

# 华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金 2008 年年度报告摘要

2008 年 12 月 31 日

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。

## 1.2 目录

|     |   |    |
|-----|---|----|
| 1   | 重要提示及目录.....  | 2  |
| 1.1 | 重要提示.....   | 2  |
| 1.2 | 目录.....   | 3  |
| 2   | 基金简介.....   | 5  |
| 2.1 | 基金基本情况.....   | 5  |
| 2.2 | 基金产品说明.....   | 5  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人.....                                    | 5  |
| 2.4 | 信息披露方式.....   | 6  |
| 3   | 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                           | 6  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标.....                                    | 6  |
| 3.2 | 基金净值表现.....   | 6  |
| 3.3 | 过去三年基金的利润分配情况.....                                  | 8  |
| 4   | 管理人报告.....  | 8  |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况.....                                   | 8  |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....                         | 8  |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                            | 9  |
| 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..... | 9  |
| 4.5 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                           | 10 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                            | 10 |
| 5   | 托管人报告.....  | 10 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                             | 10 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....            | 10 |
| 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.....                 | 11 |
| 6   | 审计报告.....   | 11 |
| 7   | 年度财务报表.....   | 11 |
| 7.1 | 资产负债表.....  | 11 |
| 7.2 | 利润表.....  | 12 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表.....                                 | 13 |
| 7.4 | 报表附注.....   | 14 |
| 8   | 投资组合报告.....   | 17 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况.....                                     | 17 |
| 8.2 | 期末按行业分类的股票投资组合.....                                 | 18 |
| 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.....                 | 18 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动.....                                | 19 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                               | 21 |
| 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.....                 | 22 |
| 8.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细.....             | 22 |
| 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.....                 | 22 |
| 8.9 | 投资组合报告附注.....                                       | 22 |
| 9   | 基金份额持有人信息.....                                      | 23 |

|      |                                   |    |
|------|-----------------------------------|----|
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....           | 23 |
| 9.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....     | 23 |
| 10   | 开放式基金份额变动 .....                   | 23 |
| 11   | 重大事件揭示 .....                      | 24 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                 | 24 |
| 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 ..... | 24 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 24 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 .....                   | 24 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....            | 24 |
| 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 .....    | 24 |
| 11.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....         | 24 |
| 12   | 影响投资者决策的其他重要信息 .....              | 26 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金简称       | 多策略增长基金             |
| 交易代码       | 240005              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2004 年 5 月 11 日     |
| 报告期末基金份额总额 | 14,235,675,056.88 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 通过各风格板块间资产配置以及各板块内精选个股,在控制风险的前提下为持有人谋求最大回报。  |
| 投资策略   | 本基金看好中国经济的发展前景和证券市场存在的投资机会,注重资产在各风格板块间的配置,同时在各风格板块内部精选个股。  |
| 业绩比较基准 | 80%×上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数+20%×上证国债指数<br>复合指数=(上证 180 流通市值/成分指数总流通市值)×上证 180 指数+(深圳 100 流通市值/成分指数总流通市值)×深证 100 指数<br>成分指数总流通市值=上证 180 流通市值+深圳 100 流通市值 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。   |

### 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 | xxp1@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           |
|---------------|-------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | -823,270,460.63   | 1,511,384,033.98 | 895,332,410.96   |
| 本期利润          | -4,151,593,081.18 | 1,568,078,697.91 | 1,207,035,916.62 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3307           | 1.6957           | 0.8681           |
| 本期基金份额净值增长率   | -37.79%           | 138.71%          | 106.10%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2008 年            | 2007 年           | 2006 年           |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0388           | 0.5419           | 0.6149           |
| 期末基金资产净值      | 6,470,226,495.20  | 3,198,192,617.33 | 1,415,586,959.16 |
| 期末基金份额净值      | 0.4545            | 2.2228           | 1.7737           |

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      | -5.57%   | 1.63%       | -14.14%    | 2.44%         | 8.57%   | -0.81% |
| 过去六个月      | -18.98%  | 1.70%       | -27.21%    | 2.41%         | 8.23%   | -0.71% |
| 过去一年       | -37.79%  | 1.79%       | -55.80%    | 2.44%         | 18.01%  | -0.65% |
| 过去三年       | 206.04%  | 1.71%       | 84.45%     | 1.90%         | 121.59% | -0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 190.62%  | 1.49%       | 55.98%     | 1.66%         | 134.64% | -0.17% |

