

# 富国天益价值证券投资基金

## 二 00 八年半年度报告

### (摘要)

#### 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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。

基金托管人交通银行股份有限公司（简称：交通银行）根据本基金合同规定，于 2008 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期为 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日。

## 一、基金简介

(一) 基金简称：富国天益

交易代码：100020

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 6 月 15 日

报告期末基金份额总额：18,222,166,609.76 份

(二) 投资目标：本基金属价值型基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票，或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略：本基金在大类资产配置和行业配置层面，遵循自上而下的积极策略，个股选择层面，遵循自下而上的积极策略。根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断，决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响，最大限度地确保基金资产的安全。本基金的股票选择，主要采取价值型选股策略。以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种，并确保基金的股票组合满足以下条件：(1) 市净率 P/B 低于市场平均水平；

(2) 组合中 70% 以上的个股的动态市盈率低于市场平均水平。

业绩比较基准：95% 的中信标普 300 指数+5% 的中信国债指数

风险收益特征：本基金为价值型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。

(三) 基金管理人：富国基金管理有限公司

信息披露负责人：林志松

电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

传真：021-68597799

电子邮箱：[public@fullgoal.com.cn](mailto:public@fullgoal.com.cn)

(四) 基金托管人：交通银行股份有限公司

信息披露负责人：张咏东

联系电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子邮箱：[zhangyd@bankcomm.com](mailto:zhangyd@bankcomm.com)

(五) 登载半年度报告正文的管理人互联网网址：[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)

基金半年度报告置备地点:

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

交通银行 上海市浦东新区银城中路 188 号交银金融大厦

## 二、主要财务指标和基金净值表现

### (一) 主要财务指标

金额单位：人民币元

序号	主要财务指标	2008 年上半年
1	本期利润	-6,275,670,269.39
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-127,335,104.93
3	加权平均份额本期利润	-0.3746
4	期末可供分配利润	-4,022,956,330.91
5	期末可供分配份额利润	-0.2208
6	期末基金资产净值	14,199,210,278.85
7	期末基金份额净值	0.7792
8	加权平均净值利润率	-38.84%
9	本期份额净值增长率	-31.58%
10	份额累计净值增长率	386.88%

提示：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。

2007 年 7 月 1 日基金执行企业会计准则后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期净收益”和“加权平均净值收益率”名称分别调整为“加权平均份额本期利润”和“加权平均净值利润率”，计算方法在原“加权平均基金份额本期净收益”和“加权平均净值收益率”公式的基础上将分子改为本期利润，原“期末可供分配收益”和“期末可供分配份额收益”名称分别调整为“期末可供分配利润”和“期末可供分配份额利润”。

