华富成长趋势股票型证券投资基金2008年年度报告摘要

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2009年03月27日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年3月26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

基金名称	华富成长趋势股票型证券投资基金
基金简称	410003
基金主代码	002077
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年03月19日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,883,463,765.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密追踪成长趋势股票型证券投资基金指数,力求实现与指数长期收益率相一致的投资回报。
投资策略	1.资产配置策略;2.股票投资策略;3.债券投资策略;4.权证投资策略;5.股指期货投资策略;6.资产支持证券投资策略;7.中小板投资策略;8.风险管理策略。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信全债指数
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,其风险收益特征预期高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于较高风险、较高收益的证券投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

名称		华富基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		陈信健	秦晓
联系人		王晓曦	杨春
联系电话		021-68886996	0755-83079084
电子信箱		manzh@hffund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	95555
传真		021-68887997	0755-83195201

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标和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

单位:人民币元

3.1.1 期末数据和指标	2008年	2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日
净利润	-956,605,622.38	1,463,769,856.53
扣除公允价值变动损益前净利润	-2,139,752,386.22	1,975,043,265.84
加权平均基金份额利润	-0.7063	0.4264
加权平均净值利润率	-59.77%	49.33%
期末可分配利润	0.4701	1.1684

3.1.2 期末数据和指标	2008年末	2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.5299	0.7773
期末基金资产净值	1,355,505,551.06	4,074,514,403.97
期末基金份额净值	0.4701	1.1684

注:1)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。

2)以上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(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)对采用份额净值计算或计算公式中含有N的财务指标,均使用对外披露的净值数据及相应的时点(N为报告期内所含的交易天数)。

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	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	-15.30%	2.32%	-13.48%	2.40%	-1.82%	-0.08%
过去三个月	-31.98%	2.37%	-26.72%	2.36%	-5.26%	0.01%
过去六个月	-59.77%	2.40%	-54.88%	2.40%	-4.89%	0.00%
自基金合同生效起至今(2007年3月19日至2008年12月31日)	-59.77%	2.13%	-21.22%	2.15%	-18.70%	-0.02%

注:业绩比较基准收益率=80%×中信标普300指数+20%×中信全债指数,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

单位:人民币元

时间	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日	47,235,565.43	2,317,322.27	196,070,851.77
2008年1月1日至2008年12月31日	1,882,264.36	5,452,039.40	-3,570,775.04
自基金合同生效日起至今	2,260,000.00	2,855,282.34	-595,282.34

注:根据《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票60%-95%,债券资产的配置比例为0-35%,权证的配置比例为0-3%,现金或者到期日在1年以内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的5%,本基金建仓期为2007年3月19日至9月19日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的规定。

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

年度	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日	47,235,565.43	2,317,322.27	196,070,851.77
2008年1月1日至2008年12月31日	1,882,264.36	5,452,039.40	-3,570,775.04
自基金合同生效日起至今	2,260,000.00	2,855,282.34	-595,282.34

注: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 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	应分配利润	实际分配数	留存利润	分配率
2008年	-	-	-	-
2007年	2,900	643,792,266.13	399,622,962.10	1,043,415,228.23	-
合计	2,900	643,792,266.13	399,622,962.10	1,043,415,228.23	-

§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

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立,注册资本1.2亿元,由华安证券有限责任公司,安徽省创新投资有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司共同出资设立。基金管理人于2005年3月02日发起成立并管理其第一只开放式基金——华富竞争力优选混合型证券投资基金。2006年6月21日发起成立并管理其第二只开放式基金——华富货币市场基金。2007年3月19日发起成立并管理其第三只开放式基金——华富成长趋势股票型证券投资基金。2008年5月28日发起成立并管理其第四只开放式基金——华富收益增强债券型证券投资基金。2008年12月24日发起成立并管理其第五只开放式基金——华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金。