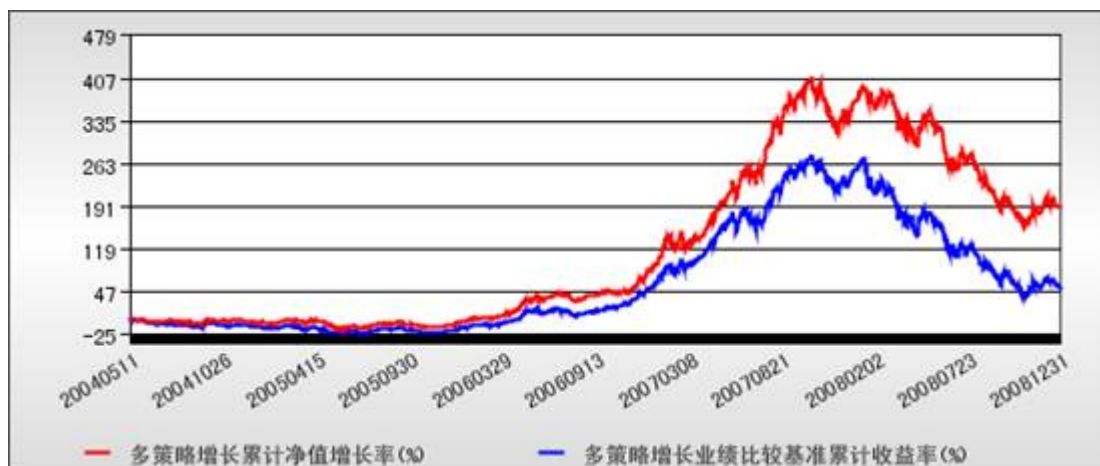
注：本基金业绩比较基准为： $80\% \times \text{上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数} + 20\% \times \text{上证国债指数复合指数} = (\text{上证 180 流通市值} / \text{成分指数总流通市值}) \times \text{上证 180 指数} + (\text{深圳 100 流通市值} / \text{成分指数总流通市值}) \times \text{深证 100 指数}$

成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深圳 100 流通市值

流通市值采用上一交易日收盘市值

### 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

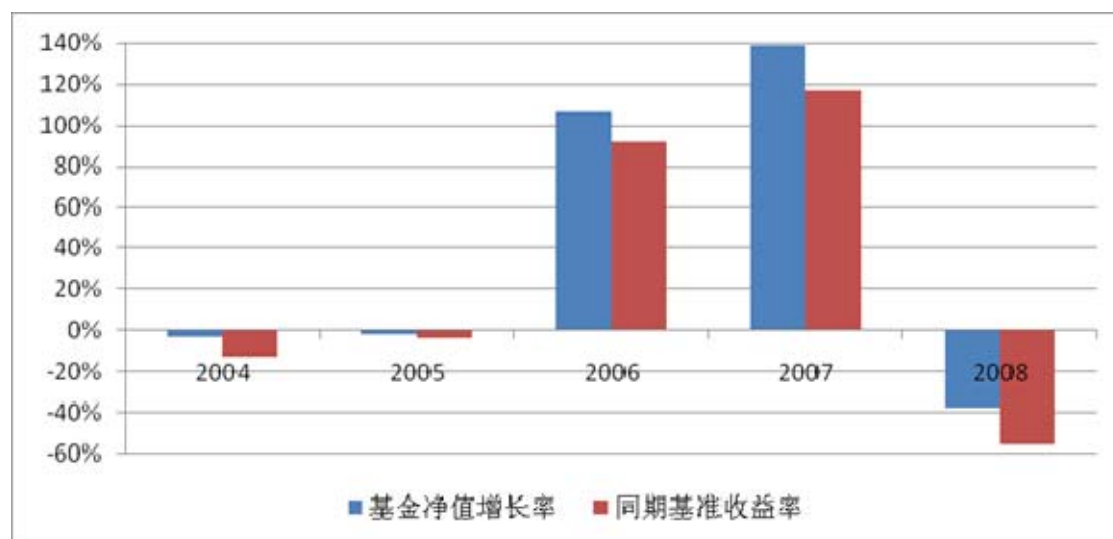
华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2004 年 5 月 11 日至 2008 年 12 月 31 日)



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 2004 年 11 月 11 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

华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金  
 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 过去三年基金的利润分配情况

| 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         |
|-------|-------------|------------------|------------------|------------------|
| 2008年 | 2.200       | 1,300,886,579.75 | 940,962,440.95   | 2,241,849,020.70 |
| 2007年 | 20.000      | 1,213,033,061.30 | 840,587,592.08   | 2,053,620,653.38 |
| 2006年 | 1.200       | 141,118,926.06   | 16,810,183.23    | 157,929,109.29   |
| 合计    | 23.400      | 2,655,038,567.11 | 1,798,360,216.26 | 4,453,398,783.37 |

