

# 银华富裕主题股票型证券投资基金

## 2008 年年度报告摘要

2008 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二零零九年三月二十八日

## § 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 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 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	银华富裕主题
交易代码	180012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 16 日
报告期末基金份额总额	9,117,845,152.69 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过选择富裕主题行业，并投资其中的优势企业，把握居民收入增长和消费升级蕴含的投资机会，同时严格风险管理，实现基金资产可持续的稳定增值。
投资策略	本基金为主动式的股票型基金，在资产配置策略方面，一是在重点投资于富裕主题行业中优势企业的前提下实现大类资产配置，二是对各大行业及细分行业投资评级并确定基金股票资产在各行业的配置比例；在股票选择策略方面，本基金将根据企业的成长性分析来选择股票；在债券投资策略方面，本基金将主要采取久期调整、收益率曲线配置和类属配置等策略，发现、利用市场失衡实现组合增值。 本基金的具体投资比例如下：本基金的股票

	投资比例为基金总资产的 60%~95%，债券为 0%~40%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。对于权证及中国证监会允许投资的其他创新金融工具，将依据有关法律法规进行投资管理。
业绩比较基准	新华富时 A200 指数×80%+新华巴克莱资本中国全债指数×20%。
风险收益特征	本基金属于主动式行业股票型基金，属于证券投资中较高风险、较高收益的基金产品。

### 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		银华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	尹东
	联系电话	(010)58163000	(010) 67595003
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		(010) 85186558 4006783333	(010)67595096
传真		(010)58163027	(010) 66275853

### 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.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

## § 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 11 月 16 日 (基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,256,567,204.66	4,855,313,368.66	154,313,136.57
本期利润	-6,311,692,766.26	6,144,840,283.72	1,023,630,179.81
加权平均基金份额本期利润	-0.6479	0.7360	0.2014
本期加权平均净值利润率	-75.06%	58.30%	19.03%
本期基金份额净值增长率	-50.47%	110.27%	20.17%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年 11 月 16 日 (基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日

期末可供分配利润	-3,456,415,899.22	553,971,796.47	28,628,786.96
期末可供分配基金份额利润	-0.3791	0.0499	0.0054
期末基金资产净值	5,661,429,253.47	13,908,240,767.04	6,185,791,422.40
期末基金份额净值	0.6209	1.2537	1.1754
3.1.3 累计期末指标	2008年	2007年	2006年11月16日 (基金合同生效日)至2006年12月31日
基金份额累计净值增长率	25.15%	152.69%	20.17%

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述本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：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金合同生效日为2006年11月16日。

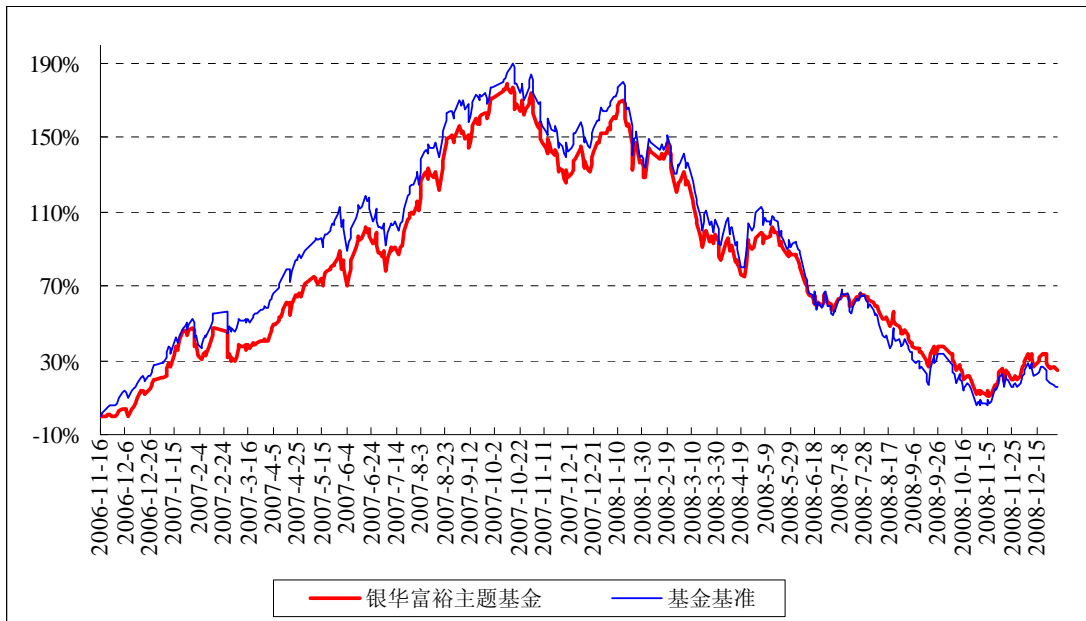
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-9.15%	2.08%	-13.70%	2.40%	4.55%	-0.32%
过去六个月	-22.01%	1.87%	-27.30%	2.36%	5.29%	-0.49%
过去一年	-50.47%	2.04%	-56.29%	2.40%	5.82%	-0.36%
自基金合同生效起至今	25.15%	2.00%	15.64%	2.12%	9.51%	-0.12%

