

# 富国天博创新主题股票型证券投资基金

## 二 00 八年年度报告

### (摘要)

2008 年 12 月 31 日

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行)
报告送出日期:	2009 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 3 月 27 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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及其更新。

富国天博创新主题股票型证券投资基金由原汉博证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 2007 年 4 月 16 日证监基金字[2007]108 号文《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，汉博证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，并更名为“富国天博创新主题股票型证券投资基金”。自 2007 年 4 月 27 日起，汉博证券投资基金在上海证券交易所终止上市，《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》正式生效，原《汉博证券投资基金基金合同》失效。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国天博
交易代码	前端交易代码: 519035 后端交易代码: 519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 04 月 27 日
报告期末基金份额总额 (单位: 份)	12, 351, 614, 135. 89

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司, 在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上, 力争实现资本的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略, 将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普 300 指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金, 属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。

### 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	富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行)
信息披露负责人	姓名	李长伟
	联系电话	021-68597788
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	010-67595096
传真	021-68597799	010-67595853

### 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	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

	中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
--	--

### § 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（自基金合同生效日 2007 年 4 月 27 日起至 2007 年 12 月 31 日）
本期已实现收益	-2,764,201,758.78	932,888,853.76
本期利润	-7,644,487,549.22	3,126,209,260.89
加权平均基金份额本期利润	-0.5888	0.3215
本期基金份额净值增长率	-51.52%	55.53%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-0.2194	-0.0023
期末基金资产净值	6,749,850,469.71	15,824,227,649.63
期末基金份额净值	0.5465	1.1273

注：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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

#### 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	-6.04%	1.71%	-13.66%	2.40%	7.62%	-0.69%
过去六个月	-22.47%	1.86%	-27.04%	2.36%	4.57%	-0.50%
过去一年	-51.52%	2.12%	-55.10%	2.40%	3.58%	-0.28%
自基金转型日起至今	-24.60%	1.99%	-36.98%	2.19%	12.38%	-0.20%

注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于 2007 年 4 月 27 日生效。根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准 = 中信标普 300 指数 × 80% + 中信国债指数 × 15% + 同业存款利率 × 5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采

用中信国债指数。中信标普 300 指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成，样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查，能较全面地描述中国 A 股市场地总体趋势。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{中信标普 300 指数 } t / (\text{中信标普 300 指数 } t-1) - 1] + 15\% * [\text{中信国债指数 } t / (\text{中信国债指数 } t-1) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360 ;$$

其中，t=1,2,3,..., T, T 表示时间截至日；

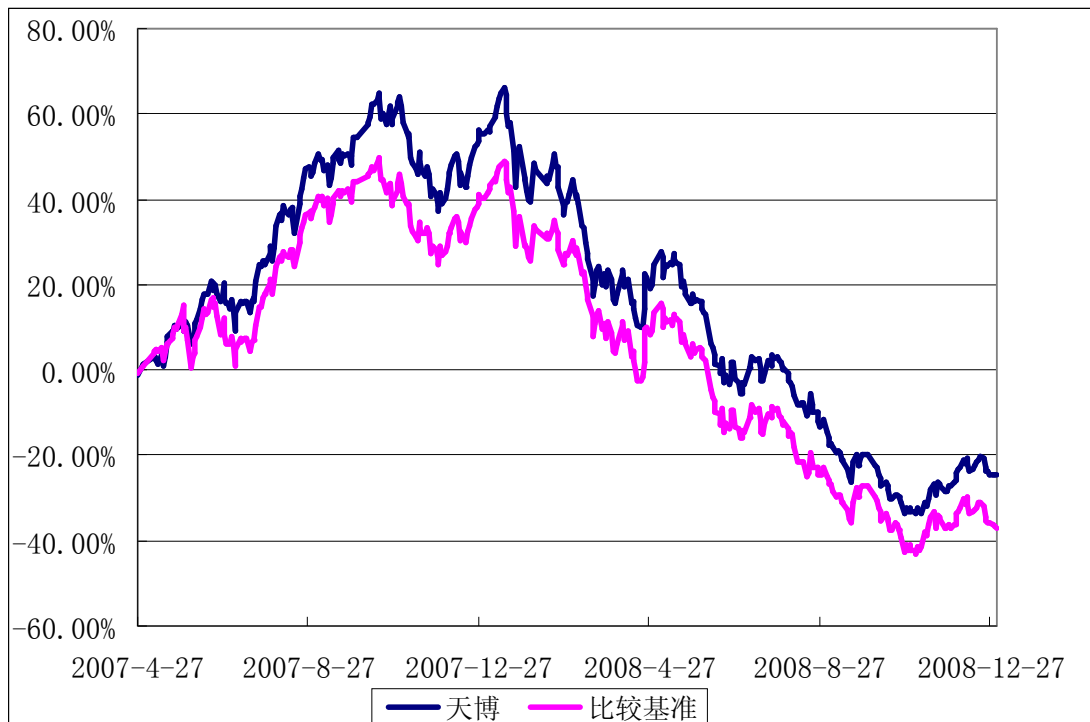
期间 T 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2,3,4,...;  $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示 t 日至 T 日的 (1+benchmark<sub>t</sub>) 数学连乘。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准

