

富国天博创新主题股票型证券投资基金
2009 年半年度报告

2009 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司
(简称中国建设银行)

送出日期： 2009 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。本半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 8 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 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 |
| 2.5 | 其他相关资料..... | 6 |
| §3 | 主要财务指标和基金净值表现..... | 6 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 7 |
| §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..... | 9 |
| 4.3 | 管理人对公平交易的专项说明..... | 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..... | 10 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 | 管理人对基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| §5 | 托管人报告..... | 11 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 5.3 | 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 | 半年度财务会计报告(未经审计)..... | 12 |
| 6.1 | 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 | 利润表..... | 13 |
| 6.3 | 所有者权益(基金净值)变动表..... | 14 |
| 6.4 | 报表附注..... | 15 |
| §7 | 投资组合报告..... | 29 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况..... | 29 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合..... | 29 |
| 7.3 | 报告期末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..... | 30 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 32 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 33 |
| 7.6 | 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..... | 33 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 34 |
| 7.8 | 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..... | 34 |
| 7.9 | 投资组合报告附注..... | 34 |
| §8 | 基金份额持有人信息..... | 35 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 35 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况..... | 35 |

| | | |
|------|----------------------------------|----|
| §9 | 开放式基金份额变动..... | 35 |
| §10 | 重大事件揭示..... | 35 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 35 |
| 10.2 | 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..... | 35 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 36 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 36 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 36 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 36 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 37 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 39 |
| §11 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 39 |
| §12 | 备查文件目录..... | 39 |
| 12.1 | 备查文件目录..... | 39 |
| 12.2 | 存放地点..... | 40 |
| 12.3 | 查阅方式..... | 40 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称 | 富国天博创新主题股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 富国天博创新股票 |
| 交易代码 | 前端交易代码：519035 后端交易代码：519036 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年04月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 11,803,421,131.21份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司，在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上，力争实现资本的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普 300 指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。 |

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 | | 富国基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行) |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李长伟 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021-68597788 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | yindong@ccb.cn |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-68597799 | 010-67595853 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100140 |
| 法定代表人 | | 陈敏 | 郭树清 |

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 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 注册登记机构 |
|------|------------------------------|
| 名称 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 办公地址 | 中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2009年1月1日-2009年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -932,803,448.72 |
| 本期利润 | 2,879,368,327.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2375 |
| 本期加权平均净值利润率 | 36.98% |
| 本期基金份额净值增长率 | 43.64% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2009年6月30日 |
| 期末可供分配利润 | -3,488,170,059.52 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2955 |
| 期末基金资产净值 | 9,265,574,588.42 |
| 期末基金份额净值 | 0.7850 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2009年6月30日 |
| 基金份额累计净值增长率 | 8.30% |

注：上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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。期末可供分配利润，采用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

(为期末余额不是当期发生数)。

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 | 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | 13.31% | 1.03% | 11.18% | 0.95% | 2.13% | 0.08% |
| 过去三个月 | 24.31% | 1.30% | 19.82% | 1.22% | 4.49% | 0.08% |
| 过去六个月 | 43.64% | 1.48% | 54.59% | 1.55% | -10.95% | -0.07% |
| 过去一年 | 11.36% | 1.70% | 12.79% | 2.03% | -1.43% | -0.33% |
| 成立至今 | 8.30% | 1.89% | -2.57% | 2.07% | 10.87% | -0.18% |

注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于2007年4月27日生效。根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=中信标普300指数×80%+中信国债指数×15%+同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普300指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中信国债指数。中信标普300指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成，样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查，能较全面地描述中国A股市场地总体趋势。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率(benchmark_t)按下列公式计算：
$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{中信标普300指数}_t / (\text{中信标普300指数}_{t-1}) - 1] + 15\% * [\text{中信国债指数}_t / (\text{中信国债指数}_{t-1}) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360$$
；其中，t=1, 2, 3, ..., T, T表示时间截至日；期间T日收益率(benchmark_T)按下列公式计算：
$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$
其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark_t)数学连乘。

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：截止日期为 2009 年 6 月 30 日。

本基金于 2007 年 4 月 27 日由原汉博证券投资基金转型而成，建仓期 6 个月，从 2007 年 4 月 27 日至 2007 年 10 月 26 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止 2009 年 6 月 30 日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金三只封闭式证券投资基金和富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金及富国优化增强债券型证券投资基金十一只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）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 | | |
| 毕天宇 | 本基金基金经理 | 2005-11-26 | — | 10年 | 硕士，曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理；中国北方工业上海公司处长助理；兴业证券研究员；2002.3至今任富国基金管理有限公司行业研究员，现任富国天博基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 李晓铭 | 本基金基金经理助理 | 2008-03-01 | — | 6年 | 硕士，曾任华富基金管理有限公司研究员，现任富国基金管理有限公司研究部行业研究员，兼任富国天博基金基金经理助理。具有基金从业资格，中国国籍。 |

注：上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《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

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》以及其它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，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对公平交易的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统内的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

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

公司旗下开放式基金（股票型）本报告期业绩比较：

| 项目 | 净值增长率 | 业绩比较基准收益率 |
|-------------------|--------|-----------|
| 富国天益价值证券投资基金 | 29.80% | 67.14% |
| 富国天合稳健优选股票型证券投资基金 | 41.65% | 54.59% |
| 富国天博创新主题股票型证券投资基金 | 43.64% | 54.59% |

