华宝兴业收益增长混合型证券投资基金 2008年年度报告摘要

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2009年3月26日

1 重要提示及目录

1.1重要提示

基金管理人的董事会、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25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。

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及其更新。

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。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	收益增长基金
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月15日
报告期末基金份额总额	2,263,182,938.07份

2.2基金产品说明

投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。股票投资部分采用定量与定性分析相结合,行业配置与定期调整策略;债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。

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		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	尹东
	联系电话	021-38505888	010—67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		021-38924558;4007005588	010—67595096
传真		021-38505777	010—66275853

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.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

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	2006年6月15日 至2006年12月31日
本期已实现收益	-3,224,018,034.82	3,036,317,143.88	321,629,460.74
本期利润	-5,677,105,220.75	3,154,033,923.44	856,409,815.51
加权平均基金份额本期利润	-2.2269	2.0107	0.3922
本期基金份额净值增长率	-53.69%	167.63%	46.17%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年6月15日 至2006年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.8117	2.3467	0.1789
期末基金资产净值	4,100,117,876.83	8,584,346,971.03	2,267,283,557.67
期末基金份额净值	1.8117	3.9119	1.4617

注:1、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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

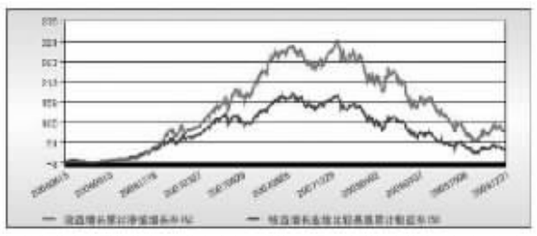
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-12.04%	2.70%	-14.84%	1.96%	2.80%	0.74%
过去六个月	-27.71%	2.65%	-22.68%	1.96%	-5.03%	0.69%
过去一年	-53.69%	2.62%	-50.28%	2.08%	-3.41%	0.54%
自基金合同生效起至今	81.17%	2.12%	31.05%	1.77%	50.12%	0.35%

注:本基金业绩比较基准为65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效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

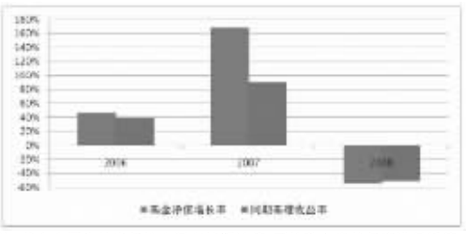
华宝兴业收益增长混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年6月15日至2008年12月31日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2006年12月15日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 自基金合同生效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

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注:基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3自基金合同生效以来基金的利润分配情况

自基金合同生效以来本基金未进行过利润分配。

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

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2008年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、本基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金和大盘精选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计48,153,927,673.66元。

4.1.2 基金经理及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯刚	本基金基金经理,大盘精选基金基金经理	2006-06-15	-	8年	硕士,曾在联合证券有限公司、华安基金管理公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004年3月加入本公司,任高级研究员、多策略增长基金基金经理助理,2008年10月7日起兼任大盘精选基金基金经理。
邵喆阳	本基金基金经理助理,大盘精选基金经理助理	2008-05-14	-	2年	硕士,2005年7月至2006年12月任安永会计师事务所审计员。2006年12月加入本公司任分析师,2008年5月起任收益增长基金基金经理助理,2008年10月起兼任大盘精选基金基金经理助理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

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,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;完成了交易价差分析和异常交易行为监控系统开发,加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

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

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明,管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

08年本基金净值增长率-53.69%,基金业绩比较基准为-50.28%,2008年全年本基金净值收益率落后业绩基准3.41%。

2008年股市在前三个季度反复下跌,指数不断创出新低,上证指数在二季度初跌破3000点后出现反弹,证监会也出台限制大小非减持以及降低印花税的"救市"措施,市场随即出现一波大幅上涨。但是政府的救市措施并没有打消投资者对市场的担忧情绪,同时本基金未能及时减少股票仓位,造成2-3季度净值大幅下跌。

四季度股市在季度初继续出现大幅下跌,指数随之创出新低,但在国家4万亿基础建设投资以及其他一系列经济提振计划的刺激下,股市在11月出现反弹,本基金顺势而为,积极买入了政府刺激经济影响较大的建筑建材、民爆、焦煤以及家电等行业,随后反弹一直持续到12月上旬。