注：由于本基金属于行业股票型基金，一般情况下股票投资比例大约为80%。在最理想的层面上，本基金应引入消费、服务类行业指数作为其股票投资的业绩比较基准。但是，由于目前缺乏相应的代表性好、公信力强的行业指数，因而本基金采用业界较为公认、市场代表性较好的新华富时A200指数和新华巴克莱资本中国全债指数加权作为本基金的业绩评价基准，权重分别为80%和20%。根据新华雷曼中国全债指数的编制人新华富时指数有限公司于2008年11月7日发布的公告，其母公司新华财经与雷曼兄弟公司合作推出的新华雷曼中国全债指数自即日起正式更名为新华巴克莱资本中国全债指数，指数的编制方法、计算和管理无任何改变。因此，本基金的业绩比较基准相应更名为“新华富时A200指数×80%+新华巴克莱资本中国全债指数×20%”。上述事项已于2008年11月12日公告。

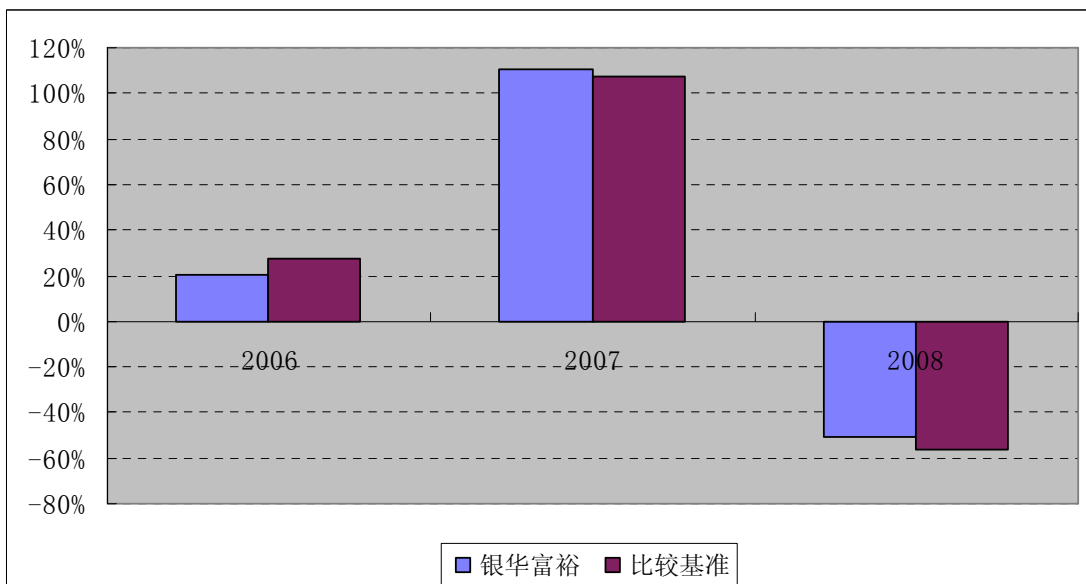
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：根据《银华富裕主题股票型证券投资基金基金合同》的规定：

- ① 本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
- ② 本基金管理人已在基金合同生效日起 6 个月内完成建仓；本报告期内，本基金严格执行了《银华富裕主题股票型证券投资基金基金合同》的相关规定。

### 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



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	每10份基金份额分	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

	红数				
2008年	-	-	-	-	
2007年	9.100	1,998,904,906.65	2,331,894,223.87	4,330,799,130.52	本年度两次分红
2006年	0.250	104,105,550.97	23,387,462.23	127,493,013.20	本基金合同生效日为2006年11月16日
合计	9.350	2,103,010,457.62	2,355,281,686.10	4,458,292,143.72	

## § 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

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性基金管理公司。公司注册资本为2亿元人民币，公司的股权结构为西南证券股份有限公司(出资比例：29%)、第一创业证券有限责任公司(出资比例：29%)、东北证券股份有限公司(出资比例：21%)及山西海鑫实业股份有限公司(出资比例：21%)。公司的主要业务是发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截止到2008年12月31日，本基金管理人管理着一只封闭式证券投资基金——基金天华和十只开放式证券投资基金(含一只QDII基金)——银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金。