根据经托管行审定的基金半年报数据，本公司旗下相近投资风格的富国天益与富国天博、富国天合之间在本报告期的净值增长率之差超过 5%，其原因分析如下：

一方面，从 BARRA 分析系统的收益分解来看，富国天益与对比基金的基金收益的差异主要来自于时机选择和股票选择收益。就时机选择收益来说，在本季度股票市场上涨过程中，相对富国天合和富国天博，富国天益处于相对较低的股票仓位，导致富国天益的投资收益相对较低。同时，在上漲过程中，富国天益股票组合保持较低的 Beta 值，也促进了差异的扩大。另外，从价差分析结果来看，富国天益与对比基金之间也未显示存在利益输送的情况。同时，对上述基金的投资过程的检查结果未发现与制度不一致的情况。

综上所述，上述基金之间的净值增长率之差系基金经理投资策略不同所致，没有证据显示存在利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

沪深 300 指数上半年上涨 74.20%，涨幅远超市场预期。同期天博基金净值仅上涨 43.64%。

上半年整体表现不如人意，其中一季度表现最差，净值增长 15.55%，远低于市场 37.96% 的涨幅。这与我们年初保守的投资策略有直接关系。从 1 月中下旬开始，我们逐步增加仓位，重点增持了银行、房地产等行业。净值在二季度上涨 24.31%，同期沪深 300 指数上涨 26.27%。

在经历了 08 年大幅下跌后，09 年初投资者普遍处于悲观情绪当中。而市场却在国家宏观经济政策的刺激下，率先走出了低谷。尽管我们未能把握住市场的拐点，但房地产、汽车两大支柱产业率先走出低谷，使得我们看到了经济转好的迹象，也逐渐改变了我们对经济悲观的看法。由于我们对经济快速复苏心存疑虑，我们的投资策略未能作出彻底转变，在行业配置上依旧偏防御，组合的进攻性明显不足。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们一方面看到宏观经济政策刺激效果进一步显现，特别是汽车、房地产销量的快速回升，使得我们深刻体会到中国经济的韧性，也增强了对经济复苏的信心，这些支柱产业的强劲复苏对经济的拉动作用也是不容置疑的。另一方面，宽松货币政策对经济的拉动作用能否持续，通胀预期的产生对经济的负面作用有多大，宏观政策何时转向，都值得我们紧密跟踪。再者，外部经济尚未有起色，外需恢复对中国经济增长的持续性也是同样重要的。综合来看，我们认为宏观经济的好转是一个循序渐进的过程，经济复苏清晰可见，复苏过程当中肯定会有波折，市场出现震荡和调整也是情理之中的。

在下半年，我们将保持高仓位操作，择机降低部分行业和个股的配置权重，注重组合的均衡配置，抓住行业轮动的投资机会，力争更好的收益。

4.6 管理人对基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金严格按照相关法律法规及基金合同约定进行利润分配。

§ 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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

报告截止日：2009年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 (2009年06月30日) | 上年度末 (2008年12月31日) |
|-----------------|------------|------------------------------|-------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 106,088,286.71 | 583,789,290.91 |
| 结算备付金 | | 3,665,073.20 | 911,670.66 |
| 存出保证金 | | 1,670,753.97 | 478,597.41 |
| 交易性金融资产 | | 8,967,715,270.58 | 6,164,393,655.77 |
| 其中：股票投资 | | 8,298,367,657.58 | 4,487,992,805.57 |
| 债券投资 | | 669,347,613.00 | 1,676,400,850.20 |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 衍生金融资产 | | — | 1,763,365.63 |
| 买入返售金融资产 | | — | — |
| 应收证券清算款 | | 221,692,393.80 | — |
| 应收利息 | | 13,901,473.19 | 26,417,696.95 |
| 应收股利 | | 522,981.85 | — |
| 应收申购款 | | 2,043,818.06 | 184,855.45 |
| 其他资产 | | — | — |
| 资产总计 | | 9,317,300,051.36 | 6,777,939,132.78 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 (2009年06月30日) | 上年度末 (2008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 | | 25,491,710.78 | 14,783,058.25 |
| 应付赎回款 | | 9,647,009.01 | 1,713,330.00 |
| 应付管理人报酬 | | 10,888,476.52 | 8,772,102.49 |
| 应付托管费 | | 1,814,746.09 | 1,462,017.05 |
| 应付销售服务费 | | — | — |
| 应付交易费用 | | 2,710,952.83 | 580,146.65 |

| | | | |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 应交税费 | | 119,288.51 | 119,288.51 |
| 应付利息 | | — | — |
| 应付利润 | | — | — |
| 其他负债 | | 1,053,279.20 | 658,720.12 |
| 负债合计 | | 51,725,462.94 | 28,088,663.07 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 4,410,681,733.75 | 4,615,527,943.46 |
| 未分配利润 | | 4,854,892,854.67 | 2,134,322,526.25 |
| 所有者权益合计 | | 9,265,574,588.42 | 6,749,850,469.71 |
| 负债和所有者权益总计 | | 9,317,300,051.36 | 6,777,939,132.78 |