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		
张平	本基金的基金经理	2008年03月06日	-	7年	张平先生,经济学硕士,曾任华安证券有限责任公司证券投资部研究员、华安证券有限责任公司证券投资部基金经理、华安证券有限责任公司证券投资部总经理助理、华安证券有限责任公司证券投资部总经理。现任华富基金管理有限公司基金经理。2005年3月02日至2007年3月19日,担任华富竞争力优选混合型证券投资基金的基金经理。2006年6月21日至2007年3月19日,担任华富货币市场基金的基金经理。2007年3月19日至2008年5月28日,担任华富成长趋势股票型证券投资基金的基金经理。2008年5月28日至2008年12月31日,担任华富收益增强债券型证券投资基金的基金经理。2008年12月24日至2008年12月31日,担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王晓曦	本基金的基金经理	2008年03月06日	-	8年	王晓曦女士,经济学硕士,曾任华安证券有限责任公司证券投资部研究员、华安证券有限责任公司证券投资部基金经理、华安证券有限责任公司证券投资部总经理助理、华安证券有限责任公司证券投资部总经理。现任华富基金管理有限公司基金经理。2005年3月02日至2007年3月19日,担任华富竞争力优选混合型证券投资基金的基金经理。2006年6月21日至2007年3月19日,担任华富货币市场基金的基金经理。2007年3月19日至2008年5月28日,担任华富成长趋势股票型证券投资基金的基金经理。2008年5月28日至2008年12月31日,担任华富收益增强债券型证券投资基金的基金经理。2008年12月24日至2008年12月31日,担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在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

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定,在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

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

无

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为发生。

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 业绩表现

截至2008年12月31日,本基金份额净值为0.4701元,累计基金份额净值为0.7601元。在本报告期内,本基金份额净值增长率为-59.77%,同期业绩比较基准收益率为-54.88%。

4.4.2 2008年投资运作

2008年中国股票市场受多重因素的严峻挑战,首先是次贷危机导致各国需求下滑降低了中国总体出口预期,而以石油、煤炭、矿石为代表的基础原材料价格的暴涨暴跌在2008年前10个月的直接影响是挤压中下游企业的盈利,年末则表现为企业库存积压、大额减值准备同样降低企业的盈利水平,从实际和预期两方面看企业的利润水平都有下滑;其次由于居民消费物价指数(CPI)和生产资料价格指数(PPI)的高企导致央行开始收缩市场的流动性并加以较严厉的信贷额度控制,市场资金成本不断走高,与此同时宏观基本面面临较大不确定性,这些因素不断地降低投资者愿意接受的股票市场的估值水平,预期盈利下滑和估值水平下跌的双重压力导致股票市场下跌的双重压力导致股票市场的运行格局,虽然印花税降低等一些扶持股票市场的政策曾激发过市场在较短期的反弹,但最终难以逆转市场下跌的态势,全年上证指数下跌幅度达到65.39%。

2008年华富成长趋势基金的净值跟随市场出现了较大幅度的下跌,虽然我们坚持了大多数价值投资的品种,而这些品种的盈利水平也要略好于市场平均,但整体估值水平的下降同样给基金的净值带来的较大的下跌幅度。对全年的投资,虽然我们也短期参与过部分行业品种的轮动机会,但我们坚持将成长性确定的蓝筹品种作为核心资产,坚持对价值投资进一步深化,注重研究公司发展趋势、行业变化格局,这将是华富成长趋势基金获得收益和抵御市场风险最重要的手段。

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年中国宏观经济,全球金融海啸的进一步深化可能给中国经济尤其是出口带来较大压力,而对未来预期的不确定可能降低人们对消费的需求。不过2008年10月以来中国政府采取的一系列刺激经济的财政货币政策将在很多程度上对冲出口下滑和房地产投资下滑的负面效果,而启动内需、促进经济转型的政策导向也有望使中国经济在全球经济中来先走出低谷,保持较高速度的增长。