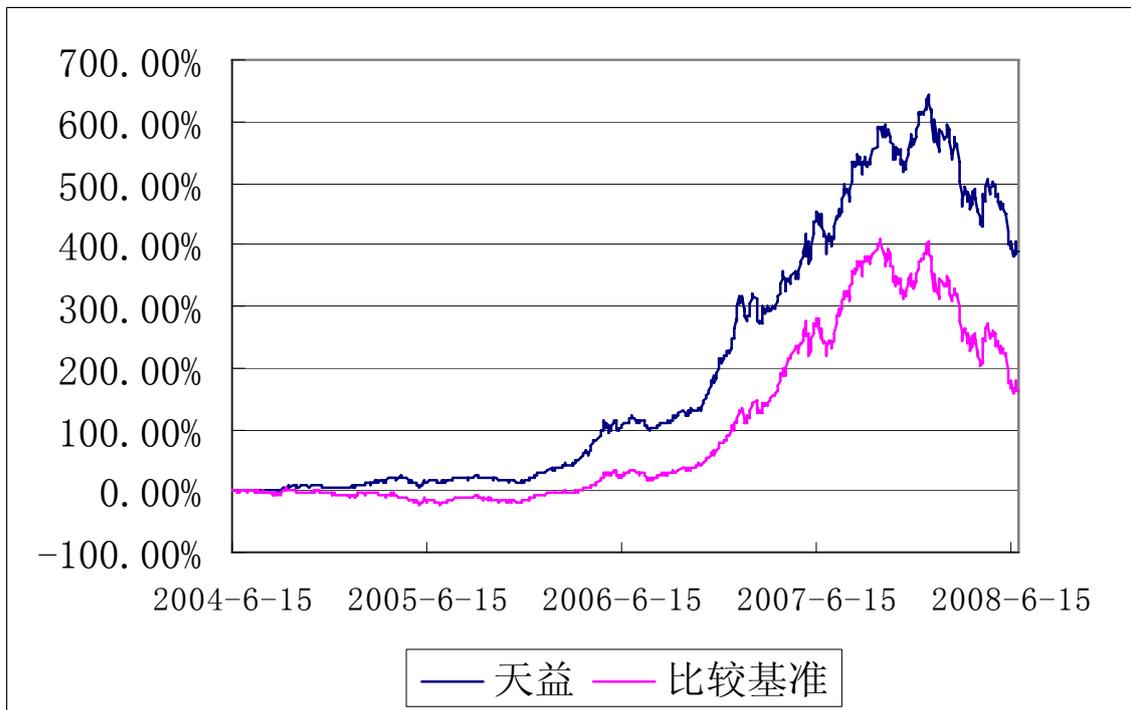
### (二) 基金净值表现

1、富国天益价值证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	-13.57%	2.11%	-20.59%	3.19%	7.02%	-1.08%
过去三个月	-15.67%	2.11%	-24.33%	3.11%	8.66%	-1.00%
过去六个月	-31.58%	2.03%	-44.45%	2.91%	12.87%	-0.88%
过去一年	-6.42%	1.83%	-22.87%	2.48%	16.45%	-0.65%
过去三年	317.78%	1.63%	213.48%	1.95%	104.30%	-0.32%
合同生效至今	386.88%	1.49%	161.47%	1.79%	225.41%	-0.30%

2、自基金合同生效以来富国天益价值证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为 2008 年 06 月 30 日。

### 三、管理人报告

#### (一)、基金管理人及基金经理情况

##### 1、基金管理人

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 2008 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、汉鼎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（2008 年 5 月 28 日成立，成立期不足两个月）九只开放式证券投资基金。

## 2、基金经理

本基金基金经理：陈戈先生，1972 年出生，硕士，自 1996 年开始从事证券行业工作。曾就职于君安证券研究所任研究员，2000 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任研究策划部研究员、研究策划部副经理，现兼任总经理助理、研究策划部经理。

本基金基金经理助理：许友胜，生于 1973 年，硕士，自 2003 年开始从事证券行业工作，曾任安徽省建筑设计研究院工程师，东方证券股份有限公司研究员，现任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，兼任富国天益价值证券投资基金基金经理助理。

## （二）、遵规守信说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天益价值证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天益价值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。

## （三）、公平交易专项说明

### 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。

### 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）业绩比较：

基金名称	基金类型	本报告期净值增长率	业绩比较基准收益率
富国天益价值证券投资基金	股票型	-31.58%	-44.45%

富国天合稳健优选股票型证券投资基金	股票型	-32.59%	-38.46%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	股票型	-37.47%	-38.46%

### 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。

#### (四)、对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

截至 2008 年 6 月 30 日，本报告期基金净值增长率为-31.58%。

报告期内本基金在股票型基金中排名第 24，最近一年风险评价为低。

2008 年上半年 A 股市场呈现单边下跌的行情，同时振荡幅度加大，反映出投资者投资情绪的低落与不安以及对宏观经济的悲观预期。我们认为 A 股市场上半年的巨幅下跌使得过去两年积聚的投资风险得以迅速释放，有利于 A 股市场的健康理性发展。

上半年本基金继续坚持“严格选股、长期持有”的投资风格，保持了股票仓位的稳定，并利用市场下跌机会增持了部分看好品种。我们认为目前投资者对宏观经济有过度悲观的倾向，而经济未来走势有可能超出市场的预期，下半年本基金将对此密切关注。

#### (五)、对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

由于市场股票供给的增加以及资金流入的减缓，下半年出现资金推动型行情的可能性依旧不大，股价的上涨更多地要依赖行业和公司基本面的超预期表现，市场的估值重心仍有向下的趋势。随着中报和季报的公布，上市公司的经营形势将得以进一步明朗，市场可能出现结构性行情。

下半年本基金仍将秉承“追求价值、注重成长”的投资理念，在自上而下的策略指导下，精选个股，做中长期投资布局。

## 四、托管人报告

2008 年上半年度，基金托管人在富国天益价值证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2008 年上半年度，富国基金管理有限公司在富国天益价值证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