注：报告截止日 2009 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7850 元，基金份额总额 11,803,421,131.21 份。所附附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 (2009年01月01日至 2009年06月30日) | 上年度可比期间 (2008年01月01日至 2008年06月30日) |
|------------------------|-----|-------------------------------------|--|
| 一、收入 | | 2,959,239,280.96 | -5,496,526,171.06 |
| 1. 利息收入 | | 14,855,420.23 | 18,251,801.23 |
| 其中：存款利息收入 | | 1,380,245.47 | 4,052,730.48 |
| 债券利息收入 | | 13,475,174.76 | 14,199,070.75 |
| 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“-”号填列） | | -868,332,376.66 | -286,223,838.82 |
| 其中：股票投资收益 | | -1,007,049,492.43 | -359,730,894.79 |
| 债券投资收益 | | 94,164,580.13 | 1,055,493.00 |
| 资产支持证券投资收益 | | — | — |
| 衍生工具投资收益 | | 2,743,725.27 | 11,656,960.53 |
| 股利收益 | | 41,808,810.37 | 60,794,602.44 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 3,812,171,776.37 | -5,231,928,858.69 |
| 4. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 544,461.02 | 3,374,725.22 |
| 二、费用（以“-”号填列） | | -79,870,953.31 | -132,043,380.23 |
| 1. 管理人报酬 | | -57,593,298.02 | -93,755,714.22 |
| 2. 托管费 | | -9,598,883.01 | -15,625,952.37 |
| 3. 销售服务费 | | — | — |
| 4. 交易费用 | | -12,449,292.37 | -18,949,661.32 |
| 5. 利息支出 | | — | -3,451,295.05 |

| | | | |
|-----------------------------|--|------------------|-------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | — | -3,451,295.05 |
| 6. 其他费用 | | -229,479.91 | -260,757.27 |
| 三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列） | | 2,879,368,327.65 | -5,628,569,551.29 |

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

本报告期：2009年01月01日至2009年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2009年01月01日至2009年06月30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） | 4,615,527,943.46 | 2,134,322,526.25 | 6,749,850,469.71 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 2,879,368,327.65 | 2,879,368,327.65 |
| 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） | -204,846,209.71 | -158,797,999.23 | -363,644,208.94 |
| 其中：1. 基金申购款 | 33,343,646.42 | 24,467,070.08 | 57,810,716.50 |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列） | -238,189,856.13 | -183,265,069.31 | -421,454,925.44 |
| 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） | 4,410,681,733.75 | 4,854,892,854.67 | 9,265,574,588.42 |
| 项目 | 上年度可比期间 (2008年01月01日至2008年06月30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） | 5,245,412,216.72 | 10,578,815,432.91 | 15,824,227,649.63 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | -5,628,569,551.29 | -5,628,569,551.29 |
| 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） | -435,530,879.80 | -686,822,081.53 | -1,122,352,961.33 |
| 其中：1. 基金申购款 | 548,519,417.42 | 1,003,689,495.56 | 1,552,208,912.98 |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列） | -984,050,297.22 | -1,690,511,577.09 | -2,674,561,874.31 |
| 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） | 4,809,881,336.92 | 4,263,423,800.09 | 9,073,305,137.01 |

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国天博创新主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由汉博证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 2007 年 4 月 16 日证监基金字[2007]108 号文《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，汉博证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“富国天博创新主题股票型证券投资基金”。自 2007 年 4 月 27 日起，《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》生效，原《汉博证券投资基金基金合同》失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据上述证监基金字[2007]108 号文的核准，基金管理人于 2007 年 5 月 9 日至 2007 年 5 月 18 日向社会开放集中申购，集中申购期结束经安永大华会计师事务所有限责任公司验证并出具第 597 号验资报告。集中申购扣除申购费后的净申购金额为人民币 4,754,945,538.62 元，在集中申购期间产生的利息为人民币 2,410,452.06 元，以上实收基金合计为人民币 4,757,355,990.68 元，折合 4,757,355,990.68 份基金份额。另外，集中申购验资结束日同时为原汉博证券投资基金的拆分日。拆分日，基金管理人对原汉博证券投资基金通过基金份额拆分，使得验资结束当日基金份额净值为 1.00 元，再根据当日基金份额净值（1.00 元）计算投资者集中申购应获得的基金份额，并由注册登记机构根据基金管理人进行投资者集中申购份额的登记确认。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

本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于 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 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

本报告期内本基金所采用的会计政策、会计估计与上年度报表相一致。

6.4.4.1 会计政策变更的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

1. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的1‰调整为3‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|------|------------------|
| 活期存款 | 106,088,286.71 |
| 定期存款 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 106,088,286.71 |

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） | | | |
|--------|------------------|------------------|------------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 | |
| 股票 | 6,591,552,261.63 | 8,298,367,657.58 | 1,706,815,395.95 | |
| 债券 | 交易所市场 | 96,671,214.44 | 97,335,613.00 | 664,398.56 |
| | 银行间市场 | 560,574,932.04 | 572,012,000.00 | 11,437,067.96 |
| | 合计 | 657,246,146.48 | 669,347,613.00 | 12,101,466.52 |
| 资产支持证券 | — | — | — | |
| 其他 | — | — | — | |
| 合计 | 7,248,798,408.11 | 8,967,715,270.58 | 1,718,916,862.47 | |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末无买入返售金融资产余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|------------|------------------|
| 应收活期存款利息 | 40,600.42 |
| 应收定期存款利息 | — |
| 应收其他存款利息 | — |
| 应收结算备付金利息 | 1,282.80 |
| 应收债券利息 | 13,859,540.77 |
| 应收买入返售证券利息 | — |
| 应收申购款利息 | — |
| 其他 | 49.20 |

| | |
|----|---------------|
| 合计 | 13,901,473.19 |
|----|---------------|

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本期末无其他资产余额。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,710,202.83 |
| 银行间市场应付交易费用 | 750.00 |
| 合计 | 2,710,952.83 |