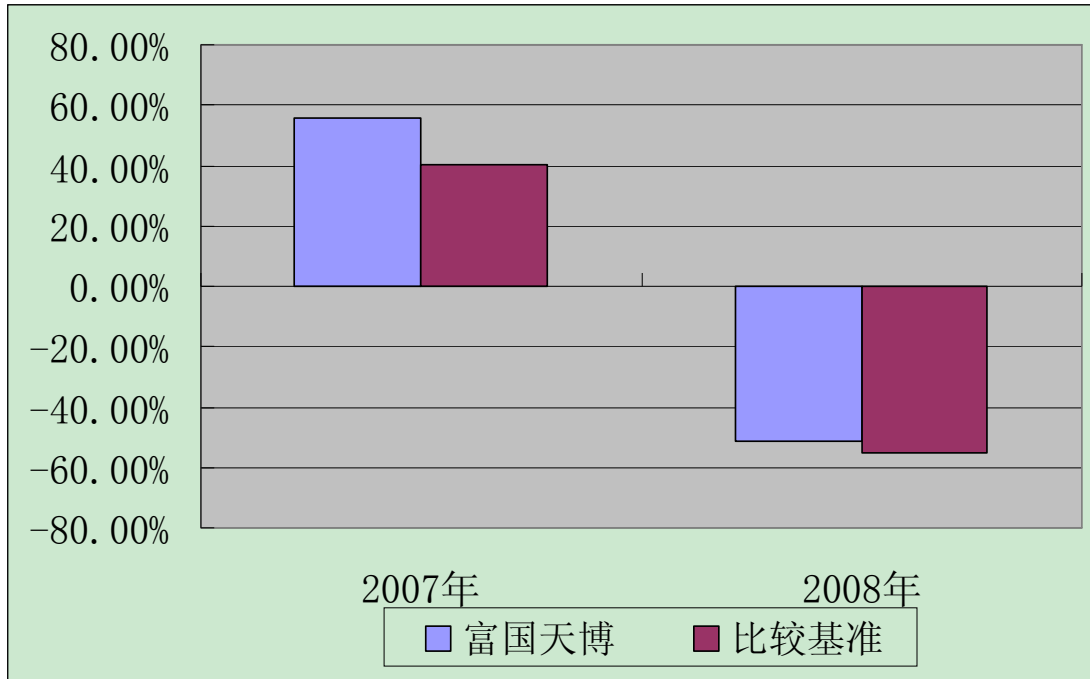
#### 收益率变动的比较



注：截止日期为 2008 年 12 月 31 日。

本基金于 2007 年 4 月 27 日由原汉博证券投资基金转型而成，建仓期 6 个月，从 2007 年 4 月 27 日至 2007 年 10 月 26 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金转型以来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



注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于 2007 年 4 月 27 日生效。2007 年净值增长率数据按实际存续期计算。

### 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	—	—	—	—	—
2007年	2.580	1,352,953,536.69	712,314,705.89	2,065,268,242.58	当期2次分红
合计	2.580	1,352,953,536.69	712,314,705.89	2,065,268,242.58	

注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于 2007 年 4 月 27 日生效。

## § 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册

成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止 2008 年 12 月 31 日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金三只封闭式证券投资基金和富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金和富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金及富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金十只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毕天宇	本基金基金经理	2005 年 11 月 26 日	—	9 年	硕士，曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理；中国北方工业上海公司处长助理；兴业证券研究员；2002.3 至今任富国基金管理有限公司行业研究员，现任富国天博基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
李晓铭	本基金基金经理助理	2008 年 3 月 1 日	—	4 年	硕士，曾任华富基金管理有限公司研究员，现任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，兼任富国天博基金基金经理助理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。



#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统内的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 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

公司旗下开放式基金（股票型）业绩比较：

项目	净值增长率	业绩比较基准收益率
富国天益价值证券投资基金	-43.83%	-62.43%
富国天合稳健优选股票型证券投资基金	-46.75%	-55.10%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	-51.52%	-55.10%

根据经托管行和会计师事务所审定的基金年报数据，本公司旗下相近投资风格的富国天益和富国天博的 2008 年度基金净值增长率分别为 -43.83% 和 -51.52%，二者之差超过 5%，其原因分析如下：