#### 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		
王华先生	本基金的基金经理、投资管理部副总监	2006年11月16日	-	8年	经济学硕士，中国人民银行研究生部毕业，中国注册会计师协会非执业会员。曾在西南证券有限责任公司任职。2000年10月进入银华基金管理有限公司，先后在研究策划部、基金经理部工作，现任投资管理部副总监。曾于2004年3月2日至2007年2月5日任银华保本增值证券投资基金基金经理，于2005年6月9日至2006年9月14日任银华货币市场证券投资基金基金经理。具有从业资格。
杨靖先生	本基金的基金经理助理	2007年11月19日	-	6年	硕士学位。曾在中信证券股份有限公司、工银瑞信基金管理有限公司从事行业研究和投资管理

					工作。2007年11月加盟银华基金管理有限公司。具有从业资格。
--	--	--	--	--	---------------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华富裕主题股票型证券投资基金基金合同》和其他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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，本基金管理人制定并执行了公平交易制度。公平交易制度的范围包括所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动。公平交易的执行情况包括：公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有公平的机会；实行集中交易制度和公平的交易分配制度；加强对投资交易行为的监察稽核力度等。综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

### 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

本基金管理人旗下无其他投资风格与本基金相似的投资组合，因此未进行业绩比较。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

2008年是中国证券市场上极不寻常的一年。报告期内，A股市场跌幅超过60%，在全球市场中都位居前列。与此相对应，中国经济在2008年继续保持了全球第一的增长速度。这让许多市场投资者感到十分困惑。我们认为，背离的原因主要是三方面，首先2007年市场快速上涨，充分反映了市场的最乐观预期，导致市场估值偏高，形成了对未来的透支。其次全球经济遇到次贷危机引发的经济金融危机。这次危机是在全球化背景下发生，是全球经济不平衡的结果。中国外贸依存度的经济发展模式也受到严重影响。最后，证券市场的供需形势也出现明显变化，大小非的解禁对市场心理也产生巨大的压力。

回顾2008年，市场给我们上了精彩的一课。这段经历也将成为我们每一个人的宝贵财富。银华富裕主题基金在2008年的操作上，呈现两个阶段：前半年我们的策略是利用个股选择来应对系统性风险，效果不佳；下半年我们采取了更灵活的策略，针对市场环境提高了仓位的灵活性，业绩有所提高。回过头来反省，我们的失误主要是思维惯性严重，牛市的思考方式没有得到及时改变，另外国际视野不够宽阔也限制了思维的宽度和深度。

截至报告期末，本基金份额净值为0.6209元，本报告期份额净值增长率为-50.47%，同期业绩比较基准增长率为-56.29%。

#### 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, 我们想证券市场出现好转是必然的, 而最大的不确定性在于经济复苏步伐的快慢。看好市场的原因实质上就是一个, 在各类资产的吸引力比较中, 股票的风险收益比已经具有相对优势。这是一个最核心最基本的理由, 如果要找更多的理由, 我们也可以找到资金充足、政策支持以及经济复苏之类的理由。对于市场的风险, 我认为在上半年主要是经济复苏的步伐和股票市场上涨之间的一致性。总体上讲市场会在振荡中上行, 我们需要在年中前对经济进行一次新的评估, 来确定下半年的操作思路。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内, 本基金管理人制定了《基金估值制度》, 并建立了估值委员会。《基金估值制度》对估值委员会的人员职责分工、估值政策、估值程序、估值方法、基金估值及份额净值计价错误的识别及处理等内容进行了规定。估值委员会召开定期会议对上述内容进行审阅, 并按照《估值制度》规定召开临时会议就估值业务中遇到的问题、需要调整的估值方法、程序等进行讨论。报告期内估值委员会通过定期会议与临时会议结合的方式, 综合考虑基金估值流程各关联方意见, 审议公司旗下基金估值政策、程序及方法的科学合理性, 保证了基金估值的公允、合理。

##### 4.6.1 参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

###### 4.6.1.1 参与估值流程各方及人员的职责分工

运作保障部分管高管与运作保障部总监分别担任估值委员会主任与副主任, 估值委员会其他成员包括监察稽核部副总监、投资管理部副总监、研究部金融工程分析师、运作保障部估值主管、投资管理部合规控制员组成。以上人员均为公司各核心部门直接领导及主要业务负责人, 具备多年从业经验与扎实专业技能。涉及境外投资的估值业务由境外投资部相关人员参与。