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 750,000.00 |
| 应付赎回费 | 47,004.31 |
| 其他 | 48,000.00 |
| 审计师费 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 148,767.52 |
| 合计 | 1,053,279.20 |

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | |
|------|-----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 12,351,614,135.89 | 4,615,527,943.46 |
| 本期申购 | 89,231,574.53 | 33,343,646.42 |
| 本期赎回 | -637,424,579.21 | -238,189,856.13 |
| 本期末 | 11,803,421,131.21 | 4,410,681,733.75 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------------|------------------|------------------|
| 上年度末 | -2,710,422,426.57 | 4,844,744,952.82 | 2,134,322,526.25 |
| 本期利润 | -932,803,448.72 | 3,812,171,776.37 | 2,879,368,327.65 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 155,055,815.77 | -313,853,815.00 | -158,797,999.23 |
| 其中：基金申购款 | -24,554,257.39 | 49,021,327.47 | 24,467,070.08 |
| 基金赎回款 | 179,610,073.16 | -362,875,142.47 | -183,265,069.31 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | -3,488,170,059.52 | 8,343,062,914.19 | 4,854,892,854.67 |

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 1,330,713.99 |
| 定期存款利息收入 | — |
| 其他存款利息收入 | — |
| 结算备付金利息收入 | 48,185.16 |
| 其他 | 1,346.32 |
| 合计 | 1,380,245.47 |

6.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|----------|-----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 3,764,267,231.70 |
| 卖出股票成本总额 | -4,771,316,724.13 |
| 股票投资收益 | -1,007,049,492.43 |

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-----------------------|-----------------------------|
| 卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成交金额 | 1,336,115,862.59 |
| 卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成本总额 | -1,217,695,650.81 |
| 应收利息总额 | -24,255,631.65 |
| 债券投资收益 | 94,164,580.13 |

6.4.6.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|----------|-----------------------------|
| 卖出权证成交金额 | 2,743,725.27 |
| 卖出权证成本总额 | — |
| 买卖权证差价收入 | 2,743,725.27 |

注：本基金本期卖出的权证是取得股改对价时获赠的权证，故其成本为0。

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-------------|-----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 41,808,810.37 |
| 合计 | 41,808,810.37 |

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|------------|-----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 3,813,935,142.00 |
| 股票投资 | 3,884,132,128.79 |
| 债券投资 | -70,196,986.79 |
| 资产支持证券投资 | — |

| | |
|---------|------------------|
| 2. 衍生工具 | -1,763,365.63 |
| 权证投资 | -1,763,365.63 |
| 3. 其他 | — |
| 合计 | 3,812,171,776.37 |

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 530,599.10 |
| 其他 | 13,861.92 |
| 合计 | 544,461.02 |

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 12,445,567.37 |
| 银行间市场交易费用 | 3,725.00 |
| 合计 | 12,449,292.37 |

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 148,767.52 |
| 银行费用 | 12,205.02 |
| 债券帐户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 229,479.91 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 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 |
|--------------------------|--------------------|
| 富国基金管理有限公司 | 基金管理人、基金发起人、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司（简称“海通证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 申银万国证券股份有限公司（简称“申银万国证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

| | |
|--------------------------|--------------|
| 中国建设银行股份有限公司（简称“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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | | 上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30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（%） |
| 海通证券 | 1,527,925,505.66 | 18.06 | 9,613,039.00 | 0.20 |
| 申银万国证券 | 588,639,454.26 | 6.96 | 115,161,211.63 | 2.36 |

6.4.9.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | | 上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30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（%） |
| 海通证券 | 2,743,725.27 | 100.00 | — | — |

6.4.9.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | | 上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30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（%） |
| 海通证券 | 168,592,758.71 | 29.61 | — | — |
| 申银万国证券 | 36,946,832.43 | 6.49 | — | — |

6.4.9.1.4 回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | | | |
|--------|-----------------------------|---------------|------------|-----------------|
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 海通证券 | 1,271,669.70 | 17.95 | 433,287.87 | 15.99 |
| 申银万国证券 | 500,338.60 | 7.06 | 155,435.83 | 5.74 |

| 关联方名称 | 上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30日） | | | |
|--------|----------------------------------|---------------|----------|-----------------|
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 海通证券 | 7,810.59 | 0.19 | — | — |
| 申银万国证券 | 97,886.51 | 2.39 | — | — |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期(2009年01月01日至2009年06月30日) | 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期应支付的管理费 | 57,593,298.02 | 93,755,714.22 |
| 其中：当期已支付 | 46,704,821.50 | 81,607,220.58 |
| 期末未支付 | 10,888,476.52 | 12,148,493.64 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期(2009年01月01日至2009年06月30日) | 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期应支付的托管费 | 9,598,883.01 | 15,625,952.37 |
| 其中：当期已支付 | 7,784,136.92 | 13,601,203.45 |
| 期末未支付 | 1,814,746.09 | 2,024,748.92 |

6.4.9.3 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

| 本期(2009年01月01日至2009年06月30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 | — | — | — | — | — | — |

单位：人民币元

| 上年度可比期间(2008年01月01日至2008年06月30日) | | | | | | |
|----------------------------------|--------|--|-------|--|-------|--|
| 银行间市场交易 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |

| 的各关联方名称 | 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 | — | — | — | — | 374,400,000.00 | 330,739.72 |