2008 年上半年度，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有

关富国天益价值证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

交通银行资产托管部  
 2008 年 8 月 21 日

## 五、财务会计报告（未经审计）

### （一）会计报告书

#### 1、2008 年 6 月 30 日资产负债表

金额单位：人民币元

资产	2008-06-30	2007-12-31
银行存款	1, 113, 943, 770. 26	1, 637, 430, 802. 28
结算备付金	76, 493, 702. 73	820, 523, 525. 32
存出保证金	3, 293, 422. 17	1, 740, 567. 69
交易性金融资产	12, 381, 260, 190. 17	10, 653, 874, 532. 84
其中：股票投资	10, 346, 523, 799. 37	10, 317, 617, 262. 74
债券投资	2, 034, 736, 390. 80	336, 257, 270. 10
衍生金融资产	7, 051, 117. 06	10, 777, 843. 01
买入返售金融资产	471, 701, 179. 25	-
应收证券清算款	139, 000, 000. 00	-
应收利息	35, 328, 049. 24	934, 707. 03
应收股利	2, 820, 509. 35	-
应收申购款	17, 289, 619. 14	572, 299, 545. 64
其他资产	-	-
资产合计	<u>14, 248, 181, 559. 37</u>	<u>13, 697, 581, 523. 81</u>
负债	2008-06-30	2007-12-31
应付证券清算款	11, 062, 066. 47	238, 304, 101. 87
应付赎回款	14, 881, 512. 64	51, 912, 571. 37
应付管理人报酬	18, 621, 984. 61	13, 384, 114. 06
应付托管费	3, 103, 664. 10	2, 230, 685. 67
应付交易费用	762, 814. 02	6, 613, 699. 98
应交税费	25, 200. 00	25, 200. 00
其他负债	514, 038. 68	508, 880. 75
负债合计	<u>48, 971, 280. 52</u>	<u>312, 979, 253. 70</u>
所有者权益		

实收基金	18,222,166,609.76	11,753,114,848.02
未分配利润	-4,022,956,330.91	1,631,487,422.09
所有者权益合计	<u>14,199,210,278.85</u>	<u>13,384,602,270.11</u>
负债和所有者权益总计	<u>14,248,181,559.37</u>	<u>13,697,581,523.81</u>

附注：基金份额净值 0.7792 元，基金份额总额 18,222,166,609.76 份。

所附附注为本会计报表的组成部分

## 2、2008 年上半年度利润表

金额单位：人民币元

项目	2008 年上半年	2007 年上半年
一、收入	-6,106,887,835.51	3,279,072,068.26
1. 利息收入	35,394,629.62	5,128,682.56
其中：存款利息收入	11,218,582.34	2,699,272.86
债券利息收入	22,249,335.91	2,429,409.70
买入返售金融资产收入	1,926,711.37	-
2. 投资收益	3,111,226.27	2,225,979,564.77
其中：股票投资收益	-54,686,293.71	2,184,467,568.92
债券投资收益	489,128.72	3,420,867.89
衍生工具收益	-12,076,270.92	16,330,261.33
股利收益	69,384,662.18	21,760,866.63
3. 公允价值变动收益	-6,148,335,164.46	1,040,185,392.37
4. 其他收入	2,941,473.06	7,778,428.56
二、费用	168,782,433.88	84,616,403.28
1. 管理人报酬	120,838,272.68	58,213,656.58
2. 托管费	20,139,712.11	9,702,276.10
3. 交易费用	24,939,098.54	15,717,461.93
4. 利息支出	2,616,973.65	763,018.08
其中：卖出回购金融资产支出	2,616,973.65	763,018.08
5. 其他费用	248,376.90	219,990.59
三、利润总额	<u>-6,275,670,269.39</u>	<u>3,194,455,664.98</u>

所附附注为本会计报表的组成部分

**3、2008 年上半年度基金所有者权益（基金净值）变动表**
**金额单位：人民币元**

项目	2008 年上半年			2007 年上半年		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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）	11,753,114,848.02	1,631,487,422.09	13,384,602,270.11	3,913,982,500.89	2,069,874,172.03	5,983,856,672.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）		-6,275,670,269.39	-6,275,670,269.39		3,194,455,664.98	3,194,455,664.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	6,469,051,761.74	621,226,516.39	7,090,278,278.13	-1,304,960,533.65	-1,503,655,144.24	-2,808,615,677.89
其中：1. 基金申购款	10,551,348,734.12	569,157,976.72	11,120,506,710.84	4,062,260,409.91	3,670,846,468.89	7,733,106,878.80
2. 基金赎回款	-4,082,296,972.38	52,068,539.67	-4,030,228,432.71	-5,367,220,943.56	-5,174,501,613.13	-10,541,722,556.69
四、本基金拆分产生的所有者权益科目重分类						
五、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数						
六、期末所有者权益（基金净值）	18,222,166,609.76	-4,022,956,330.91	14,199,210,278.85	2,609,021,967.24	3,760,674,692.77	6,369,696,660.01

所附附注为本会计报表的组成部分

## (二) 会计报表附注

### 1. 基金基本情况

富国天益价值证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]38号文《关于同意富国天益价值证券投资基金设立的批复》的批准,由富国基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2004年6月15日正式生效,首次设立募集规模为1,033,718,023.69份基金份额。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和注册登记人为富国基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