估值委员会主任职责: 负责召开估值委员会工作会议, 就估值参与各方提交的估值问题组织讨论, 进行决议并组织实施。

投资管理部、境外投资部职责: 负责对不存在活跃市场投资品种的估值方法建立相关模型进行跟踪, 并在该投资品种存在活跃市场后比较估值价格和市价, 判断检测估值方法的公允性。负责对无法按照估值方法取得公允价值投资品种的估值方法、托管行提出异议的投资品种的公允价值确定方法提出建议并提交估值委员会审议。

运作保障部职责: 负责将无法按照《基金估值制度》估值方法取得公允价值的投资品种、托管行提出估值异议的投资品种提交估值委员会召开临时会议进行决议, 负责执行估值会议决议。

监察稽核部: 负责对投资管理部提交的估值方法合规性进行评价和判断, 对估值程序进行监督和检查。

###### 4.6.1.2 参与估值流程各方人员的专业胜任能力和相关工作经历

姓名	职务	估值委员会职责	专业胜任能力	相关工作经历
陈建军	总经理助理	估值委员会主任	22 年金融证券行业从业经历、8 年基金行业从业经历; 硕士学位, 经济师	曾在中国农业银行内蒙古自治区分行从事工商信贷工作; 曾任深圳经济特区证券公司沈阳管理总部副总经理、总经理; 首创资产管理公司成都分公司总经理; 银华基金管理有限公司北京办事处主任。目前任银华基金管理有限公司总经理助理。



龚飒	运作保障部 总监	估值委员会副主任； 运作保障部代表	11 年证券行业从业经 历、6 年基金行业从业 经历；硕士学位；注册 会计师、高级会计师	曾在湘财证券有限责任公司从事财务 管理、稽核工作；在泰达荷银基金管 理有限公司、交银施罗德基金管理有 限公司从事基金营运管理工作。目前 任银华基金管理有限公司运作保障部 总监。
张树峰	基金会计主 管	运作保障部代表	12 年证券行业从业经 历、2 年基金行业从业 经历；经济学学士；会 计师	曾在南京保利实业有限公司从事财务 工作；曾任华泰证券有限责任公司财 务经理；巨田证券有限责任公司财务 经理；目前任银华基金管理有限公司 运作保障部基金会计主管。
王莹倩	监察稽核部 副总监	监察稽核部代表	16 年证券行业从业经 历、5 年基金行业从业 经历；硕士学位；英国 标准协会 ISO9001： 2000 内审员证书	曾在海南港澳国际信托有限公司从事 投资研究工作；曾任国信证券有限责 任公司研究员。目前任银华基金管理 有限公司监察稽核部副总监。
陆文俊	投资管理部 副总监、基金 经理	投资管理部代表	11 年证券行业从业经 历、4 年基金行业从业 经历；学士学位	曾在君安证券任行政主管、交易部经 理；曾为上海华创创投管理事务所合 伙人；曾任富国基金管理有限责任公 司交易员；东吴证券投资经理、部门 副总经理；长信基金管理有限责任公 司研究员、基金经理。目前任银华基 金管理有限公司投资管理部副总监、 基金经理。
俞世典	金融工程分 析师	研究部代表	5 年金融工程研究分析 工作经历；数量经济学 硕士学位	曾在上海博弘投资公司先后担任投资 研究部经理和公司副总经理。目前任 银华基金管理有限公司金融工程分析 师。
卞玺云	投资管理风 险合规控制 员	投资管理部代表	4 年审计工作经历，1 年风险控制工作经历； 学士学位，注册会计师	曾任毕马威会计师事务所助理经理， 从事审计工作；目前任银华基金管理 有限公司投资管理部风险合规控制 员。

#### 4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理代表参与估值委员会会议，并就具体的估值问题提出建议和意见，估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部保证估值委员会制定的估值政策、程序及方法得到严格有效执行。

#### 4.6.3 参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.6.4 管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

因本基金在本报告期内出现亏损，依据基金合同第十六条基金收益与分配中约定，基金投资当期

出现净亏损，则不进行收益分配。所以本报告期末进行基金利润分配。

## § 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，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。

## § 6 审计报告

本基金 2008 年度财务会计报告经安永华明会计师事务所审计，注册会计师签字出具了安永华明（2009）审字第 60468687\_A08 号标准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：银华富裕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	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	7.4.7.1	923,317,279.56	1,355,504,202.96
结算备付金		13,914,155.47	7,437,690.12
存出保证金		2,569,692.31	9,066,789.15
交易性金融资产	7.4.7.2	4,721,313,871.83	12,583,100,833.56
其中：股票投资		4,380,327,828.12	12,583,100,833.56
基金投资		-	-