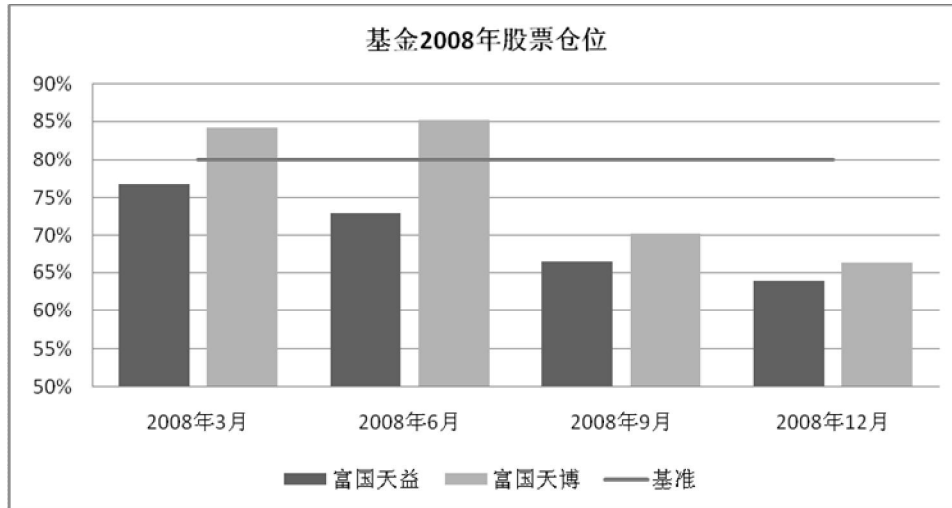
从 BARRA 收益分解来看，天益和天博的收益均来自于时机选择收益和股票选择收益，风格收益小于 0。基金的之间的差异主要来自于时机选择收益。

基金	beta 策略		现金策略		时机选择	
	股票组合	Contribution	股票仓位	Contribution	Contribution	Info
	BETA 偏离	(% Return)	偏离	(% Return)	(% Return)	Ratio
天益	-0.127	5.84	-7.54%	3.42	9.26	2.62



天博	-0.114	5.19	0.02%	-1.77	3.42	1.10
----	--------	------	-------	-------	------	------

就时机选择收益来说，基金之间的差异在于基金股票仓位的不同导致的现金策略收益的差异。整个 2008 年股票市场大幅下跌，市场基准全年累计下跌 64.97%。相对天博基金，天益基金持续保持相对较低的股票仓位（见下图），表现出较强的抗跌性。尽管 8 月份以后，天博基金逐步降低仓位，但由于之前保持较高的股票仓位，使得其现金策略的收益小于 0。



注：1、基准定义：天相 280 收益 \* 80%

2、基于 BARRA 风险模型，可以将基金的超额收益分解成：时机选择 (Market Timing)、风格收益 (Risk Indices)、行业收益 (Industries)、股票选择收益 (Asset Selection)。时机选择收益可进一步分解为：beta 策略和现金策略。其中 现金策略收益就是指仓位收益（当然这个仓位都是和基准相比，这里我们选择的是 80%）；Beta 策略收益是指股票组合的 beta（股票市场上涨的时候，应该选择 beta 较大的股票组合，股市下跌的时候，应该选择 beta 较小的组合）。

同时，对二者的投资过程的检查结果未发现与制度不一致的情况。

综上所述，二者之间的净值增长率之差系基金经理投资策略不同所致，没有证据显示存在利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金在报告期内净值下滑 51.52%。按照晨星分类，报告期内本基金在 189 个可比股票型基金中排名第 86。

虽然业绩排名位居中游，但高达 51.52% 的亏损是令人失望的，也难以向持有人交代。在此，我们深表歉意。

在经历了不堪回首的 2008 年，我们得到的教训要远大于经验。

首先，最大的失误在于对于宏观经济过于乐观。面对上半年实体经济依旧强劲的盈利增长数据，我们简单认为通货膨胀是输入性的，中国有能力平稳渡过次贷危机引发的全球金融危机。而事实却告诉我们，目前所面对是自上世纪三十年代以来全球最大的一次经济衰退，同时我们自身经济周期调整与之双重叠加。这对我们的宏观经济把握能力提出了更高要求。

其次，牛市思维下的高仓位操作，欠缺策略的灵活性。面对经济不确定性，07 年我们虽然看到市场所面临的全球经济下滑、通货膨胀和大小非解禁等问题，但我们并没有形成相应的组合策略加以防范。而连续两年的牛市思维使得我们习惯了当时高估值水平，将希望建立在通过精选个股的业绩增长来抵御市场振荡，降低估值风险。事实表明，高仓位操作难以回避系统风险，特别是如此大的经济周期调整。尽管我们在三季度将仓位由原来的 85% 降低到 70% 以下，但时机太晚，对组合的实际贡献不大。