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末和上年度末均未投资本基金。

6.4.9.5 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（2009年01月01日至2009年06月30日） | | 上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30日） | |
|--------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
| | 期末存款余额 | 当期存款利息收入 | 期末存款余额 | 当期存款利息收入 |
| 中国建设银行 | 106,088,286.71 | 1,330,713.99 | 171,855,940.51 | 3,920,882.15 |

6.4.9.6 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

| 本期（2009年01月01日至2009年06月30日） | | | | | |
|-----------------------------|--------|-----------|------|------------|---------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 申银万国证券 | 098048 | 09 三峡债 01 | 公开发行 | 200,000 | 20,000,000.00 |

金额单位：人民币元

| 上年度可比期间（2008年01月01日至2008年06月30日） | | | | | |
|----------------------------------|--------|------|------|------------|--------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 海通证券 | 601898 | 中煤能源 | 公开发行 | 448,823 | 7,553,691.09 |
| 海通证券 | 601186 | 中国铁建 | 公开发行 | 963,600 | 8,749,488.00 |
| 海通证券 | 601958 | 金钼股份 | 公开发行 | 421,387 | 6,982,382.59 |

注：本基金虽在承销期内从一级市场购入海通证券、申银万国证券担任副主承销商或分销商的上述证券，但并未直接向海通证券、申银万国证券购入上述证券。

6.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.11 期末（2009年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于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。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末持有暂时停牌股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末无正回购余额，没有因正回购而作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无正回购余额，没有因正回购而作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本基金所持所有证券均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

注：下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

| 本期末（2009年06月30日） | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|---------------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 106,088,286.71 | - | - | - | - | - | 106,088,286.71 |
| 结算备付金 | 3,665,073.20 | - | - | - | - | - | 3,665,073.20 |
| 存出保证金 | 140,741.00 | - | - | - | - | 1,530,012.97 | 1,670,753.97 |
| 交易性金融资产 | - | 391,485,613.00 | 49,965,000.00 | 153,921,000.00 | 73,976,000.00 | 8,298,367,657.58 | 8,967,715,270.58 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 221,692,393.80 | 221,692,393.80 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 13,901,473.19 | 13,901,473.19 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 522,981.85 | 522,981.85 |
| 应收申购款 | 2,043,818.06 | - | - | - | - | - | 2,043,818.06 |
| 资产总计 | 111,937,918.97 | 391,485,613.00 | 49,965,000.00 | 153,921,000.00 | 73,976,000.00 | 8,536,014,519.39 | 9,317,300,051.36 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 25,491,710.78 | 25,491,710.78 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 9,647,009.01 | 9,647,009.01 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 10,888,476.52 | 10,888,476.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,814,746.09 | 1,814,746.09 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,710,952.83 | 2,710,952.83 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 119,288.51 | 119,288.51 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,053,279.20 | 1,053,279.20 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 51,725,462.94 | 51,725,462.94 |
| 利率敏感度缺口 | 111,937,918.97 | 391,485,613.00 | 49,965,000.00 | 153,921,000.00 | 73,976,000.00 | 8,484,289,056.45 | 9,265,574,588.42 |
| 上年度末（2008年12月31日） | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 583,789,290.91 | - | - | - | - | - | 583,789,290.91 |
| 结算备付金 | 911,670.66 | - | - | - | - | - | 911,670.66 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 存出保证金 | 140,741.00 | - | - | - | - | 337,856.41 | 478,597.41 |
| 交易性金融资产 | - | 96,770,000.00 | 596,288,767.50 | 731,893,261.70 | 251,448,821.00 | 4,487,992,805.57 | 6,164,393,655.77 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | 1,763,365.63 | 1,763,365.63 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 26,417,696.95 | 26,417,696.95 |
| 应收申购款 | 184,855.45 | - | - | - | - | - | 184,855.45 |
| 资产总计 | 585,026,558.02 | 96,770,000.00 | 596,288,767.50 | 731,893,261.70 | 251,448,821.00 | 4,516,511,724.56 | 6,777,939,132.78 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 14,783,058.25 | 14,783,058.25 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,713,330.00 | 1,713,330.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 8,772,102.49 | 8,772,102.49 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,462,017.05 | 1,462,017.05 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 580,146.65 | 580,146.65 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 119,288.51 | 119,288.51 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 658,720.12 | 658,720.12 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 28,088,663.07 | 28,088,663.07 |
| 利率敏感度缺口 | 585,026,558.02 | 96,770,000.00 | 596,288,767.50 | 731,893,261.70 | 251,448,821.00 | 4,488,423,061.49 | 6,749,850,469.71 |

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----------------|--------------------------|---------------------------|-------------------|
| 假设 | 1. 影响生息资产的其他变量不变，仅利率发生变动 | | |
| | 2. 利率变动范围合理 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：千元） | |
| | | 本期末（2009年06月30日） | 上年度末（2008年12月31日） |
| | 1. 基准点利率增加0.1% | -1,039.93 | -3,933.36 |
| 2. 基准点利率减少0.1% | 1,039.93 | 3,933.36 | |

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2009年06月30日） | | 上年度末（2008年12月31日） | |
|--------------|------------------|--------------|-------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 8,298,367,657.58 | 89.56 | 4,487,992,805.57 | 66.49 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 669,347,613.00 | 7.22 | 1,676,400,850.20 | 24.84 |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | 1,763,365.63 | 0.03 |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 8,967,715,270.58 | 96.79 | 6,166,157,021.40 | 91.35 |