## 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

基金管理人是在 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、本基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、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 |        |   |
| 牟旭东 | 本基金基金经理 | 2007 年 10 月 11 日 | -    | 11 年   | 硕士。1997 年 9 月至 2003 年 1 月在南方证券有限公司从事证券研究工作，2003 年 1 月加入本公司，任高级分析师，2004 年 9 月起任研究部副总经理，2007 年 9 月起任研究部总经理。 |

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、《华宝兴业多策略增长开放式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，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。



由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，多策略投资基金在短期内出现过投资总比例略低于 80%的情况以及股票投资比例略低于 50%的情况。发生此类情况后，基金在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

#### 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

本基金主要采用在各风格板块间的资产配置及在各板块内精选个股的策略进行投资，隶属于风格轮动基金。

回顾 2008 年，A 股市场经历了有史以来最为惨烈的一次单边的下跌。本基金在年初进行了一次大比例的现金分红，并通过控制仓位以及适度地风格轮动，控制了基金净值的损失程度。

纵观 2008 年全年，尽管市场出现多次反弹，但都极为短暂。尤其是在进入第四季度，市场出现剧烈变化，主要是由于百年一遇的全球性经济进一步衰退的大环境所导致的。本基金这一阶段在低位适当增加了仓位。在第四季度，市场在急跌之后，出现了一轮较为明显的上涨，尤其是以中小市值为代表的个股涨幅较大。在此轮的风格轮动中，本基金适度布局了一些中小盘，取得了一定效果。但由于本基金的规模偏大，存在一定的流动性问题，因此风格轮动的策略受到一定的制约。

展望 2009，本基金认为大级别的系统性的风险已经基本释放，市场由急跌的趋势进入了缓跌的态势。从基本经济面分析，宏观经济出现大面积好转的可能性不大，上市公司业绩也很难回升

到前期的增长。尤其是大小非在 09 年依然处于集中解禁期，市场依然需要对这类股权进行充分的消化。但不排除，因信贷极度宽松环境下，市场出现超跌反弹。因此，在这种大背景下，加强风格轮动，发挥本基金的特点是 09 年的重点。

进行证券研究能够让投资人在市场下跌时坚定信心，我们需要依照已经明确的思路和主线，耐心持有，收获最终的成果。同时，我们也将继续按照基金契约的规定，把握市场风格板块的变化，在转化中捕捉大类资产的投资机会，不断为持有人创造回报。

#### 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 & 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-0.0388 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，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进行了调整，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、投资组合报告等信息，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：华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

|                 | 附注号 | 2008 年 12 月 31 日 | 2007 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-----|------------------|------------------|
| <b>资产：</b>      |     |                  |                  |
| 银行存款            |     | 626,456,077.43   | 471,087,136.18   |
| 结算备付金           |     | 3,341,310.57     | 5,519,910.63     |
| 存出保证金           |     | 853,919.60       | 2,927,322.13     |
| 交易性金融资产         |     | 5,808,439,081.01 | 2,704,057,003.95 |
| 其中：股票投资         |     | 3,540,967,382.41 | 2,487,481,175.95 |
| 债券投资            |     | 2,267,471,698.60 | 216,575,828.00   |
| 资产支持证券投资        |     | -                | -                |
| 衍生金融资产          |     | -                | 1,436,231.11     |
| 买入返售金融资产        |     | -                | -                |
| 应收证券清算款         |     | -                | 651,031.36       |
| 应收利息            |     | 56,688,068.65    | 5,056,918.09     |
| 应收股利            |     | -                | -                |
| 应收申购款           |     | 3,749,771.76     | 24,741,627.66    |
| 递延所得税资产         |     | -                | -                |
| 其他资产            |     | 49,635.48        | -                |
| 资产总计            |     | 6,499,577,864.50 | 3,215,477,181.11 |
| <b>负债和所有者权益</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       |           | 11,493,832.68    | 2,107,895.84     |
| 应付赎回款         |           | 5,784,188.53     | 7,736,677.60     |
| 应付管理人报酬       | 7.4.3.2.1 | 8,368,315.71     | 3,827,567.30     |
| 应付托管费         | 7.4.3.2.2 | 1,394,719.27     | 637,927.89       |
| 应付销售服务费       |           | -                | -                |
| 应付交易费用        |           | 1,884,698.45     | 2,393,050.35     |
| 应交税费          |           | 13,127.20        | 6,101.60         |
| 应付利息          |           | -                | -                |
| 应付利润          |           | -                | -                |
| 递延所得税负债       |           | -                | -                |
| 其他负债          |           | 412,487.46       | 575,343.20       |
| 负债合计          |           | 29,351,369.30    | 17,284,563.78    |
| <b>所有者权益：</b> |           |                  |                  |
| 实收基金          |           | 6,203,491,172.07 | 1,438,833,616.55 |
| 未分配利润         |           | 266,735,323.13   | 1,759,359,000.78 |
| 所有者权益合计       |           | 6,470,226,495.20 | 3,198,192,617.33 |
| 负债和所有者权益总计    |           | 6,499,577,864.50 | 3,215,477,181.11 |