再者，行业轮动不及时。分析期初持仓结构，我们发现周期类个股持有比例较高，这些个股在上半年给组合带来了较大的负面影响。而持有的防御类个股表现尽管战胜了市场，但同样表现差强人意。

总之，我们一方面必须坚持长期投资理念，对核心个股重点持有，另一方面需要针对市场、经济的不确定性，我们必须以多种组合策略弹性应对市场的变化。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国股市 08 年史无前例的暴跌走势，既是对 06、07 年市场巨幅上涨的一次修复，也是中国经济调整与全球经济衰退共振的结果。其背后的真实原因是美国经济的过度消费和全球经济多年失衡造成的恶果。

展望 09 年，我们将面临更多的挑战。一方面，全球经济依旧处于下滑趋势，特别是发达国家大多进入衰退，而国内经济也面临增速继续下滑，有硬着陆的风险。另一方面，国家出台四万亿积极的财政政策和宽松的货币信贷政策，在如此大力度的经济政策刺激下，经济很有可能使得逐步企稳。在衰退抑或企稳的困惑

中，市场的走势将令人难以琢磨。

我们判断，09 年将是中国经济增长的年度低点，再度出现 08 年 11 月份存货清理导致经济休克似调整的概率很低，最坏的时刻似乎已经过去。不过，大多数行业累积了巨大的产能。在总需求不足的情况下，行业产能利用率将在较长时间处于不足状态。企业盈利随着存货的出清会有所恢复，盈利不会显著改观。09 年宏观经济能否恢复适度增长将取决于国家刺激政策的执行力度、国内汽车、房地产等支柱产业能否及时走出调整以及海外市场特别是美国经济的恢复。

从 09 年 1 月的宏观数据来看，自 08 年 11 月开始的 3 个月银行信贷资金连续保持高速增长，短期虽不会迅速改善宏观经济的基本面，但这将改变了市场的悲观预期，也有助于改善流动性，提升市场的估值水平。

基于市场系统性风险较低判断，09 年我们将逢低增加仓位，在坚持核心仓位的基础上，更加注重组合的适度均衡，并加大波段操作和行业轮动的力度。重点关注和跟踪周期性行业能否有实质性的业绩回升，寻找可能的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定：“基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配”。本基金本期利润总额、本期已实现收益均为负数，则本基金本期不进行收益分配。

## § 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核审查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。

中国建设银行股份有限公司托管业务部

2009 年 3 月 27 日

## § 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。  
投资者可通过本基金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：富国天博创新主题股票型证券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	583,789,290.91	965,143,578.87
结算备付金	911,670.66	6,441,891.52
存出保证金	478,597.41	3,722,233.85
交易性金融资产	6,164,393,655.77	14,935,265,086.60
其中：股票投资	4,487,992,805.57	14,270,757,401.40
债券投资	1,676,400,850.20	664,507,685.20
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	1,763,365.63	4,130,431.91
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	26,417,696.95	11,334,021.85
应收股利	—	—
应收申购款	184,855.45	36,154,143.60
其他资产	—	—
资产合计	6,777,939,132.78	15,962,191,388.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2008 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2007 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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	14,783,058.25	16,926,011.34
应付赎回款	1,713,330.00	96,155,995.42
应付管理人报酬	8,772,102.49	19,201,297.83
应付托管费	1,462,017.05	3,200,216.33
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	580,146.65	1,367,793.61
应交税费	119,288.51	102,421.31
应付利息	—	—
应付利润	—	—
其他负债	658,720.12	1,010,002.73
负债合计	28,088,663.07	137,963,738.57
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	4,615,527,943.46	5,245,412,216.72
未分配利润	2,134,322,526.25	10,578,815,432.91
所有者权益合计	6,749,850,469.71	15,824,227,649.63
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>6,777,939,132.78</b>	<b>15,962,191,388.20</b>

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，本期末基金份额净值 0.5465 元，本期末基金份额总额 12,351,614,135.89 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 4 月 27 日 (基金合同生效 日) 至 2007 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-7,441,234,376.04	3,324,188,933.23
1. 利息收入	45,297,481.11	17,639,033.81
其中：存款利息收入	6,897,830.05	8,312,040.10
债券利息收入	37,995,547.06	9,326,993.71
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	404,104.00	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,610,100,416.56	1,104,721,490.43
其中：股票投资收益	-2,712,249,816.16	1,071,816,899.84
债券投资收益	3,554,605.67	3,820,232.22
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	14,886,906.34	1,920,888.30
股利收益	83,707,887.59	27,163,470.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-4,880,285,790.44	2,193,320,407.13
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,854,349.85	8,508,001.86
<b>二、费用（以“-”填列）</b>	-203,253,173.18	-197,979,672.34
1. 管理人报酬	-150,486,330.41	-108,181,140.77
2. 托管费	-25,081,055.03	-18,030,190.09
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	-23,000,274.33	-63,911,170.01
5. 利息支出	-4,177,213.50	-7,491,249.22
其中：卖出回购金融资产支出	-4,177,213.50	-7,491,249.22
6. 其他费用	-508,299.91	-365,922.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-7,644,487,549.22	3,126,209,260.89



### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 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）	5,245,412,216.72	10,578,815,432.91	15,824,227,649.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-7,644,487,549.22	-7,644,487,549.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-629,884,273.26	-800,005,357.44	-1,429,889,630.70
其中：1. 基金申购款	574,885,140.03	1,020,444,006.66	1,595,329,146.69
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,204,769,413.29	-1,820,449,364.10	-3,025,218,777.39
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）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	4,615,527,943.46	2,134,322,526.25	6,749,850,469.71
项目	上年度可比期间 2007 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 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）	500,000,000.00	721,684,131.94	1,221,684,131.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	3,126,209,260.89	3,126,209,260.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,745,412,216.72	8,796,190,282.66	13,541,602,499.38
其中：1. 基金申购款	7,022,386,040.11	13,270,960,292.60	20,293,346,332.71
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,276,973,823.39	-4,474,770,009.94	-6,751,743,833.33
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）	—	-2,065,268,242.58	-2,065,268,242.58
五、期末所有者权益（基金净值）	5,245,412,216.72	10,578,815,432.91	15,824,227,649.63

注：—



## 7.4 会计报表附注

### 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

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

根据中国证券监督管理委员会证监会公告[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”)的要求,本基金自2008年9月16日起,对特定投资品种变更了估值方法,具体如下:

(1) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值进行估值;

(2) 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值进行估值;

本基金采用中国证券业协会基金估值工作小组推荐的“指数收益法”进行估值。另外,根据《指导意见》的要求,本基金的管理人对管理的不同基金持有的同一投资品种采用一致的估值政策、程序及相关的方法。对于该会计估计变更,本基金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更于2008年度均系因股票长期停牌而引起,对本基金2008年9月16日的净利润和资产净值的影响为减少人民币88,683,947.80元,对本基金2008年度净利润的影响为减少利润人民币1,017,017.75元,对2008年末资产净值的影响为减少净值人民币1,017,017.75元。

#### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本期未发生重大会计差错,无需更正。

### 7.4.2 关联方关系

名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人 基金销售机构

中国建设银行股份有限公司 (简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司 (简称“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司 (简称“申银万国证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

**7.4.2.1 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**

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**7.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司 (简称“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司 (简称“申银万国证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**
**7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易**
**7.4.3.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效日) 至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
海通证券	63,686,437.27	0.90%	1,930,268,513.52	11.71%
申银万国证券	147,473,018.64	2.08%	907,985,478.30	5.51%

**7.4.3.1.2 权证交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效日) 至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
海通证券	—	—	—	—
申银万国证券	—	—	1,763,930.24	60.86%

#### 7.4.3.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效日) 至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
海通证券	106,438,379.23	11.38%	10,483,800.00	4.68%
申银万国证券	84,675.00	0.01%	10,358,061.60	4.63%

#### 7.4.3.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效日) 至2007年12月31日	
	成交金额	占当期回购 成交总额的比例	成交金额	占当期回购 成交总额的比例
海通证券	—	—	—	—
申银万国证券	—	—	79,600,000.00	6.72%

#### 7.4.3.1.5 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1月1日至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
海通证券	51,745.66	0.87%	43,935.07	7.58%
申银万国证券	125,351.15	2.10%	27,464.64	4.74%
关联方名称	上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效日)至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
海通证券	1,571,365.94	11.79%	43,730.13	3.21%
申银万国证券	744,066.20	5.58%	111,309.03	8.17%

注：上述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）。管理人

因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.3.2 关联方报酬

#### 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年4月27日（基金 合同生效日）至2007年 12月31日
当期应支付的管理费	150,486,330.41	108,181,140.77
其中：当期已支付	141,714,227.92	88,979,842.94
期末未支付	8,772,102.49	19,201,297.83

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付管理费。

#### 7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年4月27日（基金 合同生效日）至2007年 12月31日
当期应支付的托管费	25,081,055.03	18,030,190.09
其中：当期已支付	23,619,037.98	14,829,973.76
期末未支付	1,462,017.05	3,200,216.33

注：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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。

**7.4.3.3 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

本期 2008年1月1日至2008年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国建设银行	—	—	—	—	1,055,900,000.00	937,769.27
上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效日)至2007年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国建设银行	—	—	—	—	2,083,650,000.00	1,598,048.53