对于证券市场而言,全球金融海啸的波及以及年初企业盈利数据同比下滑可能会短期内制约投资者对股票市场的上涨预期。不过由于估值水平的纵比优势、较宽松的货币环境、经济数据环比的向好都支持股票市场向好的中长期方向。综上上两方面我们认为2009年股票市场不需要过分悲观,至少估值水平整体下移的风险不大,虽然市场短期可能受到负面因素的影响出现区间震荡,而中长期向好的走势应该能持续。从操作上看,我们将首先监测宏观的先行指标,在确定经济增长基本形成的情况下积极寻找合适的标的,我们的重点仍然是寻找较合理估值水平下的确定性成长,利用非同步的估价值是我们所追求的目标。从行业配置中仍然会把持续增长的食品饮料、商业零售、医药、保险为代表的消费类公司做一些重点配置,而受到积极财政政策正面影响工程机械、水泥、电力设备也是我们重点配置的领域,我们会继续关注水平较合理的银行、港口股块,我们也会关注新能源、节能减排、经济转型等主题投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定,成立了估值委员会,并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由天健光华(北京)会计师事务所进行审核并出具报告,由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司运作保障部总监,成员包括总经理、督察长、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期出现亏损,按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,未进行利润分配。

§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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《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,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回的价格、计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本基金2008年年度财务会计报告经天健光华(北京)会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了天健光华审[2009]JR字第070002号"标准无保留意见的审计报告",投资者欲了解审计报告全文,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华富成长趋势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	附注号	2008年12月31日	2007年12月31日
银行存款	7.4.7.1	47,235,565.43	196,070,851.77
结算备付金		1,882,264.36	5,452,039.40
存出保证金		2,260,000.00	2,855,282.34
交易性金融资产	7.4.7.2	1,304,525,175.50	3,633,450,230.16
其中:股票投资		997,731,968.48	3,433,121,204.16
债券投资		-	-
权证投资		306,793,207.02	200,329,026.00
买入返售证券		-	-
应收证券清算款	7.4.7.3	-	2,618,971.20
应收利息	7.4.7.4	-	196,000,294.00
其中:应收股利		2,970,088.55	50,227,849.55
其他资产	7.4.7.5	2,124,693.84	5,561,362.06
资产总计		-	-
其中:交易单元席位证券清算款		356,080.77	7,653,822.88
应付证券清算款		-	-
应付赎回款	7.4.7.6	-	-
应付管理人报酬		1,361,353,868.45	4,099,890,703.36
应付托管费		-	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,003,082.76	1,506,343.94
其中:交易所市场交易费用		-	-
其他负债	7.4.7.14	5,871,182.16	1,094,133.01
其中:卖出回购证券款	7.4.7.15	17,901,405.38	31,870,783.80
负债合计	7.4.7.16	-1,183,146,763.84	511,273,409.31
其中:交易单元席位证券清算款		-	-
实收基金	7.4.7.17	846,818.20	6,954,093.56
其中:部分赎回申请		-70,615,986.92	-154,727,616.25
未分配利润		-34,527,872.28	-62,854,326.10
其中:未实现利得		-5,754,645.36	-10,475,721.12
其中:已实现利得		-	-
其中:未分配利润	7.4.7.18	-29,510,625.68	-80,946,876.68
其中:未实现利得		-303,635.21	-
其中:已实现利得		-303,635.21	-
净资产	7.4.7.19	-519,208.39	-450,692.35
其中:可赎回份额净值		-2,139,752,386.22	1,975,043,265.84
其中:不可赎回份额净值		-	-
净资产合计		-2,139,752,386.22	1,975,043,265.84

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富成长趋势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