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4545 元，基金份额总额 14,235,675,056.88 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

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<br>至 2008 年 12 月 31 日 | 2007 年 1 月 1 日<br>至 2007 年 12 月 31 日 |
|-------------------|-----|--------------------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |     | -3,971,917,451.28                    | 1,662,704,266.90                     |
| 1. 利息收入           |     | 75,782,642.02                        | 3,968,096.33                         |
| 其中：存款利息收入         |     | 14,283,505.32                        | 2,738,612.78                         |
| 债券利息收入            |     | 61,499,136.70                        | 1,229,483.55                         |
| 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） |     | -723,436,961.11                      | 1,599,885,918.22                     |
| 其中：股票投资收益         |     | -783,410,965.69                      | 1,574,014,502.52                     |
| 债券投资收益            |     | -3,596,051.54                        | -95,661.92                           |

|                            |           |                          |                         |
|----------------------------|-----------|--------------------------|-------------------------|
| 资产支持证券投资收益                 |           | -                        | -                       |
| 衍生工具收益                     |           | 8,627,915.36             | 18,097,279.70           |
| 股利收益                       |           | 54,942,140.76            | 7,869,797.92            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     |           | -3,328,322,620.55        | 56,694,663.93           |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |           | -                        | -                       |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |           | 4,059,488.36             | 2,155,588.42            |
| <b>二、费用（以“-”号填列）</b>       |           | <b>-179,675,629.90</b>   | <b>-94,625,568.99</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.3.2.1 | -114,511,479.70          | -33,933,082.43          |
| 2. 托管费                     | 7.4.3.2.2 | -19,085,246.59           | -5,655,513.75           |
| 3. 销售服务费                   |           | -                        | -                       |
| 4. 交易费用                    |           | -42,953,195.12           | -53,237,199.17          |
| 5. 利息支出                    |           | -2,594,395.50            | -1,334,450.62           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | -2,594,395.50            | -1,334,450.62           |
| 6. 其他费用                    |           | -531,312.99              | -465,323.02             |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | <b>-4,151,593,081.18</b> | <b>1,568,078,697.91</b> |
| 所得税费用（以“-”号填列）             |           | -                        | -                       |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | <b>-4,151,593,081.18</b> | <b>1,568,078,697.91</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

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）                        | 1,438,833,616.55                 | 1,759,359,000.78  | 3,198,192,617.33  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | -4,151,593,081.18 | -4,151,593,081.18 |
| 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）      | 4,764,657,555.52                 | 4,900,818,424.23  | 9,665,475,979.75  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 7,124,252,655.09                 | 5,899,585,322.59  | 13,023,837,977.68 |
| 2. 基金赎回款                               | -2,359,595,099.57                | -998,766,898.36   | -3,358,361,997.93 |
| 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） | -                                | -2,241,849,020.70 | -2,241,849,020.70 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,203,491,172.07                 | 266,735,323.13    | 6,470,226,495.20  |

| 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）                        | 798,095,530.00                   | 617,491,429.16    | 1,415,586,959.16  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 1,568,078,697.91  | 1,568,078,697.91  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）        | 640,738,086.55                   | 1,627,409,527.09  | 2,268,147,613.64  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,484,607,236.78                 | 2,739,778,064.45  | 4,224,385,301.23  |
| 2. 基金赎回款                               | -843,869,150.23                  | -1,112,368,537.36 | -1,956,237,687.59 |
| 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） | -                                | -2,053,620,653.38 | -2,053,620,653.38 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,438,833,616.55                 | 1,759,359,000.78  | 3,198,192,617.33  |

## 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141,843,160.96元，相应调减本基金的净利润141,843,160.96元和基金资产净值141,843,160.96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        |
| 华宝信托有限责任公司   | 基金管理人的股东            |
| 法国兴业资产管理有限公司<br>(Société Générale Asset Management SA) | 基金管理人的股东            |
| 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        |