**7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况**
**7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

	本期 2008年1月1日至2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年4月27日(基金 合同生效日)至2007年 12月31日
期初持有的基金份额	—	21,904,143.00
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	—	36,713,554.00
期间赎回/卖出总份额	—	58,617,697.00
期末持有的基金份额	—	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	—

注：本基金管理人投资本基金的费率按照公告费率执行，不存在费率优惠的情况。

**7.4.3.4.2 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 2008年1月1日至2008年12月 31日		上年度可比期间 2007年4月27日(基金合同生效 日)至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
海通证券	—	—	3,345,126.00	0.02%

注：本基金管理人的股东海通证券股份有限公司投资本基金的费率按照公告费率执行，不存在费率优惠的情况。

#### 7.4.3.5 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1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月27日（基金合同生效日） 至2007年12月31日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行	583,789,290.91	6,740,345.86	965,143,578.87	7,507,338.09

#### 7.4.3.6 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

本期 2008年1月1日至2008年12月31日					
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：张/股）	总金额
海通证券	601898	中煤能源	公开发行	448,823	7,553,691.09
海通证券	601186	中国铁建	公开发行	963,600	8,749,488.00
海通证券	601958	金钼股份	公开发行	421,387	6,982,382.59
海通证券	110003	新钢转债	公开发行	151,940	15,194,000.00
上年度可比期间 2007年4月27日（基金合同生效日）至2007年12月31日					
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：张/股）	总金额
海通证券、 申银万国证券	601919	中国远洋	公开发行	898,800	7,621,824.00
海通证券	601168	西部矿业	公开发行	29,353	395,678.44
海通证券	601169	北京银行	公开发行	1,491,400	18,642,500.00
海通证券、 申银万国证券	601808	中海油服	公开发行	377,600	5,090,048.00
海通证券、 申银万国证券	601088	中国神华	公开发行	1,343,040	49,679,049.60
海通证券、 申银万国证券	601857	中国石油	公开发行	1,751,582	29,251,419.40
海通证券、 申银万国证券	601390	中国中铁	公开发行	3,899,955	18,719,784.00
申银万国	601866	中海集运	公开发行	1,015,752	6,724,278.24
海通证券、 申银万国证券	601601	中国太保	公开发行	638,742	19,162,260.00
海通证券	126008	08 上汽债	公开发行	126,280	12,628,000.00
海通证券、 申银万国证券	110026	中海转债	公开发行	102,670	10,267,000.00



注：本基金虽在承销期内从一级市场购入海通证券、申银万国证券担任副主承销商或分销商的上述证券，但并未直接向海通证券、申银万国证券购入上述证券。

#### 7.4.4 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本报告期末未持有因认购新发、增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的股票。

##### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：本基金本期末无正回购余额，没有因正回购而作为抵押的债券。

#### 7.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	4,487,992,805.57	66.21
	其中：股票	4,487,992,805.57	66.21
2	固定收益投资	1,676,400,850.20	24.73
	其中：债券	1,676,400,850.20	24.73
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	1,763,365.63	0.03
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	584,700,961.57	8.63
6	其他资产	27,081,149.81	0.40
7	合计	6,777,939,132.78	100.00

### 8.2 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	106,753,397.31	1.58
C	制造业	2,343,164,017.52	34.71
C0	食品、饮料	630,218,480.50	9.34



C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	597,802,162.44	8.86
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	206,917,663.66	3.07
C7	机械、设备、仪表	351,540,948.73	5.21
C8	医药、生物制品	533,354,444.41	7.90
C99	其他制造业	23,330,317.78	0.35
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	191,485,472.29	2.84
G	信息技术业	711,026,274.08	10.53
H	批发和零售贸易	750,054,807.06	11.11
I	金融、保险业	323,965,942.56	4.80
J	房地产业	32,550,000.00	0.48
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	28,992,894.75	0.43
M	综合类	—	—
	合计	4,487,992,805.57	66.49

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002024	苏宁电器	32,049,882	574,013,386.62	8.50
2	600519	贵州茅台	4,528,386	492,235,558.20	7.29
3	600271	航天信息	17,500,538	441,188,562.98	6.54
4	600596	新安股份	8,100,596	253,872,678.64	3.76
5	000792	盐湖钾肥	4,068,071	230,985,071.38	3.42
6	000063	中兴通讯	7,959,433	216,496,577.60	3.21
7	601398	工商银行	50,295,464	178,045,942.56	2.64
8	600036	招商银行	12,000,000	145,920,000.00	2.16
9	600276	恒瑞医药	3,726,307	143,500,082.57	2.13
10	002028	思源电气	5,023,158	140,648,424.00	2.08