债券投资		340,986,043.71	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	7,311,895.23
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,842,526.71	23,836,746.32
应收利息	7.4.7.5	7,974,969.40	467,802.51
应收股利		-	-
应收申购款		568,040.43	20,689,252.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,680,500,535.71	14,007,415,212.62
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,768,500.61	71,058,591.90
应付管理人报酬	7.4.10.2. 1	7,413,565.28	16,934,815.26
应付托管费	7.4.10.2. 2	1,235,594.22	2,822,469.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,299,028.97	7,758,859.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	354,593.16	599,710.05
负债合计		19,071,282.24	99,174,445.58
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	9,117,845,152.69	11,093,733,821.09
未分配利润	7.4.7.10	-3,456,415,899.22	2,814,506,945.95
所有者权益合计		5,661,429,253.47	13,908,240,767.04
负债和所有者权益总计		5,680,500,535.71	14,007,415,212.62

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值为 0.6209 元，基金份额总额为 9,117,845,152.69 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银华富裕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	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		-6,035,599,671.20	6,505,507,883.77
1. 利息收入		22,890,343.51	13,546,374.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	19,021,867.01	10,030,190.18
债券利息收入		3,868,476.50	3,495,038.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	21,146.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-3,006,465,096.32	5,184,649,800.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,059,815,796.70	5,103,055,915.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,014,974.65	2,198,676.09
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	7,409,450.13	35,848,555.28
股利收益	7.4.7.15	44,926,275.60	43,546,653.16
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-3,055,125,561.60	1,289,526,915.06
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	3,100,643.21	17,784,793.97
二、费用		-276,093,095.06	-360,667,600.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	-127,220,205.47	-155,712,384.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	-21,203,367.54	-25,952,064.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	-127,218,932.80	-178,518,743.12
5. 利息支出		-	-54,046.33
其中：卖出回购金融资产支出		-	-54,046.33
6. 其他费用	7.4.7.19	-450,589.25	-430,362.33
三、利润总额		-6,311,692,766.26	6,144,840,283.72
所得税费用		-	-
四、净利润		-6,311,692,766.26	6,144,840,283.72

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华富裕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	附注号	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）		11,093,733,821.09	2,814,506,945.95	13,908,240,767.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-	-6,311,692,766.26	-6,311,692,766.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		-1,975,888,668.40	40,769,921.09	-1,935,118,747.31
其中：1. 基金申购款		750,331,184.39	72,296,486.81	822,627,671.20
2. 基金赎回款		-2,726,219,852.79	-31,526,565.72	-2,757,746,418.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	7.4.11	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）		9,117,845,152.69	-3,456,415,899.22	5,661,429,253.47
		上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日		
项目	附注号	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）		5,262,867,418.26	922,924,004.14	6,185,791,422.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-	6,144,840,283.72	6,144,840,283.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		5,830,866,402.83	77,541,788.61	5,908,408,191.44
其中：1. 基金申购款		16,890,556,748.39	3,300,352,776.09	20,190,909,524.48
2. 基金赎回款		-11,059,690,345.56	-3,222,810,987.48	-14,282,501,333.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动		-	-4,330,799,130.52	-4,330,799,130.52
五、期末所有者权益（基金净值）		11,093,733,821.09	2,814,506,945.95	13,908,240,767.04

## 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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

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》的要求，本基金自2008年9月16日起，对证券投资的估值方法进一步明确如下：

- (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，应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，应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；

因上述估值事项而进行的会计估计变更，本基金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更对本基金2008年9月16日资产净值和净利润的影响为减少人民币160,919,231.00元，对本基金本年末资产净值的影响为减少净值人民币30,106,250.50元，对本基金本年度净利润的影响为减少利润人民币30,106,250.50元。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司 (原西南证券有限责任公司“西南证券”)	基金管理人股东
第一创业证券有限责任公司(“第一创业”)	基金管理人股东
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人股东
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
南方证券股份有限公司(“南方证券”)	基金管理人原股东
银华基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人

##### 7.4.3.1 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

2006年8月16日本基金管理人的原非控股股东南方证券股份有限公司被深圳市中级人民法院依法宣告破产。2007年10月22日，南方证券股份有限公司破产清算组以公开招标方式转让南方证券股份有限公司持有的本基金管理人21%的股权，山西海鑫实业股份有限公司中标。2008年6月16日，该股权转让事宜已经获得中国证监会批准。2008年12月29日，本基金管理人已就上述股东变更及增加注册资本事宜完成了工商变更登记手续，并于2009年1月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站披露。