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单位进行交易。

##### 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        | 2008年1月1日<br>至2008年12月31日 | 2007年1月1日<br>至2007年12月31日 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 当期应支付的管理费 | 114,511,479.70            | 33,933,082.43             |
| 其中：当期已支付  | 106,143,163.99            | 30,105,515.13             |
| 期末未支付     | 8,368,315.71              | 3,827,567.30              |

注：支付基金管理人华宝兴业的基金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<br>至2008年12月31日 | 2007年1月1日<br>至2007年12月31日 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 当期应支付的托管费 | 19,085,246.59             | 5,655,513.75              |
| 其中：当期已支付  | 17,690,527.32             | 5,017,585.86              |
| 期末未支付     | 1,394,719.27              | 637,927.89                |

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                           | -      | -    | -     | -    | 1,488,000,000.00 | 632,275.07 |
| 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                           | -      | -    | -     | -    | -                | -          |

#### 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

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 |
|-------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 期初持有的基金份额         | 77,519.37                        | -                                |
| 期间认购总份额           | -                                | -                                |
| 期间申购/买入总份额        | 587,621.73                       | 77,519.37                        |
| 期间因拆分增加的份额        | 100,370.84                       | -                                |
| 期间赎回/卖出总份额        | -                                | -                                |
| 期末持有的基金份额         | 765,511.94                       | 77,519.37                        |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.0054%                          | 0.0054%                          |

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎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 | 626,456,077.43                   | 14,105,120.69 | 471,087,136.18                   | 2,507,439.19 |

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     | 19,803,502 | 353,630,384.21 | 145,555,739.70 |
| 600886 | 国投电力 | 08/12/09 | 资产重组 | 9.13   | 09/03/04 | 10.04  | 1,999,966  | 18,727,579.35  | 18,259,689.58  |
| 000792 | 盐湖钾肥 | 08/06/26 | 资产重组 | 56.78  | 08/12/26 | 78.23  | 181,100    | 14,326,361.12  | 10,282,858.00  |

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     | 3,540,967,382.41 | 54.48        |
|    | 其中：股票    | 3,540,967,382.41 | 54.48        |
| 2  | 固定收益投资   | 2,267,471,698.60 | 34.89        |
|    | 其中：债券    | 2,267,471,698.60 | 34.89        |
|    | 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<br>买入返售金融资产 | -                | -      |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计          | 629,797,388.00   | 9.69   |
| 6 | 其他资产                  | 61,341,395.49    | 0.94   |
| 7 | 合计                    | 6,499,577,864.50 | 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       | 82,171,824.35    | 1.27         |
| B   | 采掘业            | 364,278,737.21   | 5.63         |
| C   | 制造业            | 1,448,946,743.81 | 22.39        |
| C0  | 食品、饮料          | 175,735,338.91   | 2.72         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 31,192,206.58    | 0.48         |
| C2  | 木材、家具          | -                | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | 2,015,974.00     | 0.03         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 398,490,555.90   | 6.16         |
| C5  | 电子             | 42,063,483.89    | 0.65         |
| C6  | 金属、非金属         | 321,255,130.02   | 4.97         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 198,384,774.53   | 3.07         |
| C8  | 医药、生物制品        | 275,367,467.84   | 4.26         |
| C99 | 其他制造业          | 4,441,812.14     | 0.07         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 181,639,423.71   | 2.81         |
| E   | 建筑业            | 70,154,841.36    | 1.08         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 116,881,401.88   | 1.81         |
| G   | 信息技术业          | 346,036,035.63   | 5.35         |
| H   | 批发和零售贸易        | 226,187,495.15   | 3.50         |
| I   | 金融、保险业         | 274,466,962.89   | 4.24         |
| J   | 房地产业           | 259,871,162.55   | 4.02         |
| K   | 社会服务业          | 39,417,317.68    | 0.61         |
| L   | 传播与文化产业        | -                | -            |
| M   | 综合类            | 130,915,436.19   | 2.02         |
|     | 合计             | 3,540,967,382.41 | 54.73        |

## 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  | 600588 | 用友软件 | 12,064,327 | 265,415,194.00 | 4.10 |
| 2  | 002001 | 新和成  | 10,254,273 | 252,050,030.34 | 3.90 |
| 3  | 600028 | 中国石化 | 31,063,938 | 218,068,844.76 | 3.37 |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 12,489,887 | 151,877,025.92 | 2.35 |
| 5  | 600900 | 长江电力 | 19,803,502 | 145,555,739.70 | 2.25 |
| 6  | 600895 | 张江高科 | 11,132,149 | 111,210,168.51 | 1.72 |
| 7  | 600488 | 天药股份 | 19,438,671 | 109,050,944.31 | 1.69 |
| 8  | 000877 | 天山股份 | 9,146,566  | 97,136,530.92  | 1.50 |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 26,779,436 | 94,799,203.44  | 1.47 |
| 10 | 000402 | 金融街  | 11,520,000 | 87,667,200.00  | 1.35 |