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

| | | | |
|----|--|-------------------------------|-------------------|
| 假设 | 1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关 | | |
| | 2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金的风险变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：千元） | |
| | | 本期末（2009年06月30日） | 上年度末（2008年12月31日） |
| | 1. 业绩比较基准减少1% | -83,586.48 | -57,498.04 |
| | 2. 业绩比较基准增加1% | 83,586.48 | 57,498.04 |

6.4.13有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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 | 8,298,367,657.58 | 89.06 |
| | 其中：股票 | 8,298,367,657.58 | 89.06 |
| 2 | 固定收益投资 | 669,347,613.00 | 7.18 |
| | 其中：债券 | 669,347,613.00 | 7.18 |
| | 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 | 109,753,359.91 | 1.18 |
| 6 | 其他资产 | 239,831,420.87 | 2.57 |
| 7 | 合计 | 9,317,300,051.36 | 100.00 |

7.2 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 | 527,281,643.99 | 5.69 |
| C | 制造业 | 2,933,192,059.13 | 31.66 |
| C0 | 食品、饮料 | 842,768,697.65 | 9.10 |
| 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 | 107,929,951.60 | 1.16 |
| C5 | 电子 | 20,837,677.40 | 0.22 |
| C6 | 金属、非金属 | 457,823,137.92 | 4.94 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 886,989,397.24 | 9.57 |
| C8 | 医药、生物制品 | 549,943,197.32 | 5.94 |
| C99 | 其他制造业 | 66,900,000.00 | 0.72 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 7,763,648.58 | 0.08 |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 交通运输、仓储业 | — | — |
| G | 信息技术业 | 797,202,898.20 | 8.60 |
| H | 批发和零售贸易 | 993,262,413.88 | 10.72 |
| I | 金融、保险业 | 2,166,218,566.14 | 23.38 |
| J | 房地产业 | 736,926,410.94 | 7.95 |
| K | 社会服务业 | 5,799,594.00 | 0.06 |
| L | 传播与文化产业 | 76,350,600.17 | 0.82 |
| M | 综合类 | 54,369,822.55 | 0.59 |
| | 合计 | 8,298,367,657.58 | 89.56 |