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。

### 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	证券代码	证券名称	累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002024	苏宁电器	265,594,493.18	1.68
2	600519	贵州茅台	222,464,772.83	1.41
3	600456	宝钛股份	197,390,140.97	1.25
4	600585	海螺水泥	176,987,691.52	1.12
5	601006	大秦铁路	147,450,043.78	0.93
6	600196	复星医药	118,035,067.62	0.75
7	601398	工商银行	109,463,047.80	0.69
8	600596	新安股份	108,520,124.31	0.69
9	000898	鞍钢股份	101,597,482.60	0.64
10	002028	思源电气	97,115,507.90	0.61
11	002007	华兰生物	96,469,957.56	0.61
12	600271	航天信息	93,205,563.13	0.59
13	600036	招商银行	84,913,551.56	0.54
14	601166	兴业银行	78,565,767.45	0.50
15	002088	鲁阳股份	51,343,931.33	0.32
16	600327	大厦股份	48,233,564.70	0.30
17	002003	伟星股份	47,594,819.17	0.30
18	600315	上海家化	45,627,015.26	0.29
19	600880	博瑞传播	43,563,944.88	0.28
20	600557	康缘药业	38,625,360.68	0.24

注：“本期累计买入金额”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	证券代码	证券名称	累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	493,164,259.66	3.12
2	601318	中国平安	296,319,864.32	1.87
3	600019	宝钢股份	254,571,703.84	1.61
4	600036	招商银行	251,333,617.72	1.59
5	000983	西山煤电	228,634,646.82	1.44
6	600028	中国石化	227,084,906.93	1.44
7	000024	招商地产	225,328,170.52	1.42
8	601919	中国远洋	208,270,313.56	1.32
9	000002	万科A	189,470,678.29	1.20
10	601628	中国人寿	167,109,707.79	1.06
11	600900	长江电力	150,166,064.91	0.95
12	600000	浦发银行	133,759,727.32	0.85
13	600348	国阳新能	127,793,874.98	0.81

14	601166	兴业银行	112,218,892.87	0.71
15	600219	南山铝业	101,591,121.43	0.64
16	601398	工商银行	90,330,401.93	0.57
17	000402	金融街	83,454,348.31	0.53
18	000157	中联重科	82,421,148.68	0.52
19	600428	中远航运	78,058,260.78	0.49
20	600123	兰花科创	75,545,506.58	0.48

注：“本期累计卖出金额”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	2,674,906,007.06
卖出股票的收入（成交）总额	4,780,946,765.70

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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 期末按券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	197,548,417.40	2.93
2	央行票据	809,000,000.00	11.99
3	金融债券	162,200,000.00	2.40
	其中：政策性金融债	162,200,000.00	2.40
4	企业债券	401,777,538.80	5.95
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	105,874,894.00	1.57
7	其他	—	—
8	合计	1,676,400,850.20	24.84

#### 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	0801035	08 央票 35	3,000,000	320,070,000.00	4.74
2	0801106	08 央行票据 106	2,000,000	196,220,000.00	2.91
3	009908	99 国债(8)	966,590	98,253,873.50	1.46
4	0801101	08 央行票据 101	1,000,000	98,000,000.00	1.45
5	0801098	08 央行票据 98	1,000,000	97,940,000.00	1.45

#### 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

注：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	持有数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	031007	阿胶 EJC1	202,453	1,763,365.63	0.03

注：本基金本期末仅持有上述 1 只权证资产。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据 2008 年 10 月 7 日中兴通讯股份有限公司（下称中兴通讯）《关于财政部驻深圳财政监察专员办事处 2007 年会计信息质量检查结论和处理决定的公告》，财政部驻深圳财政监察专员办事处就会计信息质量检查中发现的问题对中兴通讯进行了行政处罚，行政处罚金额为人民币 16 万元整，及要求其公司补缴企业所得税人民币 380 万元整。中兴通讯对 2007 年重要财务指标进行了调整。本基金管理人在投资该股票前严格执行了对该上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等的相关投资决策流程。该处罚事件发生后，经过与该公司沟通其处罚事件的过程、性质，并经进一步的分析、研究，本基金管理人认为，中兴通讯在会计核算方面的问题虽对该公司财务指标产生影响，但未从根本上影响对该公司的投资价值判断。故本基金将继续持有该股票，并对该股票进行持续跟踪、研究。

其余九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。

#### 8.9.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

#### 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	478,597.41
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	26,417,696.95
5	应收申购款	184,855.45
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,081,149.81

#### 8.9.4 报告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	市值	市值占基金资产净值比例 (%)
1	110002	南山转债	81,713,748.00	1.21
合计			81,713,748.00	1.21

注：—

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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可能存在尾差。

## § 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

份额单位：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 (%)
580,802	21,266.48	328,438,896.02	2.66	12,023,175,239.87	97.34