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  | 002001 | 新和成  | 525,969,746.31 | 16.45           |
| 2  | 600588 | 用友软件 | 460,907,544.56 | 14.41           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 455,407,573.94 | 14.24           |
| 4  | 600028 | 中国石化 | 447,492,868.28 | 13.99           |
| 5  | 600216 | 浙江医药 | 285,664,713.95 | 8.93            |
| 6  | 600900 | 长江电力 | 284,129,150.30 | 8.88            |
| 7  | 600488 | 天药股份 | 283,666,348.48 | 8.87            |
| 8  | 600000 | 浦发银行 | 211,441,876.00 | 6.61            |
| 9  | 600201 | 金宇集团 | 187,726,106.37 | 5.87            |
| 10 | 600226 | 升华拜克 | 186,172,622.56 | 5.82            |
| 11 | 600354 | 敦煌种业 | 184,484,340.68 | 5.77            |
| 12 | 000402 | 金融街  | 167,759,608.95 | 5.25            |
| 13 | 601398 | 工商银行 | 156,553,286.71 | 4.90            |
| 14 | 600739 | 辽宁成大 | 156,294,807.47 | 4.89            |
| 15 | 000683 | 远兴能源 | 150,700,299.86 | 4.71            |
| 16 | 600895 | 张江高科 | 149,655,532.62 | 4.68            |
| 17 | 000002 | 万科A  | 141,367,687.83 | 4.42            |
| 18 | 600830 | 香溢融通 | 134,787,728.20 | 4.21            |
| 19 | 000612 | 焦作万方 | 132,716,827.31 | 4.15            |
| 20 | 600879 | 火箭股份 | 130,792,809.54 | 4.09            |
| 21 | 600362 | 江西铜业 | 120,806,083.62 | 3.78            |
| 22 | 601006 | 大秦铁路 | 120,660,131.94 | 3.77            |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 23 | 000028 | 一致药业 | 115,502,481.22 | 3.61 |
| 24 | 000877 | 天山股份 | 113,286,757.33 | 3.54 |
| 25 | 600519 | 贵州茅台 | 111,526,523.84 | 3.49 |
| 26 | 600469 | 风神股份 | 108,702,610.45 | 3.40 |
| 27 | 002095 | 生意宝  | 106,340,295.11 | 3.33 |
| 28 | 000560 | 昆百大A | 104,985,416.36 | 3.28 |
| 29 | 002230 | 科大讯飞 | 104,959,788.74 | 3.28 |
| 30 | 000848 | 承德露露 | 97,432,324.19  | 3.05 |
| 31 | 600897 | 厦门空港 | 93,588,446.42  | 2.93 |
| 32 | 600383 | 金地集团 | 89,354,941.56  | 2.79 |
| 33 | 600803 | 威远生化 | 88,438,403.87  | 2.77 |
| 34 | 002024 | 苏宁电器 | 88,382,832.61  | 2.76 |
| 35 | 600748 | 上实发展 | 85,838,399.45  | 2.68 |
| 36 | 600432 | 吉恩镍业 | 85,754,959.81  | 2.68 |
| 37 | 000410 | 沈阳机床 | 85,347,131.02  | 2.67 |
| 38 | 601088 | 中国神华 | 84,947,380.66  | 2.66 |
| 39 | 600660 | 福耀玻璃 | 84,397,104.65  | 2.64 |
| 40 | 000755 | 山西三维 | 82,879,061.95  | 2.59 |
| 41 | 000655 | 金岭矿业 | 82,329,219.42  | 2.57 |
| 42 | 600596 | 新安股份 | 80,013,049.50  | 2.50 |
| 43 | 000401 | 冀东水泥 | 78,546,720.91  | 2.46 |
| 44 | 000024 | 招商地产 | 78,313,232.02  | 2.45 |
| 45 | 600616 | 金枫酒业 | 77,380,968.83  | 2.42 |
| 46 | 601186 | 中国铁建 | 74,339,360.48  | 2.32 |
| 47 | 600563 | 法拉电子 | 71,544,317.53  | 2.24 |
| 48 | 600256 | 广汇股份 | 71,061,253.93  | 2.22 |
| 49 | 000960 | 锡业股份 | 70,465,998.79  | 2.20 |
| 50 | 000983 | 西山煤电 | 69,909,147.95  | 2.19 |
| 51 | 000911 | 南宁糖业 | 69,512,903.98  | 2.17 |
| 52 | 002041 | 登海种业 | 68,478,446.64  | 2.14 |
| 53 | 000709 | 唐钢股份 | 67,682,253.80  | 2.12 |
| 54 | 600380 | 健康元  | 64,098,065.74  | 2.00 |