##### 7.4.3.2 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
银华基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
西南证券	基金管理人股东
第一创业	基金管理人股东
东北证券	基金管理人股东

中国建设银行	基金托管人
--------	-------

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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	2008 年度		2007年度	
	成交金额	占当年股票成交总额的比例	成交金额	占当年股票成交总额的比例
西南证券	5,343,268,909.97	12.54%	4,322,574,108.73	7.58%
第一创业	4,122,304,504.37	9.67%	3,279,741,019.43	5.75%
东北证券	3,517,874,887.23	8.25%	6,276,276,066.07	11.00%

###### 7.4.4.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	2008 年度		2007年度	
	成交金额	占当年权证成交总额的比例	成交金额	占当年权证成交总额的比例
东北证券	-	-	9,942,550.74	23.85%

###### 7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	2008 年度		2007年度	
	成交金额	占当年债券成交总额的比例	成交金额	占当年债券成交总额的比例
西南证券	-	-	21,009,295.70	9.29%

###### 7.4.4.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	2008年度			
	当年佣金	占当年佣金总量的比例	年末应付佣金余额	占年末应付佣金余额的比例
西南证券	4,541,753.49	12.73%	1,162,896.66	15.93%
第一创业	3,503,941.58	9.82%	379,324.20	5.20%
东北证券	2,858,303.16	8.01%	258,821.94	3.55%
关联方名称	2007年度			

	当年佣金	占当年佣金总量的比例	年末应付佣金余额	占年末应付佣金余额的比例
西南证券	3,544,499.49	7.71%	1,140,683.38	14.70%
第一创业	2,689,374.12	5.85%	459,408.66	5.92%
东北证券	4,911,226.13	10.68%	-	-

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等）。

(2)该类佣金协议的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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2008 年度	2007 年度
当期应支付的管理费	127,220,205.47	155,712,384.23
其中：当期已支付	119,806,640.19	138,777,568.97
期末未支付	7,413,565.28	16,934,815.26

注：(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)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。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	2008 年度	2007 年度
当期应支付的托管费	21,203,367.54	25,952,064.04
其中：当期已支付	19,967,773.32	23,129,594.82
年期末支付	1,235,594.22	2,822,469.22

注：(1)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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。



(2) 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。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金2008年度未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

银行间市场交易的 各关联方名称	2007 年度					
	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	97,980,000.00	-	-	-	-	-

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于2008年度及2007年度均未持有本基金份额。

##### 7.4.4.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于2008年末及2007年末均未持有本基金份额。

#### 7.4.4.5 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 年度		2007 年度	
	年末余额	当年利息收入	年末余额	当年利息收入
中国建设银行	923,317,279.56	18,697,013.04	1,355,504,202.96	9,090,897.30

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2008年度及2007年度均未在承销期内参与关联方承销证券。

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

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	年末 估值单 价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量(股)	年末 成本总额	年末 估值总额
600900	长江电力	2008年5月8日	重大资产重组	7.35	未复牌	未复牌	4,185,034	61,729,179.36	30,759,999.90

注：长江电力于停牌日至 2008 年 12 月 31 日期间按每股派发现金红利 0.29682 元（含税）进行一次分红派息，扣税后每股现金红利 0.26714 元；除息日为 2008 年 7 月 22 日。

### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有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	4,380,327,828.12	77.11
	其中：股票	4,380,327,828.12	77.11
2	固定收益投资	340,986,043.71	6.00
	其中：债券	340,986,043.71	6.00
	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	937,231,435.03	16.50
6	其他资产	21,955,228.85	0.39
7	合计	5,680,500,535.71	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	358,706,047.12	6.34
C	制造业	2,276,662,472.55	40.21
C0	食品、饮料	425,046,464.75	7.51
C1	纺织、服装、皮毛	89,282,661.40	1.58
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	12,999,220.00	0.23
C4	石油、化学、塑胶、塑料	509,420,769.01	9.00
C5	电子	57,598,694.44	1.02
C6	金属、非金属	91,167,399.16	1.61

C7	机械、设备、仪表	584,200,898.13	10.32
C8	医药、生物制品	444,520,683.66	7.85
C99	其他制造业	62,425,682.00	1.10
D	电力、煤气及水的生产和供应业	30,759,999.90	0.54
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	52,439,555.07	0.93
H	批发和零售贸易	403,557,231.36	7.13
I	金融、保险业	858,443,593.54	15.16
J	房地产业	358,859,141.26	6.34
K	社会服务业	40,899,787.32	0.72
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,380,327,828.12	77.37