### 2. 财务会计报表编制基础

本基金的会计报表系按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《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》及基金合同的规定而编制。

### 3. 重要会计政策和会计估计

(1) 本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

(2) 本报告期没有发生重大会计差错。

### 4. 关联方关系及其交易

#### (1) 关联方关系

企业名称	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 注册登记人、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司(“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(“申银万国证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### (2) 通过关联方席位进行的交易

关联方名称	2008 上半年度		2007上半年度	
	上半年成交金额	占交易总金额的比例(%)	上半年成交金额	占交易总金额的比例(%)
海通证券股份有限公司	1,096,246,359.77	16.78	1,261,902,631.07	17.44

申银万国证券股份有限公司	1,654,276,604.85	25.33	1,199,536,923.92	16.57
--------------	------------------	-------	------------------	-------

债券交易	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	47,659,974.30	6.40	-	-
申银万国证券股份有限公司	390,693,459.80	52.43	-	-

证券回购	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1,072,200,000.00	28.13	-	-

权证交易	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)	上半年成交金额	占交易总金额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	-	-	6,758,592.60	29.91
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-

关联方名称	2008 年上半年度			
	佣金	占佣金总额的比例 (%)	期末余额	占应付佣金总额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	931,808.23	17.05	31,282.96	4.11
申银万国证券股份有限公司	1,389,850.04	25.43	196,400.50	25.83
关联方名称	2007 年上半年度			
	佣金	占佣金总额的比例 (%)	期末余额	占应付佣金总额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	1,034,756.23	17.65	718,749.97	23.75
申银万国证券股份有限公司	973,659.63	16.61	666,466.79	22.02

注:a、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。

b、股票交易佣金及债券现券的交易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）。证券公司不向本基金收取债券回购交易佣金，但交易的经手费和上海证券交易所证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获取的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### (3) 与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金2008年上半年度未通过银行间同业市场与关联方进行债券（含回购）交易。

本基金2007年上半年度未通过银行间同业市场与关联方进行债券(含回购)交易。

#### (4) 基金管理人及托管人报酬

##### A、 基金管理人报酬——基金管理费

- a. 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

- b. 基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

	年初余额	上半年度计提	上半年度支付	期末余额
2008 上半年度	13,384,114.06	120,838,272.68	115,600,402.13	18,621,984.61
2007 上半年度	6,401,061.76	58,213,656.58	56,663,161.18	7,951,557.16

##### B、 基金托管人报酬——基金托管费

- a. 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

- b. 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两个工作日内从基金资产中一次性支取。

	年初余额	上半年度计提	上半年度支付	期末余额
2008 上半年度	2,230,685.67	20,139,712.11	19,266,733.68	3,103,664.10
2007 上半年度	1,066,843.63	9,702,276.10	9,443,860.19	1,325,259.54

#### (5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入如下：

项目	2008-6-30	2007-6-30
银行存款余额	1,113,943,770.26	393,204,747.16
项目	2008上半年度	2007上半年度
银行存款产生的利息收入	7,521,720.67	1,675,527.32

#### (6) 关联方持有基金份额

##### a、 基金管理人所持有的本基金份额

本基金的基金管理人于本期及上年度同期均未持有本基金份额。

b、基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额  
本基金的基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构于本期及上年度同期均未持有本基金份额。