展望09年,我们认为股指受外围市场和宏观经济数据的影响将进一步加强,回顾08年,经济增长预期放缓、宏观紧缩政策、全球经济衰退、企业盈利增速下降、再融资压力、大小非解禁等因素是股指大幅下跌的主要因素。进入09年,上述这些因素正在分化,有些还在恶化、有些在向好,我们认为上述因素在09年可能经济增长放缓将是主要的影响因素,而政府经济振兴计划也会为市场不断带来刺激,它们之间相互角力,将是A股全年的主线。

我们对市场的总体判断是:基本面将维持弱势,放松的货币政策和积极的财政政策将带来增量资金和部分行业的需求。我们的投资策略将充分考虑上述因素对市场的影响,阶段性把握不同阶段市场的投资主题将是未来的主要投资方式,尽量回避外需为主的行业和个股。这一点上,我们认为将是09年市场和08年最大的区别,市场将摆脱单边下行的趋势,转而在各种力量的影响下进入震荡市。

这其中就会有我们的投资机会,基建投资、家电下乡、产业振兴计划、促进地产消费、扶持"三农"、新医改、传媒改革、节能减排等等都是我们将密切关注的投资主题。结构上更多关注政府为保持经济增长采取的措施,我们将继续买入政府刺激经济影响较大的建筑建材、工程机械、家电、焦煤以及受部分地区房地产转暖的相关公司。由于宏观经济仍然面临波动,4万亿起效果可能要到2季度,在震荡市中把握有持续超业绩预期的公司是我们主要的投资研究方向,对具有分红能力的上市公司将更加关注是否有持续性,而不能简单地以单一的股息率指标来做投资依据。今年将努力为持有人创造正收益。

4.5管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中,各部门参与如下:

(一)基金会计:根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算,并对基金投资品种进行估值。

(二)金融工程部:对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下,为估值提供相关模型。

(三)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的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时,评价现有估值政策和程序的适用性。

(四)必要时基金经理参与制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.6管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损,本报告期末可供分配基金份额利润为人民币0.8117元。

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。

6 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过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:华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	2008年12月31日	2007年12月31日
资 产:			
银行存款		428,158,006.53	1,007,684,164.77
结算备付金		6,527,846.79	14,749,413.98
存出保证金		1,973,631.70	5,649,328.43
交易性金融资产		3,633,111,877.37	7,608,569,574.33
其中:股票投资		3,208,027,497.77	7,254,497,497.73
债券投资		425,084,379.60	354,072,076.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	3,304,541.78
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		44,653,184.74	-
应收利息		9,065,305.21	6,153,652.83
应收股利		-	-
应收申购款		15,770,835.51	38,156,056.64
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,139,260,687.85	8,684,266,732.76
负债和所有者权益			
负 债:			
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		-	47,440,992.61
应付赎回款		24,066,761.90	28,801,516.44
应付管理人报酬	7.4.3.2.1	5,453,299.45	10,488,927.44
应付托管费	7.4.3.2.2	908,883.23	1,748,154.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		8,064,014.46	10,581,955.04
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		649,851.98	858,215.65
负债合计		39,142,811.02	99,919,761.73
所有者权益:			
实收基金		2,263,182,938.07	2,194,399,910.14
未分配利润		1,836,934,938.76	6,389,947,060.89
所有者权益合计		4,100,117,876.83	8,584,346,971.03
负债和所有者权益总计		4,139,260,687.85	8,684,266,732.76

注:报告截止日2008年12月31日,基金份额净值1.8117元,基金份额总额2,263,182,938.07份。

7.2利润表

会计主体:华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

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	附注号	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入		-5,432,283,514.69	3,368,374,496.15
1.利息收入		19,698,154.33	8,915,551.95
其中:存款利息收入		6,747,710.89	4,557,832.76
债券利息收入		12,950,443.44	4,357,719.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-3,005,475,581.67	3,234,697,621.46
其中:股票投资收益		-3,075,213,015.01	3,158,812,043.78
债券投资收益		-6,180,686.51	6,303,758.01
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		9,026,198.85	54,817,599.22
股利收益		66,891,921.00	14,764,220.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,453,087,185.93	117,716,779.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		6,581,098.58	7,044,543.18
二、费用(以"-"号填列)		-244,821,706.06	-214,340,572.71
1.管理人报酬	7.4.3.2.1	-105,373,156.97	-71,025,861.83
2.托管费	7.4.3.2.2	-17,562,192.75	-11,837,643.57
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-119,458,713.54	-128,222,584.48
5.利息支出		-1,886,050.04	-2,747,421.28
其中:卖出回购金融资产支出		-1,886,050.04	-2,747,421.28
6.其他费用		-541,592.76	-507,061.55
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-5,677,105,220.75	3,154,033,923.44
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		-5,677,105,220.75	3,154,033,923.44