7.3 报告期末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 | 002024 | 苏宁电器 | 49,779,595 | 799,958,091.65 | 8.63 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 5,100,505 | 754,925,745.05 | 8.15 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 15,120,310 | 561,114,704.10 | 6.06 |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 22,402,548 | 515,706,654.96 | 5.57 |
| 5 | 600271 | 航天信息 | 22,000,000 | 349,580,000.00 | 3.77 |
| 6 | 000002 | 万科A | 24,100,000 | 307,275,000.00 | 3.32 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 6,000,000 | 296,760,000.00 | 3.20 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 12,000,000 | 268,920,000.00 | 2.90 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 6,019,158 | 253,647,318.12 | 2.74 |
| 10 | 000338 | 潍柴动力 | 6,800,000 | 247,724,000.00 | 2.67 |
| 11 | 000001 | 深发展A | 10,811,904 | 235,915,745.28 | 2.55 |
| 12 | 000024 | 招商地产 | 6,522,498 | 207,089,311.50 | 2.24 |
| 13 | 600050 | 中国联通 | 30,000,000 | 205,800,000.00 | 2.22 |
| 14 | 002007 | 华兰生物 | 5,507,218 | 202,280,117.14 | 2.18 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 15 | 600320 | 振华重工 | 18,000,000 | 187,200,000.00 | 2.02 |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 6,499,896 | 181,282,099.44 | 1.96 |
| 17 | 600660 | 福耀玻璃 | 21,000,000 | 172,410,000.00 | 1.86 |
| 18 | 000061 | 农产品 | 15,048,913 | 171,256,629.94 | 1.85 |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 5,776,940 | 162,332,014.00 | 1.75 |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,471,568 | 156,102,438.88 | 1.68 |
| 21 | 002028 | 思源电气 | 7,000,000 | 153,510,000.00 | 1.66 |
| 22 | 600196 | 复星医药 | 10,383,210 | 150,452,712.90 | 1.62 |
| 23 | 000983 | 西山煤电 | 5,000,000 | 149,500,000.00 | 1.61 |
| 24 | 601169 | 北京银行 | 9,009,930 | 146,501,461.80 | 1.58 |
| 25 | 600030 | 中信证券 | 5,000,000 | 141,300,000.00 | 1.52 |
| 26 | 601699 | 潞安环能 | 3,000,000 | 118,470,000.00 | 1.28 |
| 27 | 601666 | 平煤股份 | 3,952,579 | 114,269,058.89 | 1.23 |
| 28 | 601088 | 中国神华 | 3,161,609 | 94,563,725.19 | 1.02 |
| 29 | 600031 | 三一重工 | 3,228,283 | 92,877,701.91 | 1.00 |
| 30 | 002153 | 石基信息 | 2,468,661 | 79,490,884.20 | 0.86 |
| 31 | 600880 | 博瑞传播 | 3,603,143 | 76,350,600.17 | 0.82 |
| 32 | 600104 | 上海汽车 | 5,000,000 | 74,750,000.00 | 0.81 |
| 33 | 600208 | 新湖中宝 | 6,000,000 | 66,900,000.00 | 0.72 |
| 34 | 600426 | 华鲁恒升 | 4,000,000 | 65,520,000.00 | 0.71 |
| 35 | 000568 | 泸州老窖 | 2,099,999 | 60,269,971.30 | 0.65 |
| 36 | 600895 | 张江高科 | 3,509,995 | 54,369,822.55 | 0.59 |
| 37 | 000157 | 中联重科 | 2,000,000 | 44,660,000.00 | 0.48 |
| 38 | 000402 | 金融街 | 3,000,000 | 41,280,000.00 | 0.45 |
| 39 | 002022 | 科华生物 | 2,228,072 | 41,107,928.40 | 0.44 |
| 40 | 600315 | 上海家化 | 1,868,931 | 40,275,463.05 | 0.43 |
| 41 | 000401 | 冀东水泥 | 2,301,871 | 31,765,819.80 | 0.34 |
| 42 | 601899 | 紫金矿业 | 3,000,000 | 30,600,000.00 | 0.33 |
| 43 | 000869 | 张裕A | 489,751 | 27,572,981.30 | 0.30 |
| 44 | 002242 | 九阳股份 | 1,000,000 | 26,100,000.00 | 0.28 |
| 45 | 002106 | 莱宝高科 | 1,640,762 | 20,837,677.40 | 0.22 |
| 46 | 600418 | 江淮汽车 | 3,484,500 | 20,384,325.00 | 0.22 |
| 47 | 600583 | 海油工程 | 1,680,377 | 19,878,859.91 | 0.21 |
| 48 | 600580 | 卧龙电气 | 1,500,000 | 18,870,000.00 | 0.20 |
| 49 | 000550 | 江铃汽车 | 1,015,400 | 14,672,530.00 | 0.16 |
| 50 | 600631 | 百联股份 | 1,009,981 | 13,190,351.86 | 0.14 |
| 51 | 600693 | 东百集团 | 1,009,959 | 8,857,340.43 | 0.10 |
| 52 | 600027 | 华电国际 | 1,487,289 | 7,763,648.58 | 0.08 |
| 53 | 002123 | 荣信股份 | 214,241 | 6,240,840.33 | 0.07 |
| 54 | 600007 | 中国国贸 | 499,965 | 5,799,594.00 | 0.06 |
| 55 | 002215 | 诺普信 | 124,315 | 2,134,488.55 | 0.02 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 600030 | 中信证券 | 336,338,482.65 | 4.98 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 300,574,740.77 | 4.45 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 259,956,069.49 | 3.85 |
| 4 | 000002 | 万科 A | 250,687,779.91 | 3.71 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 235,037,689.98 | 3.48 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 221,844,940.58 | 3.29 |
| 7 | 600050 | 中国联通 | 193,208,233.07 | 2.86 |
| 8 | 000001 | 深发展 A | 172,250,653.54 | 2.55 |
| 9 | 600196 | 复星医药 | 152,727,767.58 | 2.26 |
| 10 | 000024 | 招商地产 | 141,934,396.00 | 2.10 |
| 11 | 002024 | 苏宁电器 | 121,554,795.12 | 1.80 |
| 12 | 000402 | 金融街 | 120,326,289.57 | 1.78 |
| 13 | 000625 | 长安汽车 | 106,979,776.53 | 1.58 |
| 14 | 000983 | 西山煤电 | 99,144,528.80 | 1.47 |
| 15 | 600320 | 振华重工 | 96,076,984.59 | 1.42 |
| 16 | 601169 | 北京银行 | 91,757,263.49 | 1.36 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 88,203,641.47 | 1.31 |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 84,807,197.01 | 1.26 |
| 19 | 601699 | 潞安环能 | 84,558,493.39 | 1.25 |
| 20 | 002202 | 金风科技 | 82,270,384.23 | 1.22 |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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 | 600596 | 新安股份 | 334,278,121.08 | 4.95 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 227,747,415.53 | 3.37 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 217,572,591.29 | 3.22 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 197,273,684.88 | 2.92 |
| 5 | 600196 | 复星医药 | 167,190,341.86 | 2.48 |
| 6 | 000792 | 盐湖钾肥 | 152,227,216.82 | 2.26 |
| 7 | 002024 | 苏宁电器 | 133,402,182.02 | 1.98 |
| 8 | 000625 | 长安汽车 | 127,328,463.96 | 1.89 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 114,892,687.46 | 1.70 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 105,556,482.73 | 1.56 |
| 11 | 002202 | 金风科技 | 101,672,099.28 | 1.51 |
| 12 | 000402 | 金融街 | 101,586,671.98 | 1.51 |
| 13 | 600309 | 烟台万华 | 101,377,124.23 | 1.50 |
| 14 | 600009 | 上海机场 | 96,599,651.67 | 1.43 |
| 15 | 601601 | 中国太保 | 96,261,284.99 | 1.43 |
| 16 | 000538 | 云南白药 | 95,296,946.06 | 1.41 |
| 17 | 601006 | 大秦铁路 | 90,477,675.90 | 1.34 |
| 18 | 000012 | 南玻 A | 87,231,218.45 | 1.29 |
| 19 | 600271 | 航天信息 | 84,488,883.21 | 1.25 |
| 20 | 600550 | 天威保变 | 75,974,772.08 | 1.13 |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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 | 4,697,559,447.35 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,764,267,231.70 |

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

7.5 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 | 147,300,613.00 | 1.59 |
| 2 | 央行票据 | 193,440,000.00 | 2.09 |
| 3 | 金融债券 | 204,465,000.00 | 2.21 |
| | 其中：政策性金融债 | 204,465,000.00 | 2.21 |
| 4 | 企业债券 | 124,142,000.00 | 1.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 可转债 | — | — |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 669,347,613.00 | 7.22 |