### 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	601318	中国平安	10,669,178	283,693,443.02	5.01
2	600036	招商银行	20,099,939	244,415,258.24	4.32
3	600030	中信证券	12,001,185	215,661,294.45	3.81
4	000792	盐湖钾肥	3,244,050	184,197,159.00	3.25
5	000002	万科A	24,999,913	161,249,438.85	2.85
6	000759	武汉中百	16,815,082	158,061,770.80	2.79
7	000425	徐工科技	9,199,516	143,052,473.80	2.53
8	600519	贵州茅台	1,270,723	138,127,590.10	2.44
9	600489	中金黄金	3,212,297	119,625,940.28	2.11
10	600547	山东黄金	2,399,864	116,537,395.84	2.06

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<http://www.yhfund.com.cn>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	600036	招商银行	1,082,762,575.60	7.79
2	600030	中信证券	998,446,646.07	7.18
3	600005	武钢股份	751,065,631.05	5.40
4	600000	浦发银行	666,296,476.70	4.79
5	601318	中国平安	642,419,759.30	4.62

6	600050	中国联通	530,596,692.52	3.81
7	600019	宝钢股份	523,813,659.31	3.77
8	000002	万科A	482,945,911.99	3.47
9	000001	深发展A	456,973,682.52	3.29
10	601166	兴业银行	385,789,095.80	2.77
11	601666	平煤股份	351,943,748.87	2.53
12	000983	西山煤电	345,266,524.93	2.48
13	000612	焦作万方	328,288,018.53	2.36
14	600519	贵州茅台	314,982,679.79	2.26
15	000800	一汽轿车	305,295,765.94	2.20
16	601088	中国神华	297,225,526.19	2.14
17	601699	潞安环能	268,389,884.48	1.93
18	601186	中国铁建	253,384,216.90	1.82
19	000157	中联重科	240,594,526.81	1.73
20	000024	招商地产	237,015,353.16	1.70

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 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	600030	中信证券	1,181,477,197.89	8.49
2	600000	浦发银行	961,878,520.25	6.92
3	600036	招商银行	860,369,176.38	6.19
4	600005	武钢股份	831,903,293.90	5.98
5	000001	深发展A	628,694,177.36	4.52
6	601666	平煤股份	619,469,695.67	4.45
7	601318	中国平安	595,897,717.16	4.28
8	000983	西山煤电	566,515,030.75	4.07
9	600050	中国联通	538,357,412.53	3.87
10	601628	中国人寿	514,318,401.56	3.70
11	601166	兴业银行	503,630,574.95	3.62
12	600019	宝钢股份	488,356,684.20	3.51
13	601088	中国神华	429,125,001.86	3.09
14	600519	贵州茅台	401,908,208.99	2.89
15	600016	民生银行	381,858,300.09	2.75
16	600048	保利地产	367,596,128.79	2.64
17	000002	万科A	347,971,523.23	2.50
18	600031	三一重工	321,053,175.94	2.31
19	000858	五粮液	305,615,791.98	2.20
20	000612	焦作万方	298,549,615.81	2.15
21	002024	苏宁电器	287,500,199.66	2.07
22	600547	山东黄金	284,577,722.63	2.05

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 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

买入股票成本（成交）总额	20,356,546,807.89
卖出股票收入（成交）总额	22,447,630,156.55

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 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	340,665,000.00	6.02
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	321,043.71	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	340,986,043.71	6.02

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值比分项之和与合计可能有尾差。

### 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	0801034	08 央票 34	1,500,000	145,155,000.00	2.56
2	0801098	08 央票 98	1,000,000	97,940,000.00	1.73
3	0801078	08 央票 78	1,000,000	97,570,000.00	1.72
4	112006	08 万科 G2	3,029	321,043.71	0.01

### 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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

### 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	2,569,692.31
2	应收证券清算款	10,842,526.71
3	应收股利	-
4	应收利息	7,974,969.40
5	应收申购款	568,040.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,955,228.85

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 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
418,338	21,795.40	149,289,954.41	1.64%	8,968,555,198.28	98.36%

### 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	份额 级别	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		176,662.10	0.0019%
	合计	176,662.10	0.0019%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年11月16日）基金份额总额	5,071,013,120.30
报告期期初基金份额总额	11,093,733,821.09
报告期期间基金总申购份额	750,331,184.39
报告期期间基金总赎回份额	2,726,219,852.79
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	9,117,845,152.69

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

11.2.1 经本公司2007年第7次临时股东会批准，李树先生不再担任公司董事，增补矫正中先生、王立新先生为公司董事；

11.2.2 经公司职工代表大会2008年第1次会议选举，由李欣先生接替方强先生担任公司职工代表监事；

11.2.3 经公司第三届董事会审议批准陈湘永先生辞去公司副总经理职务。

11.2.4 2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准本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