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

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	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)	2,194,399,910.14	6,389,947,060.89	8,584,346,971.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,677,105,220.75	-5,677,105,220.75
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)	68,783,027.93	1,124,093,098.62	1,192,876,126.55
其中:1.基金申购款	2,034,852,183.65	4,520,010,579.45	6,554,862,763.10
2.基金赎回款	-1,966,069,155.72	-3,395,917,480.83	-5,361,986,636.55
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)	2,263,182,938.07	1,836,934,938.76	4,100,117,876.83
项目	2007年1月1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)	1,551,097,894.81	716,185,662.86	2,267,283,557.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,154,033,923.44	3,154,033,923.44
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)	643,302,015.33	2,519,727,474.59	3,163,029,489.92
其中:1.基金申购款	2,654,332,296.99	6,153,204,160.40	8,807,536,457.39
2.基金赎回款	-2,011,030,281.66	-3,633,476,685.81	-5,644,506,967.47
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)	2,194,399,910.14	6,389,947,060.89	8,584,346,971.03

7.4报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年期年度报告相一致的说明

与最近一期年度报告相比,本报告期所采用的会计政策保持一致,但所采用的会计估计发生了变更。

根据中国证监会公告[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》,本基金自2008年9月16日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法,从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《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》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2008年9月16日下调61,544,444.58元,相应调减本基金的净利润61,544,444.58元和基金资产净值61,544,444.58元。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司("华宝兴业")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
华宝信托投资有限责任公司("华宝信托")	基金管理人的股东
法国兴业资产管理有限公司 (Société Générale Asset Management SA)	基金管理人的股东
华宝证券经纪有限责任公司("华宝证券")	受基金管理人的股东控制的公司
上海宝钢集团公司("宝钢集团")	基金管理人的股东的母公司

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

本报告期内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

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司("华宝兴业")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
华宝证券经纪有限责任公司("华宝证券")	受基金管理人的股东控制的公司

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股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	2008年1月1日至2008年12月31日		2007年1月1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
华宝证券	261,297,294.36	0.66%	-	-

7.4.3.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	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
华宝证券	222,103.18	0.67%	-	-
关联方名称	2007年1月1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
华宝证券	-	-	-	-

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	105,373,156.97	71,025,861.83
其中:当期已支付	99,919,857.52	60,536,934.39
期末未支付	5,453,299.45	10,488,927.44

注:支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5%/当年天数。

7.4.3.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	17,562,192.75	11,837,643.57
其中:当期已支付	16,653,309.52	10,089,489.02
期末未支付	908,883.23	1,748,154.55

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25%/当年天数。

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

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	-	-	-	-	291,000,000.00	149,586.91
2007年1月1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	-	-	-	-	837,500,000.00	974,891.32

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

项目	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年1月1日至2007年12月31日
期初持有的基金份额	59,370.08	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	170,305.43	59,370.08
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	229,675.51	59,370.08
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0101%	0.0027%

注:基金管理人投资本基金适用的认(申)购费回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.3.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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	2008年1月1日至2008年12月31日		2007年1月1日至2007年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	428,158,006.53	6,330,005.09	1,007,684,164.77	4,125,061.72

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内,本基金无参与关联方承销证券的情况。

7.4.4 期末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

本基金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

单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600900	长江电力	08/05/08	资产重组	7.35	未知	未知	8,088,000	103,858,879.03	59,446,800.00
000792	盐湖钾肥	08/06/26	资产重组	56.78	08/12/26	78.23	300,000	26,115,838.81	17,034,000.00

注:1、本基金截至2008年12月31日止持有因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在消除所公布事项的重大影响后,经交易所批准复牌。

2、青海盐湖钾肥股份有限公司股票自2008年12月26日复牌至2008年12月31日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低,故作为流通受限证券列示且于2008年12月31日采用指数收益法估值。该股票于2009年1月8日打开跌停板,当日的收盘价为每股37.99元。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

