中小企业板交易型开放式指数基金 2008年年度报告摘要

2008年12月31日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇〇九年三月二十六日

§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20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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

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	中小板ETF
交易代码	159902
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年6月8日
报告期末基金份额总额	1,543,333,503.09份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年9月5日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为“中小企业板价格指数”。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪反映中小企业板市场的标的指数,是股票基金中风险较高的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	廖为	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-88066511	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.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

§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8日至2006年12月31日
本期已实现收益	-440,770,609.41	1,884,524,079.29	89,013,104.00
本期利润	-2,709,930,610.82	3,076,342,818.10	470,062,985.93
加权平均基金份额本期利润	-1.6574	1.9282	0.1357
本期基金份额净值增长率	-52.62%	149.25%	19.40%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年6月8日至2006年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.4105	1.2596	0.0404
期末基金资产净值	2,176,801,667.99	5,309,223,049.90	2,347,164,837.03
期末基金份额净值	1.410	2.976	1.194

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	-0.21%	2.90%	0.89%	3.03%	-1.10%	-0.13%
过去六个月	-21.45%	2.85%	-22.09%	2.97%	0.64%	-0.12%
过去一年	-52.62%	2.88%	-54.16%	3.02%	1.54%	-0.14%
自基金合同生效起至今	41.00%	2.33%	40.52%	2.47%	0.48%	-0.14%

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

中小企业板交易型开放式指数基金
份额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6月8日至2008年12月31日)

注:本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的90%。本基金按规定在基金合同生效之日起3个月的时间内达到这一投资比例。

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

自基金合同生效以来中小企业板交易型开放式指数基金
净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

注:本基金合同于2006年6月8日生效,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每年的基金利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都设有分公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚德中国基金投资管理人以及特定客户资产管理人,是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

截至2008年12月31日,公司管理资产规模超过2000亿元,基金份额持有人户数超过1200万,是境内管理基金资产规模最大的基金管理公司。公司管理着基金兴华、基金兴和2只封闭式基金、华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板ETF、华夏回报二号、华夏稳增、华夏优势增长、华夏蓝筹、华夏复兴、华夏全球、华夏行业、华夏希望、华夏策略17只开放式基金,以及亚洲债券基金二期中国子基金、多只全国社保基金投资组合,公司已经被90多家大中型企业确定为年金投资管理人,并被多家客户确定为特定客户资产管理人。

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		
方军	本基金的基金经理、金融工程部副总经理	2006-6-8	—	9年	硕士。1999年加入华夏基金管理有限公司,历任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
②证券从业的含义遵从行业协会《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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,因规模变动和指数成份股定期调整等原因导致中小板ETF个别交易日跟踪标的指数的投资组合资产占基金资产净值比例低于90%,上述指标已于合理期限内调整,未违反法律法规及基金合同的规定,也未对基金份额持有人利益造成实际影响。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定严格执行。

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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4.1 本基金业绩表现

截至2008年12月31日,本基金份额净值为1.410元,本报告期份额净值增长率为-52.62%,同期中小企业板价格指数累计增长率为-54.16%。本基金本报告期累计跟踪偏离度为1.54%。

4.4.2 行情回顾及运作分析

2008年,在外部需求放缓等因素的影响下,我国经济增长减速,企业盈利能力下降,投资者对经济前景以及上市公司业绩的担忧增加,“大小非”股东限售股解禁对现有的估值体系产生较大冲击,由此导致A股市场大幅调整。本报告期,中小板指表现超越了市场平均水平。

本报告期本基金的操作主要集中在指数结构调整上,共完成3次成份股的定期调整以及大量限售股上市带来的结构调整。在操作中,我们严格按照基金合同和公司投资决策委员会制定的投资策略,尽量降低成本、减少市场冲击,紧密跟踪中小板指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2009年,尽管上市公司利润增速放缓、利润率下降等因素可能会给市场带来较大的压力,但市场经过大幅调整,估值压力得到较为充分的释放,政府的刺激政策也为未来经济的恢复创造了条件。因此,市场继续振荡筑底的可能性较大,随着货币政策的放松,阶段性或局部性投资机会将有所增加。

中小板股票具有很明显的成长性优势和长期投资价值,但经济形势的变化也会对中小板公司产生影响,中小板股票的波动性较大。我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现为投资者获取指数投资收益及其他模式盈利机会的投资目标。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,中小板ETF将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念、规范运作、审慎投资、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人在内部监察工作中从合规运作、保障基金持有人利益出发,由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查,发现问题及时督促有关部门整改,并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内,本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面:

①对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训。

②进一步完善了公司相关管理制度。

③加强了对投资人员的监察监督,制定并落实了关于防范投资人员道德风险的有关措施。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,保障了基金持有人利益。我们将继续以风险控制为核心,提高内部监察工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险总监、法律监察总监及基金会计负责人等。其中,超过三分之一以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期可不进行利润分配。

§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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内调整,未造成实际损失。报告期内,对基金份额持有人利益未造成损害。

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

普华永道中天审字(2009)第20190号

中小企业板交易型开放式指数基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的中小企业板交易型开放式指数基金(以下简称“中小板ETF基金”)的财务报表,包括2008年12月31日的资产负债表、2008年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是中小板ETF基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

①设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;

②选择和运用恰当的会计政策;

③作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了中小板ETF基金2008年12月31日的财务状况以及2008年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天　　注册会计师:许康玮
会计师事务所有限公司　　注册会计师:单　峰
中国　上海市

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金
报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产:			
银行存款		146,693,990.40	485,179,323.30
结算备付金		-	28,244,969.24
存出保证金		250,000.00	1,798,492.66
交易性金融资产		2,070,629,915.97	4,951,343,635.41
其中:股票投资		2,070,629,915.97	4,944,815,572.57
基金投资		-	-
债券投资		-	6,528,062.84
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		39,263.96	202,753.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	36,637,822.00
资产总计		2,217,613,170.33	5,503,406,995.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
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		31,815,983.56	161,533,810.21
应付赎回款		1,497,466.38	4,703,355.34
应付管理人报酬		952,267.90	1,629,605.06
应付托管费		190,453.55	325,921.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,098,871.47	3,298,751.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,256,459.48	22,692,502.82
负债合计		40,811,502.34	194,183,946.02
所有者权益:			
实收基金		1,543,333,503.09	1,784,288,479.82
未分配利润		633,468,164.90	3,524,934,570.08
所有者权益合计		2,176,801,667.99	5,309,223,049.90
负债和所有者权益总计		2,217,613,170.33	5,503,406,995.92

注:报告截止日2008年12月31日,基金份额净值1.410元,基金份额总额1,543,333,503.09份。

7.2 利润表

会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金
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	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入		-2,682,233,036.00	3,112,110,906.75
1.利息收入		1,634,749.08	1,494,791.29
其中:存款利息收入		1,634,017.68	1,462,978.84
债券利息收入		731.40	31,812.45
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)		-416,066,358.48	1,913,046,107.97
其中:股票投资收益		-439,037,770.81	1,898,431,947.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,701,356.43	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		19,270,055.90	14,614,160.20
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-2,269,160,001.41	1,191,818,738.81
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		1,358,574.81	5,751,268.68
二、费用(以“-”号填列)		-27,697,574.82	-35,768,088.65
1.管理人报酬		-16,721,474.67	-17,092,057.18
2.托管费		-3,344,294.95	-3,418,411.48
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-7,380,594.53	-14,993,361.84
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		-251,210.67	-264,258.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,709,930,610.82	3,076,342,818.10
所得税费用(以“-”号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,709,930,610.82	3,076,342,818.10

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金
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)	1,784,288,479.82	3,524,934,570.08	5,309,223,049.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,709,930,610.82	-2,709,930,610.82
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)	-240,954,976.73	-181,535,794.36	-422,490,771.09
其中:1.基金申购款	2,425,762,841.34	2,667,027,468.51	5,092,790,309.85
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-2,666,717,818.07	-2,848,563,262.87	-5,515,281,080.94
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)	1,543,333,503.09	633,468,164.90	2,176,801,667.99
	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日		
项目	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)	1,965,122,498.64	382,042,338.39	2,347,164,837.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,076,342,818.10	3,076,342,818.10
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)	-180,834,018.82	66,549,413.59	-114,284,605.23
其中:1.基金申购款	3,234,647,390.03	3,588,907,698.02	6,823,555,088.05
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-3,415,481,408.85	-3,522,358,284.43	-6,937,839,693.28
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)	1,784,288,479.82	3,524,934,570.08	5,309,223,049.90

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金场外申购赎回销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金场外申购赎回销售机构
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东、场内申购赎回销售机构
中信建投证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、场内申购赎回销售机构
中信万通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、场内申购赎回销售机构
中信金通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司

注:华夏基金管理有限公司股东及持股比例如下:

持股单位	权益比例
中信证券股份有限公司	100%
合计	100%

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	16,721,474.67	17,092,057.18
其中:当期已支付	15,769,206.77	15,462,452.12
期末未支付	952,267.90	1,629,605.06

注:①支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值x0.5%/当年天数。

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1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	3,344,294.95	3,418,411.48
其中:当期已支付	3,153,841.40	3,092,490.47
期末未支付	190,453.55	325,921.01

注:①支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值x0.1%/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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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	146,693,990.40	1,572,537.42	485,179,323.30	1,391,686.49

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

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

金额单位:人民币元

7.4.4.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002024	苏宁电器	2008-05-22	2009-05-22	非公开发行流通受限	45.00	17.91	4,000,000	180,000,000.00	71,640,000.00
002024	苏宁电器	-	2009-05-22	非公开发行转增	-	17.91	4,000,000	-	71,640,000.00

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31日止,本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31日止,本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	2,070,629,915.97	93.37
	其中:股票①	2,070,629,915.97	93.37
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	146,693,990.40	6.61
6	其他资产	289,263.96	0.01
7	合计	2,217,613,170.33	100.00

注:①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值238.00元。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资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	40,557,391.64	1.86
B	采掘业	39,205,892.98	1.80
C	制造业	1,154,804,619.55	53.05
C0	食品、饮料	15,355,569.60	0.71
C1	纺织、服装、皮毛	61,659,535.43	2.83
C2	木材、家具	1,230,684.00	0.06
C3	造纸、印刷	24,588,627.53	1.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	190,641,764.17	8.76
C5	电子	120,689,364.27	5.54
C6	金属、非金属	89,034,160.98	4.09
C7	机械、设备、仪表	341,547,275.79	15.69
C8	医药、生物制品	265,653,930.66	12.20
C99	其他制造业	44,403,707.12	2.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,719,746.40	1.59
F	交通运输、仓储业	4,099,990.40	0.19
G	信息技术业	89,434,653.00	4.11
H	批发和零售贸易	558,528,643.71	25.66
I	金融、保险业	75,108,665.60	3.45
J	房地产业	27,139,456.44	1.25
K	社会服务业	38,813,497.52	1.78
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	7,655,120.73	0.35
	合计	2,070,067,677.97	95.10

8.2.2 积极投资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	-	-
C	制造业	562,000.00	0.03
C0	食品、饮料	-	-
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	562,000.00	0.03
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
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	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	562,000.00	0.03

注:以上股票均为指数成份股调整而调出的成份股股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 指数投资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	30,072,765	538,603,221.15	24.74
2	002007	华兰生物	2,306,526	88,801,251.00	4.08
3	002022	科华生物	3,656,964	85,207,261.20	3.91
4	002142	宁波银行	11,045,392	75,108,665.60	3.45
5	002038	双鹭药业	1,871,924	68,662,172.32	3.15
6	002028	思源电气	2,097,797	58,738,316.00	2.70
7	002001	新和成	1,967,621	48,364,124.18	2.22
8	002122	天马股份	884,143	47,151,346.19	2.17
9	002152	广电运通	1,185,854	35,065,702.78	1.61
10	002008	大族激光	5,670,288	33,171,184.80	1.52

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002002	ST琼花	200,000	562,000.00	0.03

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人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	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	002024	苏宁电器	180,000,000.00	3.39
2	002155	辰州矿业	97,833,715.92	1.84
3	002142	宁波银行	91,779,174.98	1.73
4	002152	广电运通	65,431,420.45	1.23
5	002092	中泰化学	60,762,604.73	1.14
6	002172	澳洋科技	55,617,308.82	1.05
7	002146	荣盛发展	47,585,661.42	0.90
8	002073	青岛软控	47,274,647.00	0.89
9	002202	金风科技	44,132,958.23	0.83
10	002153	石基信息	40,051,000.70	0.75
11	002106	莱宝高科	32,508,066.57	0.61
12	002122	天马股份	31,028,685.18	0.58
13	002140	东华科技	29,588,049.70	0.56
14	002129	中环股份	29,215,176.89	0.55
15	002123	荣信股份	27,304,862.53	0.51
16	002083	孚日股份	27,186,324.37	0.51
17	002048	宁波华翔	24,288,859.28	0.46
18	002156	通富微电	23,889,048.26	0.45
19	002069	獐子岛	22,098,000.83	0.42
20	002104	恒宝股份	20,434,620.84	0.38

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	002024	苏宁电器	185,306,628.67	3.49
2