## 5、期末流通受限的基金资产

### (1) 股票：

#### a. 本基金因认购新发或增发而于期末持有的流通受限股票

股票 代码	股票 名称	成功认购日 (年/月/日)	可流通日 (年/月/日)	流通 受限类型	认购 价格	期末 估值单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
002223	鱼跃医疗	2008/4/10	2008/7/18	网下新股申购	9.48	20.00	19,071	180,793.08	381,420.00
002224	三力士	2008/4/17	2008/7/25	网下新股申购	9.38	13.77	18,444	173,004.72	253,973.88
002225	濮耐股份	2008/4/17	2008/7/25	网下新股申购	4.79	6.50	46,153	221,072.87	299,994.50
002226	江南化工	2008/4/24	2008/8/6	网下新股申购	12.60	14.45	14,727	185,560.20	212,805.15
002227	奥特迅	2008/4/24	2008/8/6	网下新股申购	14.37	14.05	24,134	346,805.58	339,082.70
002229	鸿博股份	2008/4/24	2008/8/8	网下新股申购	13.88	13.58	19,853	275,559.64	269,603.74
002230	科大讯飞	2008/4/29	2008/8/12	网下新股申购	12.66	30.09	17,585	222,626.10	529,132.65
002231	奥维通信	2008/4/29	2008/8/12	网下新股申购	8.46	8.50	21,837	184,741.02	185,614.50
002232	启明信息	2008/4/29	2008/8/11	网下新股申购	9.44	12.65	23,382	220,726.08	295,782.30
002233	塔牌集团	2008/5/8	2008/8/18	网下新股申购	10.03	9.70	81,297	815,408.91	788,580.90
002234	民和股份	2008/5/8	2008/8/18	网下新股申购	10.61	20.24	16,147	171,319.67	326,815.28
002235	安妮股份	2008/5/8	2008/8/18	网下新股申购	10.91	10.82	22,243	242,671.13	240,669.26
002236	大华股份	2008/5/12	2008/8/20	网下新股申购	24.24	36.00	12,573	304,769.52	452,628.00
002237	恒邦股份	2008/5/12	2008/8/20	网下新股申购	25.98	40.97	21,890	568,702.20	896,833.30
002238	天威视讯	2008/5/14	2008/8/26	网下新股申购	6.98	12.25	39,463	275,451.74	483,421.75
002239	金飞达	2008/5/14	2008/8/22	网下新股申购	9.33	8.98	26,180	244,259.40	235,096.40
002240	威华股份	2008/5/15	2008/8/25	网下新股申购	15.70	12.19	79,719	1,251,588.30	971,774.61
002241	歌尔声学	2008/5/16	2008/8/22	网下新股申购	18.78	26.84	24,635	462,645.30	661,203.40
002242	九阳股份	2008/5/20	2008/8/28	网下新股申购	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
002243	通产丽星	2008/5/20	2008/8/28	网下新股申购	7.78	8.02	39,414	306,640.92	316,100.28
002245	澳洋顺昌	2008/5/28	2008/9/5	网下新股申购	16.38	16.02	10,566	173,071.08	169,267.32
002246	北化股份	2008/5/29	2008/9/5	网下新股申购	6.95	8.22	37,754	262,390.30	310,337.88
002250	联化科技	2008/6/10	2008/9/19	网下新股申购	10.52	12.80	26,001	273,530.52	332,812.80
002251	步步高	2008/6/11	2008/9/19	网下新股申购	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
002252	上海莱士	2008/6/13	2008/9/23	网下新股申购	12.81	24.87	27,141	347,676.21	674,996.67
002253	川大智胜	2008/6/13	2008/9/23	网下新股申购	14.75	21.11	11,905	175,598.75	251,314.55
002254	烟台氨纶	2008/6/18	2008/9/25	网下新股申购	18.59	27.41	36,308	674,965.72	995,202.28
002255	海陆重工	2008/6/18	2008/9/25	网下新股申购	10.46	19.64	19,865	207,787.90	390,148.60
002256	彩虹精化	2008/6/18	2008/9/25	网下新股申购	12.56	13.33	36,032	452,561.92	480,306.56
002257	立立电子	2008-6-30	未知	网下申购锁定	21.81	21.81	43,974	959,072.94	959,072.94
002258	利尔化学	2008-6-30	2008/10/8	网下申购锁定	16.06	16.06	51,434	826,030.04	826,030.04
601899	紫金矿业	2008/4/18	2008/7/25	网下新股申购	7.13	7.80	7,147,576	50,962,216.88	55,751,092.80
601958	金钼股份	2008/4/11	2008/7/17	网下新股申购	16.57	17.02	252,832	4,189,426.24	4,303,200.64
合计								67,806,517.76	76,579,724.50

#### b. 本基金期末持有的暂时停牌的股票：

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	期末成本 总额	期末估值 总额
600415	小商品城	2008-6-27	审核非公开发行	92.50	2008-7-4	92.30	189132	19,347,889.61	17,494,710.00

000792	盐湖钾肥	2008-6-26	筹划资产重组	88.12	未知	-	6709409	339,544,146.31	591,233,121.08
合计								358,892,035.92	608,727,831.08

## (2) 债券:

### a. 因认购新发或增发而于期末持有的流通受限债券:

债券代码	债券名称	成功认购日 (年/月/日)	可流通日 (年/月/日)	流通受限 类型	认购 价格	期末估值 单价	数量	期末成本 总额	期末估值 总额
126016	08 宝钢债	2008-6-20	2008-7-4	未上市	76.27	75.08	273030	20,824,509.93	20,499,092.40

## (3) 衍生金融资产:

### a. 因认购新发或增发而于期末持有的流通受限衍生金融资产

权证代码	权证名称	成功认购日 (年/月/日)	可流通日 (年/月/日)	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量	期末成本 总额	期末估值 总额
580024	宝钢 CWB1	2008-6-20	2008-7-4	未上市	1.48	1.197	4368480	6,478,490.07	5,229,070.56