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  | 600216 | 浙江医药 | 331,635,371.96 | 10.37           |
| 2  | 002001 | 新和成  | 257,342,670.42 | 8.05            |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 255,301,009.22 | 7.98            |

|    |        |       |                |      |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 4  | 600226 | 升华拜克  | 202,037,217.56 | 6.32 |
| 5  | 600036 | 招商银行  | 182,747,641.60 | 5.71 |
| 6  | 600588 | 用友软件  | 178,674,431.78 | 5.59 |
| 7  | 000683 | 远兴能源  | 173,693,690.85 | 5.43 |
| 8  | 600354 | 敦煌种业  | 152,560,923.21 | 4.77 |
| 9  | 002024 | 苏宁电器  | 145,556,995.58 | 4.55 |
| 10 | 000002 | 万 科 A | 132,017,978.92 | 4.13 |
| 11 | 000612 | 焦作万方  | 130,674,957.69 | 4.09 |
| 12 | 600488 | 天药股份  | 116,298,463.23 | 3.64 |
| 13 | 600519 | 贵州茅台  | 98,534,200.12  | 3.08 |
| 14 | 000707 | 双环科技  | 97,147,158.51  | 3.04 |
| 15 | 600830 | 香溢融通  | 96,164,270.68  | 3.01 |
| 16 | 000028 | 一致药业  | 95,586,645.31  | 2.99 |
| 17 | 000422 | 湖北宜化  | 77,944,615.84  | 2.44 |
| 18 | 600048 | 保利地产  | 77,394,240.80  | 2.42 |
| 19 | 600028 | 中国石化  | 73,863,995.74  | 2.31 |
| 20 | 600582 | 天地科技  | 70,689,653.84  | 2.21 |
| 21 | 000568 | 泸州老窖  | 69,603,190.87  | 2.18 |
| 22 | 600030 | 中信证券  | 69,193,198.64  | 2.16 |
| 23 | 600432 | 吉恩镍业  | 67,830,236.16  | 2.12 |
| 24 | 600201 | 金宇集团  | 64,179,224.07  | 2.01 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 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 | 10,028,376,141.60 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 4,788,694,079.22  |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 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

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | 2,079,560,000.00 | 32.14        |
| 3  | 金融债券      | 165,747,000.00   | 2.56         |
|    | 其中：政策性金融债 | 165,747,000.00   | 2.56         |
| 4  | 企业债券      | 22,164,698.60    | 0.34         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 可转债       | -                | -            |
| 7  | 其他        | -                | -            |

|   |    |                  |       |
|---|----|------------------|-------|
| 8 | 合计 | 2,267,471,698.60 | 35.04 |
|---|----|------------------|-------|

### 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  | 0801037 | 08 央行票据 37 | 4,000,000 | 387,280,000.00 | 5.99         |
| 2  | 0801035 | 08 央行票据 35 | 3,000,000 | 320,070,000.00 | 4.95         |
| 3  | 0801092 | 08 央行票据 92 | 3,000,000 | 293,520,000.00 | 4.54         |
| 4  | 0801025 | 08 央行票据 25 | 3,000,000 | 289,800,000.00 | 4.48         |
| 5  | 0801098 | 08 央行票据 98 | 2,000,000 | 195,880,000.00 | 3.03         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

8.9.2 本基金股票投资对象为上海和深圳两个交易所上市交易，并符合基金投资策略规定的各风格板块选股标准的股票，没有特定的备选股票库。

### 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   | 853,919.60    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 56,688,068.65 |
| 5  | 应收申购款   | 3,749,771.76  |
| 6  | 其他应收款   | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 7 | 其他 | 49,635.48     |
| 8 | 合计 | 61,341,395.49 |

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|---------------|----------|
| 1  | 600900 | 长江电力 | 145,555,739.70 | 2.25          | 重大资产重组   |

## 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额              | 占总份<br>额比例 |
| 328,998      | 43269.79      | 1,599,247,251.84 | 11.23%     | 12,636,427,805.04 | 88.77%     |

### 9.2 期末基金管理人的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<br>开放式基金 | 622,035.06 | 0.0044%  |

## 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                   |
|----------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 (2004 年 5 月 11 日) 基金份额总额 | 5,233,338,344.60  |
| 报告期期初基金份额总额                      | 1,438,833,616.55  |
| 报告期期间基金总申购份额                     | 16,272,320,394.68 |

|                           |                   |
|---------------------------|-------------------|
| 报告期期间基金总赎回份额              | -5,373,361,969.83 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 1,897,883,015.48  |
| 报告期期末基金份额总额               | 14,235,675,056.88 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未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