	2008年1月1日至2008年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净值合计
期初净资产	3,487,305,225.72	587,209,178.25	4,074,514,403.97
期初可赎回份额净值	-	-2,139,752,386.22	-2,139,752,386.22
期初不可赎回份额净值	-	-	-
期初净资产合计	3,487,305,225.72	-1,552,543,207.97	1,934,761,017.75
本期利润	-603,841,460.56	24,584,993.87	-579,256,466.69
其中:未实现利得	157,933,196.03	-9,428,599.41	148,504,596.62
其中:已实现利得	-761,774,656.59	34,013,593.28	-727,761,063.31
本期基金份额净值增长率	-	-	-
其中:未实现利得	-	-	-
其中:已实现利得	-	-	-
本期申购基金份额	2,883,463,765.16	-1,527,958,214.10	1,355,505,551.06
其中:申购款	6,777,723,584.78	-	6,777,723,584.78
其中:红利再投资	-	1,975,043,265.84	1,975,043,265.84
本期赎回份额净值减少	-3,290,418,359.06	-344,418,859.36	-3,634,837,218.42
其中:赎回款	1,503,172,148.94	425,156,292.92	1,928,328,441.86
其中:红利再投资	-4,793,590,508.00	-769,575,152.28	-5,563,165,660.28
本期基金份额净值减少	-	-1,043,415,228.23	-1,043,415,228.23
其中:未实现利得	-	-	-
其中:已实现利得	-	-1,043,415,228.23	-1,043,415,228.23
期末净资产	3,487,305,225.72	587,209,178.25	4,074,514,403.97

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富成长趋势股票型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》发起,经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]50号文核准募集设立。本基金自2007年3月12日起公开向社会发行,至2007年3月14日募集结束。天健华证中洲(北京)会计师事务所(现已更名为天健光华(北京)会计师事务所)验资并出具天健华证中洲验2007]JR字第070001号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本次募集资金总额6,777,158,977.43元;募集资金的银行存款利息564,607.35元,折成基金份额,归投资人所有;设立募集期共募集6,777,723,584.78份基金单位。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为华富基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2007年3月19日生效,该日的基金份额为6,777,723,584.78份基金单位。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制会计报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2008年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金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等有关信息。

7.4.4 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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(2008]38号公告),以及中国证券业协会基金估值工作小组《关于单牌股票估值的参考方法》的内容和有关要求,自2008年9月16日起,本基金对中长期单牌股票等无市价的投资品种采用指数收益法进行估值,行业指数选取沪深交易所公开发布的相关行业分类指数为标准。2008年9月16日,本基金因长期单牌股票按照上述估值办法进行调整,使基金资产净值较2008年9月12日下降了1.66%。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[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》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项如下:

7.4.5.1 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

7.4.5.2 基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收营业税。

7.4.5.3 对基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20.00%的个人所得税。(注:自2005年6月13日起,基金从上市公司取得的股息红利所得减按50.00%计算应纳税所得额。)

7.4.5.4 基金买卖股票,经国务院批准,从2008年4月24日起证券(股票)交易印花税税率由3‰调整为1‰。经国务院批准,从2008年9月19日起,对证券交易印花税政策进行调整,由双边征收改为向卖方单边征收,税率保持1‰。

7.4.5.5 基金作为流通股股东,在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构、基金会计核算机构、基金估值机构、基金投资顾问
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构、基金托管人的控股股东
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
安徽省创新投资有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰控股集团有限公司	基金管理人的股东
华安证券有限责任公司	基金管理人的股东
天健光华(北京)会计师事务所有限公司	基金会计核算机构、基金估值机构、基金投资顾问

7.4.6.1 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

本报告期内本基金管理人华富基金管理有限公司第二大股东安徽省创新投资有限公司已被吸收合并为安徽省信用担保集团有限公司,本基金管理人华富基金管理有限公司向中国证券监督管理委员会提出了章程修改和股东变更的申请。中国证券监督管理委员会经过审核,下发了证监许可[2008]759号文件,核准了公司章程的修改以及股东变更的申请。本基金管理人华富基金管理有限公司于2008年9月26日完成了工商变更登记手续。