### 9.2 期末基金管理公司从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,409,164.92	0.0114%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2007 年 4 月 27 日) 基金份额总额	500,000,000.00
报告期期初基金份额总额	14,037,256,364.92
报告期期间基金总申购份额	1,538,447,027.66

报告期期间基金总赎回份额	-3, 224, 089, 256. 69
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	12, 351, 614, 135. 89

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

本报告期内经中国证监会核准，本基金基金管理人于2008年12月11日公告聘任窦玉明先生担任公司总经理；2008年11月21日公告聘任林志松先生、陈戈先生担任公司副总经理、聘任李长伟先生担任公司督察长，李长伟先生不再担任公司副总经理、林志松先生不再担任公司督察长。2008年8月28日公告李建国先生不再担任总经理职务、陈继武先生不再担任副总经理职务；2008年10月10日公告谢卫先生不再担任副总经理职务。

以上事项均于上述日期在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上披露。

2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准本基金托管人中国建设银行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本报告期内本基金的审计机构安永大华会计师事务所有限责任公司更名为安永华明会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所审计报酬为15万元人民币，其已为本公司提供审计服务的连续年限为6年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。



**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	回购交易		股票交易		债券交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期回购交易总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票交易总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	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 (%)	
海通证券	2	—	—	63,686,437.27	0.90	106,438,379.23	11.38	—	—	51,745.66	0.87	—
兴业证券	1	400,000,000.00	22.08	124,957,382.30	1.76	1,687,344.78	0.18	—	—	106,211.84	1.78	—
申银万国	1	—	—	147,473,018.64	2.08	84,675.00	0.01	—	—	125,351.15	2.10	—
国泰君安	2	—	—	898,552,933.08	12.66	63,402,952.60	6.78	—	—	759,506.49	12.75	—
湘财证券	1	49,900,000.00	2.75	792,918,908.58	11.17	845,401.88	0.09	950,954.76	1.49	673,985.57	11.32	—
中信建投	1	—	—	166,203,990.71	2.34	34,897,148.53	3.73	—	—	141,272.61	2.37	—
中银国际	1	—	—	981,936,308.38	13.83	14,516,466.81	1.55	5,372,396.49	8.44	797,833.74	13.39	—
上海证券	1	159,500,000.00	8.80	515,980,777.81	7.27	8,915,368.00	0.95	5,783,633.26	9.09	438,581.34	7.36	—
高华证券	1	79,900,000.00	4.41	607,729,918.35	8.56	177,764,586.67	19.00	—	—	516,570.55	8.67	—
长城证券	1	—	—	93,853,823.91	1.32	48,857,309.89	5.22	—	—	79,776.53	1.34	—
国信证券	1	—	—	915,762,464.93	12.90	15,139,370.50	1.62	—	—	744,061.95	12.49	—
安信证券	1	244,800,000.00	13.51	638,867,099.91	9.00	274,223,551.47	29.31	20,281,390.17	31.87	543,043.32	9.12	—
中信证券	1	219,900,000.00	12.14	416,755,840.23	5.87	—	—	2,059,597.93	3.24	354,234.13	5.95	—
中投证券	1	164,500,000.00	9.08	327,625,181.15	4.62	17,249,670.04	1.84	714,854.36	1.12	278,484.34	4.68	—
长江证券	1	493,500,000.00	27.24	406,675,268.05	5.73	171,450,773.74	18.33	28,483,784.72	44.75	345,668.14	5.80	—
合计	17	1,812,000,000.00	100.00	7,098,979,353.30	100.00	935,472,999.14	100.00	63,646,611.69	100.00	5,956,327.36	100.00	—

注：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；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；本基金本报告期新租用以下交易单元：中投证券的上交所 22347 交易单元和兴业证券的上交所 24031 交易单元。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会 [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》的要求，参考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》的意见，经与基金托管人、基金审计机构协商一致，富国基金管理有限公司自 2008 年 9 月 16 日起对旗下基金持有的相关停牌股票按照指数收益法进行估值，即在估值日，以该股票所上市的交易所行业分类指数中对应的行业指数的日收益率作为该股票的收益率，根据上述所得的收益率计算该股票当日的公允价值。上证行业分类指数由上海证券交易所提供，行情由上海证券交易所发布。深证行业分类指数由深圳证券交易所提供，行情由深圳证券交易所发布。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

- 1、2008年5月27日，中国建设银行股份有限公司发布关于美国银行公司行使认购期权的公告，美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权；
- 2、2008年9月23日，中国建设银行股份有限公司公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持中国建设银行股份有限公司股份的公告；
- 3、2008年11月17日，中国建设银行股份有限公司公告美国银行公司行使认购期权的事宜；
- 4、2008年12月2日，中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

富国基金管理有限公司  
二〇〇九年三月三十一日