1、2008年10月7日，经中国证券监督管理委员会核准，华宝兴业基金管理公司常务副总裁 Dennis Lefranc 因工作变动不再担任公司常务副总裁职务。

2、2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准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

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 140,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2004年5月11日）起至本报告期末。

### 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

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：



(1) 选择标准：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

### 11.7.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易              |                  | 应支付该券商的佣金     |                |
|------|--------|-------------------|------------------|---------------|----------------|
|      |        | 成交金额              | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金            | 占当期佣金总量的比例 (%) |
| 长江证券 | 1      | 3,091,281,701.37  | 21.42            | 2,511,683.44  | 20.81          |
| 银河证券 | 1      | 1,814,003,144.69  | 12.57            | 1,541,903.25  | 12.77          |
| 光大证券 | 1      | 605,519,763.13    | 4.20             | 514,690.58    | 4.26           |
| 国金证券 | 1      | 2,043,789,814.31  | 14.16            | 1,737,215.19  | 14.39          |
| 中银国际 | 1      | 945,812,296.28    | 6.55             | 803,929.26    | 6.66           |
| 海通证券 | 1      | 2,101,626,400.77  | 14.56            | 1,786,370.24  | 14.80          |
| 国元证券 | 1      | 102,016,873.27    | 0.71             | 86,713.86     | 0.72           |
| 联合证券 | 1      | 145,794,822.34    | 1.01             | 123,924.97    | 1.03           |
| 申银万国 | 1      | 895,903,278.54    | 6.21             | 727,925.33    | 6.03           |
| 国泰君安 | 1      | 580,718,491.88    | 4.02             | 493,607.91    | 4.09           |
| 中信建投 | 1      | 90,245,134.18     | 0.63             | 76,708.14     | 0.64           |
| 东吴证券 | 1      | 835,285,465.31    | 5.79             | 709,987.47    | 5.88           |
| 招商证券 | 1      | 1,177,798,456.80  | 8.16             | 956,967.64    | 7.93           |
| 合计   | 13     | 14,429,795,642.87 | 100.00           | 12,071,627.28 | 100.00         |

### 11.7.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|
|      |        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期债券总量的比例 (%) |

|      |   |                |        |   |   |
|------|---|----------------|--------|---|---|
| 长江证券 | 1 | 45,229,961.23  | 15.23  | - | - |
| 银河证券 | 1 | 57,083,043.76  | 19.22  | - | - |
| 中银国际 | 1 | 21,424,293.85  | 7.21   | - | - |
| 国元证券 | 1 | 42,685,155.14  | 14.37  | - | - |
| 联合证券 | 1 | 70,646,383.92  | 23.78  | - | - |
| 申银万国 | 1 | 30,252,746.20  | 10.18  | - | - |
| 国泰君安 | 1 | 19,592,734.26  | 6.60   | - | - |
| 东吴证券 | 1 | 2,169,614.80   | 0.73   | - | - |
| 招商证券 | 1 | 7,980,457.20   | 2.69   | - | - |
| 合计   | 9 | 297,064,390.36 | 100.00 | - | - |

### 11.7.3 权证交易

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 权证交易          |                 | 应支付该券商的佣金 |               |
|------|--------|---------------|-----------------|-----------|---------------|
|      |        | 成交金额          | 占当期权证成交总额的比例(%) | 佣金        | 占当期债券总量的比例(%) |
| 长江证券 | 1      | 11,951,758.95 | 27.99           | -         | -             |
| 银河证券 | 1      | 4,095,450.64  | 9.59            | -         | -             |
| 光大证券 | 1      | 759,338.09    | 1.78            | -         | -             |
| 国金证券 | 1      | 3,636,030.43  | 8.51            | -         | -             |
| 中银国际 | 1      | 6,214,035.26  | 14.55           | -         | -             |
| 海通证券 | 1      | 1,421,719.77  | 3.33            | -         | -             |
| 申银万国 | 1      | 6,178,832.78  | 14.47           | -         | -             |
| 招商证券 | 1      | 8,444,380.46  | 19.78           | -         | -             |
| 合计   | 8      | 42,701,546.38 | 100.00          | -         | -             |

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2008年5月27日，中国建设银行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《股份及期权认购议》行使认购期权。

2、2008年9月23日，中国建设银行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持建行的公告。

3、2008年11月17日，中国建设银行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。

华宝兴业基金管理有限公司

二〇〇九年三月二十六日