## 6、金融工具及其风险分析

### (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。

### (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约责任，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的证券，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。

### (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，除在附注五-17 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。

#### (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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

##### (a) 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。

本基金投资组合中股票最高可达到基金资产净值的 95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。于 2008 年 6 月 30 日和 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

2008 年 06 月 30 日		
	公允价值	占基金资产 净值的比例
交易性金融资产	12,381,260,190.17	87.20%
- 股票投资	10,346,523,799.37	72.87%
- 债券投资	2,034,736,390.80	14.33%
衍生金融资产	7,051,117.06	0.05%
合计	12,388,311,307.23	87.25%
2007 年 12 月 31 日		
	公允价值	占基金资产 净值的比例
交易性金融资产		
- 股票投资	10,317,617,262.74	77.09%
- 债券投资	336,257,270.10	2.51%
衍生金融资产	10,777,843.01	0.08%
合计	10,664,652,375.85	79.68%

本基金管理人运用 CAPM 模型方法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，证券投资

资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

2008 年 6 月 30 日	增加/减少基准点	对净值的影响
业绩比较基准	%	千元
95%的中信标普 300 指数+5%的中信国	+1.00	106,282.31
债指数	-1.00	-106,282.31

2007 年 12 月 31 日	增加/减少基准点	对净值的影响
业绩比较基准	%	千元
95%的中信标普 300 指数+5%的中信国	+1.00	105,465.99
债指数	-1.00	-105,465.99

### (b) 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。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2008 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	1,113,943,770.26				1,113,943,770.26
结算备付金	76,493,702.73				76,493,702.73
存出保证金	101,282.05			3,192,140.12	3,293,422.17
交易性金融资产	1,364,286,850.70	221,537,100.00	448,912,440.10	10,346,523,799.37	12,381,260,190.17
衍生金融资产				7,051,117.06	7,051,117.06
应收股利				2,820,509.35	2,820,509.35
应收利息				35,328,049.24	35,328,049.24
应收申购款				17,289,619.14	17,289,619.14
买入返售金融资产	471,701,179.25				471,701,179.25
应收证券清算款				139,000,000.00	139,000,000.00
资产总计	3,026,526,784.99	221,537,100.00	448,912,440.10	10,551,205,234.28	14,248,181,559.37
<b>负债</b>					
应付证券清算款				11,062,066.47	11,062,066.47
应付赎回款				14,881,512.64	14,881,512.64
应付管理人报酬				18,621,984.61	18,621,984.61
应付托管费				3,103,664.10	3,103,664.10
应付交易费用				762,814.02	762,814.02
应交税费				25,200.00	25,200.00
其他负债				514,038.68	514,038.68
负债总计	0.00	0.00	0.00	48,971,280.52	48,971,280.52
<b>利率敏感度缺口</b>	3,026,526,784.99	221,537,100.00	448,912,440.10	10,502,233,953.76	14,199,210,278.85

2007 年 12 月 31 日    1 年以内    1 至 5 年    5 年以上    不计息    合计

**资产**

银行存款	1,637,430,802.28	-	-	-	1,637,430,802.28
结算备付金	820,523,525.32	-	-	-	820,523,525.32
存出保证金	101,282.05	-	-	1,639,285.64	1,740,567.69
交易性金融资产	316,309,076.10	-	19,948,194.00	10,317,617,262.74	10,653,874,532.84
衍生金融资产	-	-	-	10,777,843.01	10,777,843.01
应收利息	-	-	-	934,707.03	934,707.03
应收申购款	-	-	-	572,299,545.64	572,299,545.64
<b>资产总计</b>	<b>2,774,364,685.75</b>	<b>-</b>	<b>19,948,194.00</b>	<b>10,903,268,644.06</b>	<b>13,697,581,523.81</b>

**负债**

应付证券清算款	-	-	-	238,304,101.87	238,304,101.87
应付赎回款	-	-	-	51,912,571.37	51,912,571.37
应付管理人报酬	-	-	-	13,384,114.06	13,384,114.06
应付托管费	-	-	-	2,230,685.67	2,230,685.67
应付交易费用	-	-	-	6,613,699.98	6,613,699.98
应交税费	-	-	-	25,200.00	25,200.00
其他负债	-	-	-	508,880.75	508,880.75
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>312,979,253.70</b>	<b>312,979,253.70</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>2,774,364,685.75</b>	<b>-</b>	<b>19,948,194.00</b>	<b>10,590,289,390.36</b>	<b>13,384,602,270.11</b>