7.6 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 0801106 | 08 央行票据 106 | 2,000,000 | 193,440,000.00 | 2.09 |
| 2 | 080404 | 08 农发 04 | 1,000,000 | 100,710,000.00 | 1.09 |
| 3 | 009908 | 99 国债(8) | 966,590 | 97,335,613.00 | 1.05 |
| 4 | 088045 | 08 联想债 | 700,000 | 73,976,000.00 | 0.80 |
| 5 | 080308 | 08 进出 08 | 500,000 | 52,160,000.00 | 0.56 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,670,753.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 221,692,393.80 |
| 3 | 应收股利 | 522,981.85 |
| 4 | 应收利息 | 13,901,473.19 |
| 5 | 应收申购款 | 2,043,818.06 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 239,831,420.87 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 (%) |
| 564675 | 20,903.03 | 309,037,467.68 | 2.62 | 11,494,383,663.53 | 97.38 |

8.2 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开放式基金 | 1,243,767.57 | 0.0105 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-----------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 (2007 年 04 月 27 日) 基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 报告期期初基金份额总额 | 12,351,614,135.89 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 89,231,574.53 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | -637,424,579.21 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 11,803,421,131.21 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期内经中国证监会核准，本基金基金管理人于 2009 年 6 月 4 日在中国证

券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告聘任孟朝霞女士担任公司副总经理。
本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 本期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 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 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 (%) | 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 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 安信证券 | 1 | 1,009,954,830.75 | 11.94 | 7,797,053.83 | 1.37 | — | — | — | — | 858,458.17 | 12.12 | — |
| 长城证券 | 1 | 204,559,501.64 | 2.42 | — | — | — | — | — | — | 173,874.45 | 2.45 | — |
| 长江证券 | 1 | 246,271,032.34 | 2.91 | 4,407,950.10 | 0.77 | — | — | — | — | 209,330.67 | 2.95 | — |
| 德邦证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 高华证券 | 1 | 74,152,634.06 | 0.88 | 23,784,823.37 | 4.18 | — | — | — | — | 63,029.43 | 0.89 | — |
| 国泰君安 | 2 | 965,746,257.28 | 11.41 | 92,503,163.13 | 16.25 | — | — | — | — | 788,101.81 | 11.12 | — |
| 国信证券 | 1 | 1,073,909,310.18 | 12.69 | 2,094,050.00 | 0.37 | — | — | — | — | 872,554.38 | 12.32 | — |
| 海通证券 | 2 | 1,527,925,505.66 | 18.06 | 168,592,758.71 | 29.61 | — | — | 2,743,725.27 | 100.00 | 1,271,669.70 | 17.95 | — |
| 上海证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 申银万国 | 1 | 588,639,454.26 | 6.96 | 36,946,832.43 | 6.49 | — | — | — | — | 500,338.60 | 7.06 | — |
| 湘财证券 | 1 | 647,111,456.79 | 7.65 | 26,108,925.00 | 4.59 | — | — | — | — | 550,041.97 | 7.76 | — |
| 兴业证券 | 1 | 304,485,373.09 | 3.60 | 26,624,634.10 | 4.68 | — | — | — | — | 258,808.99 | 3.65 | — |
| 中投证券 | 1 | 1,251,131,045.80 | 14.79 | — | — | — | — | — | — | 1,063,460.93 | 15.01 | — |
| 中信建投 | 1 | 49,685,789.36 | 0.59 | — | — | — | — | — | — | 42,232.73 | 0.60 | — |

| | | | | | | | | | | | | |
|------|----|------------------|--------|----------------|--------|---|---|--------------|--------|--------------|--------|---|
| 中信证券 | 1 | 312,191,695.77 | 3.69 | 180,534,905.24 | 31.71 | - | - | - | - | 265,359.86 | 3.75 | - |
| 中银国际 | 1 | 206,062,792.07 | 2.44 | - | - | - | - | - | - | 167,426.73 | 2.36 | - |
| 合计 | 18 | 8,461,826,679.05 | 100.00 | 569,395,095.91 | 100.00 | - | - | 2,743,725.27 | 100.00 | 7,084,688.42 | 100.00 | - |

注：我对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的；上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金；本基金本报告期新租用以下交易单元：德邦证券的 24228 交易单元。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 信息披露方式 | 披露日期 |
|----|--|-----------------------|-------------|
| 1 | 富国基金管理有限公司关于恢复旗下基金产品持有的唐钢股份股票市价估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年01月05日 |
| 2 | 富国基金管理有限公司关于旗下基金持有的盐湖钾肥股票复牌后估值方法调整的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年01月07日 |
| 3 | 富国基金管理有限公司关于恢复旗下基金持有的长江电力股票市价估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2009年05月19日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009年1月16日，本基金托管人公告中国建设银行股份有限公司聘请胡哲一先生担任中国建设银行股份有限公司副行长；
- 2、2009年5月14日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 3、2009年5月26日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 4、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 5、2009年8月2日，本基金托管人公告，自2009年7月24日起陈佐夫先生就任中国建设银行股份有限公司执行董事。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉博证券投资基金的文件
- 2、汉博证券投资基金基金合同
- 3、汉博证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
- 6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同
- 7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议
- 8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注
- 9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）
公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司
2009 年 08 月 27 日