,770.00
合计							475,250	36,248,007.70	35,681,770.00

(3)报告期末持有的流通转让受到限制的权