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

	增加/减少基准点	对净值的影响
2008年6月30日	%	千元
利率	+0.10	-4,823.42
利率	-0.10	4,823.42
2007年12月31日	%	千元
利率	+0.10	-395.42
利率	-0.10	395.42

**(c) 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。

**7、比较数据**

2007年7月1日首次执行企业会计准则，本基金按其列报要求对比较数据进行了重述。按企业会计准则的要求，对所有者权益及期间净损益的影响情况如下：

项目	2007年年初 所有者权益	2007年 上半年净损益 (未经审计)	2007年上半年 末所有者权益 (未经审计)
----	------------------	---------------------------	------------------------------

按原会计准则列报的金额	5,983,856,672.92	2,154,270,272.61	6,369,696,660.01
金融资产公允价值变动的调整数	-	1,040,185,392.37	-
按新会计准则列报的金额	5,983,856,672.92	3,194,455,664.98	6,369,696,660.01

## 六、投资组合报告（2008 年 6 月 30 日）

### （一）、报告期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	股票	10,346,523,799.37	72.62
2	债券	2,034,736,390.80	14.28
3	权证	7,051,117.06	0.05
4	银行存款及结算备付金	1,190,437,472.99	8.36
5	其他资产	669,432,779.15	4.70
	合计	14,248,181,559.37	100.00

### （二）、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值 （元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	A 农、林、牧、渔业	326,815.28	0.00
2	B 采掘业	706,701,212.24	4.98
3	C 制造业	4,596,863,578.14	32.37
4	C0 食品、饮料	1,272,255,946.70	8.96
5	C1 纺织、服装、皮毛	493,878.48	0.00
6	C2 木材、家具	971,774.61	0.01
7	C3 造纸、印刷	2,606,015.16	0.02
8	C4 石油、化学、塑胶、塑料	871,019,740.68	6.13
9	C5 电子	57,239,614.38	0.40
10	C6 金属、非金属	1,136,651,404.85	8.01
11	C7 机械、设备、仪表	722,984,160.10	5.09
12	C8 医药、生物制品	530,781,001.78	3.74
13	C9 其他制造业	1,860,041.40	0.01
14	D 电力、煤气及水的生产和供应业	49,125,586.83	0.35
15	E 建筑业	34,394,079.20	0.24
16	F 交通运输、仓储业	554,076,295.67	3.90
17	G 信息技术业	1,308,912,571.76	9.22
18	H 批发和零售贸易	1,211,343,040.68	8.53

19	I 金融、保险业	1,578,248,214.74	11.12
20	J 房地产业	243,225,136.42	1.71
21	K 社会服务业	39,056,666.84	0.28
22	L 传播与文化产业	6,755,891.57	0.05
23	M 综合类	17,494,710.00	0.12
	合 计	10,346,523,799.37	72.87

### (三)、报告期末前十名股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量 (股)	市值 (元)	市值占基金资产净值比例 (%)
1	002024	苏宁电器	27,546,721	1,137,679,577.30	8.01
2	600519	贵州茅台	7,889,759	1,093,362,802.22	7.70
3	600271	航天信息	25,192,953	672,651,845.10	4.74
4	000792	盐湖钾肥	6,709,409	591,233,121.08	4.16
5	600036	招商银行	24,463,603	572,937,582.26	4.04
6	600585	海螺水泥	13,016,426	520,526,875.74	3.67
7	601006	大秦铁路	26,020,943	354,145,034.23	2.49
8	000063	中兴通讯	5,188,652	324,809,615.20	2.29
9	002028	思源电气	13,696,864	308,179,440.00	2.17
10	002153	石基信息	4,509,136	307,523,075.20	2.17

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

### (四)、报告期内股票投资组合的重大变动

#### 1. 报告期内累计买入前 20 名的股票明细

序号	证券代码	证券名称	累计买入金额 (元)	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	742,453,107.55	5.55
2	002024	苏宁电器	724,759,017.09	5.41
3	600585	海螺水泥	559,377,627.08	4.18
4	601006	大秦铁路	464,345,300.94	3.47
5	601166	兴业银行	417,151,660.41	3.12
6	600036	招商银行	373,738,363.08	2.79
7	600456	宝钛股份	338,580,117.64	2.53
8	002022	科华生物	262,945,075.52	1.96
9	000898	鞍钢股份	236,827,849.91	1.77
10	000807	云铝股份	205,481,481.80	1.54
11	002028	思源电气	187,875,776.58	1.40
12	600019	宝钢股份	185,714,278.32	1.39