无

### 11.4 基金投资策略的改变

无

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬共计人民币105,000元。

目前，该审计机构已为本基金连续提供了2年的服务。

### 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

无

### 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
第一创业证 券有限责任 公司	1	4,122,304,504.37	9.67%	3,503,941.58	9.82%	
中信证券股 份有限公司	1	5,052,168,650.75	11.85%	4,104,926.16	11.50%	
中信建投证 券有限责任 公司	1	2,494,890,642.70	5.85%	2,120,654.75	5.94%	
北京高华证 券有限责任 公司	1	4,383,567,987.94	10.28%	3,726,037.82	10.44%	
国金证券股 份有限公司	1	2,880,405,155.74	6.76%	2,340,352.52	6.56%	
华宝证券经 纪有限责任 公司	1	470,449,702.69	1.10%	399,883.66	1.12%	
长城证券有 限责任公司	1	3,241,750,792.56	7.61%	2,633,950.16	7.38%	
广发证券股 份有限公司	1	2,833,528,689.58	6.65%	2,408,489.55	6.75%	
光大证券股 份有限公司	1	3,366,249,908.43	7.90%	2,861,297.09	8.02%	
西南证券股 份有限公司	1	5,343,268,909.97	12.54%	4,541,753.49	12.73%	
东北证券股 份有限公司	1	3,517,874,887.23	8.25%	2,858,303.16	8.01%	
湘财证券有 限责任公司	1	4,185,981,276.93	9.82%	3,558,094.24	9.97%	
招商证券股 份有限公司	1	732,515,002.13	1.72%	622,627.90	1.75%	
合计	13	42,624,956,111.02	100.00%	35,680,312.08	100.00%	

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	



第一创业证券有限责任公司	1	4,122,304,504.37	9.67%	3,503,941.58	9.82%	
中信证券股份有限公司	1	5,052,168,650.75	11.85%	4,104,926.16	11.50%	
中信建投证券有限责任公司	1	2,494,890,642.70	5.85%	2,120,654.75	5.94%	
北京高华证券有限责任公司	1	4,383,567,987.94	10.28%	3,726,037.82	10.44%	
国金证券股份有限公司	1	2,880,405,155.74	6.76%	2,340,352.52	6.56%	
华宝证券经纪有限责任公司	1	470,449,702.69	1.10%	399,883.66	1.12%	
长城证券有限责任公司	1	3,241,750,792.56	7.61%	2,633,950.16	7.38%	
广发证券股份有限公司	1	2,833,528,689.58	6.65%	2,408,489.55	6.75%	
光大证券股份有限公司	1	3,366,249,908.43	7.90%	2,861,297.09	8.02%	
西南证券股份有限公司	1	5,343,268,909.97	12.54%	4,541,753.49	12.73%	
东北证券股份有限公司	1	3,517,874,887.23	8.25%	2,858,303.16	8.01%	
湘财证券有限责任公司	1	4,185,981,276.93	9.82%	3,558,094.24	9.97%	
招商证券股份有限公司	1	732,515,002.13	1.72%	622,627.90	1.75%	
合计	13	42,624,956,111.02	100.00%	35,680,312.08	100.00%	

券商名称	交易单元数量	债券交易		权证交易		备注
		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	
第一创业证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	

中信建投证券有限责任公司	1	5,408,431.10	38.68%	4,389,303.36	31.53%	
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
国金证券股份有限公司	1	-	-	5,973,394.58	42.91%	
华宝证券经纪有限责任公司	1	-	-	-	-	
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
广发证券股份有限公司	1	-	-	3,559,088.21	25.56%	
光大证券股份有限公司	1	8,573,793.11	61.32%	-	-	
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
合计	13	13,982,224.21	100.00%	13,921,786.15	100.00%	

注：(1) 本基金本报告期末进行债券回购交易。

(2) 本基金本报告期无交易单元变动情况发生。

(3) 由于四舍五入的原因，各分项之和与合计可能有尾差

(4) 基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

(5) 基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司董事会批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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：

12.1.1 2008年5月27日，本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《股份及期权认购协议》行使认购期权；

12.1.2 2008年9月23日，本行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持本行股份的公告；

12.1.3 2008年11月17日，本行公告美国银行公司行使认购期权的事宜；

12.1.4 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。

12.2 本基金管理人的重大事项披露如下：

12.2.1 本报告期内，本基金管理人注册资本由人民币1亿元增加到2亿元，该事宜已完成了工商变

更登记手续，并于 2009 年 1 月 7 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站披露。