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	3,208,027,497.77	77.50
	其中:股票	3,208,027,497.77	77.50
2	固定收益投资	425,084,379.60	10.27
	其中:债券	425,084,379.60	10.27
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	434,685,853.32	10.50
6	其他资产	71,462,957.16	1.73
7	合计	4,139,260,687.85	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	37,495,982.27	0.91
B	采掘业	139,821,607.16	3.41
C	制造业	1,170,557,238.32	28.55
C0	食品、饮料	152,346,141.13	3.72
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	346,029,320.08	8.44
C5	电子	62,080,000.00	1.51
C6	金属、非金属	293,346,443.31	7.15
C7	机械、设备、仪表	181,920,506.25	4.44
C8	医药、生物制品	134,834,827.55	3.29
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	68,138,062.88	1.66
E	建筑业	56,129,889.08	1.37
F	交通运输、仓储业	193,273,983.80	4.71
G	信息技术业	159,724,227.67	3.90
H	批发和零售贸易	290,415,500.00	7.08
I	金融、保险业	755,371,594.81	18.42
J	房地产业	196,791,729.30	4.80
K	社会服务业	3,016,895.64	0.07
L	传播与文化产业	114,940,000.00	2.80
M	综合类	22,350,786.84	0.55
	合计	3,208,027,497.77	78.24

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	600016	民生银行	40,800,000	166,056,000.00	4.05
2	601166	兴业银行	9,350,000	136,510,000.00	3.33
3	600309	烟台万华	12,650,000	126,500,000.00	3.09
4	600000	浦发银行	8,200,000	108,650,000.00	2.65
5	600880	博瑞传播	8,000,000	106,000,000.00	2.59
6	000001	深发展A	10,703,743	101,257,408.78	2.47
7	600036	招商银行	7,800,000	94,848,000.00	2.31
8	000002	万 科A	13,350,000	86,107,500.00	2.10
9	600030	中信证券	4,750,000	85,357,500.00	2.08
10	000877	天山股份	6,550,000	69,561,000.00	1.70

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www.fsfund.com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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	588,268,389.92	6.85
2	600030	中信证券	494,018,492.37	5.75
3	600016	民生银行	475,697,219.07	5.54
4	000001	深发展A	396,529,639.23	4.62
5	600585	海螺水泥	356,755,811.47	4.16
6	600428	中远航运	343,649,322.30	4.00
7	600036	招商银行	326,447,508.03	3.80
8	601006	大秦铁路	303,760,658.71	3.54
9	601166	兴业银行	303,696,008.67	3.54
10	600058	五矿发展	298,909,333.22	3.48
11	000933	神火股份	291,249,019.05	3.39
12	600000	浦发银行	286,564,547.42	3.34
13	600028	中国石化	274,779,261.75	3.20
14	600005	武钢股份	266,517,100.98	3.10
15	600309	烟台万华	259,731,251.33	3.03
16	600660	福耀玻璃	241,443,282.29	2.81
17	002024	苏宁电器	240,097,123.10	2.80
18	000002	万 科A	232,241,310.90	2.71
19	600123	兰花科创	222,485,684.93	2.59
20	600026	中海发展	214,971,213.63	2.50
21	000651	格力电器	214,828,870.68	2.50
22	000527	美的电器	212,246,917.47	2.47
23	000878	云南铜业	211,578,949.89	2.46
24	600143	金发科技	211,197,796.31	2.46
25	600900	长江电力	208,970,931.22	2.43
26	000898	鞍钢股份	207,889,658.99	2.42
27	600102	莱钢股份	202,298,617.13	2.36
28	600717	天津港	196,826,262.30	2.29
29	601628	中国人寿	190,839,653.53	2.22
30	600596	新安股份	172,645,125.98	2.01

注:买入金额不包括相关交易费用。

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	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	550,941,397.34	6.42
2	600030	中信证券	421,611,494.92	4.91
3	600000	浦发银行	364,640,979.98	4.25
4	600026	中海发展	339,786,278.77	3.96
5	600309	烟台万华	289,511,006.21	3.37
6	600028	中国石化	275,855,095.06	3.21
7	600153	建发股份	272,206,889.82	3.17
8	600428	中远航运	253,298,319.71	2.95
9	002024	苏宁电器	247,502,066.89	2.88
10	600016	民生银行	240,543,430.15	2.80
11	600005	武钢股份	240,037,011.32	2.80
12	600036	招商银行	235,482,092.70	2.74
13	601628	中国人寿