本报告期发生变化的关联方情况如下:

原关联方名称	现关联方名称
安徽省创新投资有限公司	安徽省信用担保集团有限公司

7.4.6.2 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
华富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构、基金会计核算机构、基金估值机构、基金投资顾问
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构、基金托管人的控股股东

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 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3月19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
招商证券股份有限公司	2,721,211,767.96	31.04%	5,055,356,813.18	20.99%

债券交易

关联方名称	2008年1月1日至2008年12月31日		2007年3月19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
招商证券股份有限公司	5,621,928.00	3.85%	-	-

回购交易

关联方名称	2008年1月1日至2008年12月31日		2007年3月19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
招商证券股份有限公司	-	-	20,000,000.00	100.00%

7.4.7.1.2 权证交易

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3月19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
招商证券股份有限公司	5,115,396.31	16.42%	-	-

7.4.7.1.3 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			
	当期佣金总额	佣金总额的比例	期末应付佣金余额	期末应付佣金余额的比例
招商证券股份有限公司	2,313,004.79	31.37%	58,851.92	7.37%
	2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日			
招商证券股份有限公司	4,145,369.34	21.27%	833,303.30	21.82%

注:上述佣金按市场佣金率计算。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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

当期发生的基金应支付的管理费	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日
其中:支付销售机构的客户维护费	34,527,872.28	62,854,326.10
其中:支付基金管理人的管理费	32,742,766.53	57,677,647.78
其中:支付基金托管人的托管费	1,785,105.75	5,176,678.32

注:基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年管理费率÷当年天数(H为每日应计提的基金管理费,E为前一日基金资产净值)。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

当期发生的基金应支付的托管费	2008年1月1日至2008年12月31日	2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日
其中:支付销售机构的客户维护费	5,754,645.36	10,475,721.12
其中:支付基金管理人的管理费	5,457,127.72	9,612,941.40
其中:支付基金托管人的托管费	297,517.64	862,779.72

注:基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年托管费率÷当年天数(H为每日应计提的基金托管费,E为前一日基金资产净值)。

7.4.7.3 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

关联方名称	2008年1月1日至2008年12月31日				2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	债券买入金额	债券买入总额的比例	债券卖出金额	债券卖出总额的比例	债券买入金额	债券买入总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
	2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日					
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
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	-	-

7.4.7.4.2 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	2008年1月1日至2008年12月31日		2007年3月19日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	期初持有的基金份额	期末持有的基金份额	期初持有的基金份额	期末持有的基金份额
华富基金管理有限公司	-	-	-	-

7.4.7.5 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3月19日(基金合同生效日)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
招商银行股份有限公司	47,235,565.43	2,317,322.27	196,070,851.77	7,627,156.67

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.7.6 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

证券代码	发行日	发行价格	数量	市值	市值占基金资产净值比例
600900	2008年5月6日	15.00	7,000,000	105,000,000.00	2.58%
600030	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
601318	2008年5月6日	60.00	1,500,000	90,000,000.00	2.21%
600009	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
600028	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
600900	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
600026	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
601390	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
601398	2008年5月6日	5.00	18,000,000	90,000,000.00	2.21%
600004	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
600725	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
601628	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
601857	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
600489	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
000060	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
000157	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%
002038	2008年5月6日	15.00	6,000,000	90,000,000.00	2.21%

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

买入股票的成本总额	4,232,341,095.95
卖出股票的收入总额	4,564,173,924.90

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

债券品种	期末公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	-	-
2	68,558,000.00	5.06%
3	125,250,000.00	9.24%
4	125,250,000.00	9.24%
5	-	-
6	40,264,000.00	2.97%
7	72,721,207.02	5.36%
8	-	-
9	306,793,207.02	22.63%

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

债券代码	债券名称	期末公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	080310	1,000,000	7.65%
2	0801098	700,000	5.06%
3	0881244	400,000	2.97%
4	110002	415,030	2.85%