13	002153	石基信息	143,486,980.10	1.07
14	601088	中国神华	129,089,520.27	0.96
15	601601	中国太保	116,116,736.61	0.87
16	600271	航天信息	114,722,821.50	0.86
17	000002	万科A	112,666,899.43	0.84
18	600761	安徽合力	112,046,953.76	0.84
19	600583	海油工程	109,198,969.53	0.82
20	600309	烟台万华	98,025,564.80	0.73

## 2. 报告期内累计卖出前 20 名的股票明细

序号	证券代码	证券名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	166,120,359.65	1.24
2	000807	云铝股份	110,078,355.52	0.82
3	600900	长江电力	34,670,521.45	0.26
4	600028	中国石化	33,112,348.50	0.25
5	000792	盐湖钾肥	20,280,392.03	0.15
6	000667	名流置业	10,216,671.11	0.08
7	600875	东方电气	9,407,316.88	0.07
8	002177	御银股份	9,381,094.73	0.07
9	002155	辰州矿业	8,324,498.39	0.06
10	000402	金融街	2,171,507.53	0.02

注：报告期内本基金仅对上述股票进行卖出操作。

3. 整个报告期内买入股票的成本总额为 6,620,511,285.37 元；卖出股票的收入总额为 403,763,065.79 元。

## (五)、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	465,846,540.10	3.28
2	政策性金融债	403,763,000.00	2.84
3	可转债	24,375,348.30	0.17
4	企业债	310,861,502.40	2.19
5	央行票据	829,890,000.00	5.84
	合计	2,034,736,390.80	14.33

## (六)、报告期末债券投资的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	08 央行票据 35	299,700,000.00	2.11
2	07 央票 139	288,420,000.00	2.03

3	07 农发 22	199,160,000.00	1.40
4	08 石化债	190,925,764.60	1.34
5	99 国债(8)	182,985,935.10	1.29

### (七)、投资组合报告附注

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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、截至本报告期末，本基金的其他资产项目包括：

序号	其他资产项目	金额（元）
1	存出保证金	3,293,422.17
2	应收证券清算款	139,000,000.00
3	应收利息	35,328,049.24
4	应收股利	2,820,509.35
5	应收申购款	17,289,619.14
6	买入返售金融资产	471,701,179.25
	其他资产项目合计	669,432,779.15

4、截至本报告期末，本基金持有的处于转股期的可转债如下：

债券代码	债券名称	持有数量	市值（元）	市值占净值比例
125709	唐钢转债	185,130	19,455,311.70	0.14%

5、持有权证信息情况：

本基金报告期曾持有权证及报告期末权证投资情况如下：

标的证券	权证代码	权证名称	持有原因	持有数量（份）	成本总额（元）	期末数量（份）
日照港	580015	日照 CWB1	买债送配	217,140	458,160.91	0
上海汽车	580016	上汽 CWB1	买债送配	1,000,188	8,680,324.31	0
中远航运	580018	中远 CWB1	买债送配	269,794	1,482,430.00	0
中国石化	580019	石化 CWB1	买债送配	12,080,711	28,045,687.84	0
青岛啤酒	580021	青啤 CWB1	买债送配	158,130	586,130.40	0
国电电力	580022	国电 CWB1	买债送配	998,203	2,338,367.50	0
康美药业	580023	康美 CWB1	买债送配	489,140	813,756.79	489,140
宝钢股份	580024	宝钢 CWB1	买债送配	4,368,480	6,478,490.07	4,368,480
中兴通讯	031006	中兴 ZXC1	买债送配	312,927	3,143,989.65	0

6、本基金本报告期内及本报告期末均不持有资产支持证券。

7、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。

## 七、基金份额持有人户数、持有人结构

### 1、期末基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	平均每户持有基金份额	机构投资者持有的基金份额	机构投资者持有的基金份额比例	个人投资者持有的基金份额	个人投资者持有的基金份额比例
565,331 户	32,232.74 份	3,044,280,407.15 份	16.71%	15,177,886,202.61 份	83.29%

### 2、期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量 (份)	占本基金总份额的比例 (%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	8,428,780.75	0.0463

## 八、开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	期初基金份额总额	期末基金份额总额	报告期间基金总申购份额	报告期间基金总赎回份额
1,033,718,023.69	11,753,114,848.02	18,222,166,609.76	10,551,348,734.12	4,082,296,972.38

## 九、重大事件揭示

- 1、本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。
- 2、本报告期本基金的基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门均未发生重大人事变动。
- 3、本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管人、基金托管业务的重大诉讼。
- 4、本报告期本基金投资策略无改变。
- 5、本报告期本基金未进行收益分配。
- 6、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。
- 7、本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

- 8、富国天益价值证券投资基金在本报告期内分别在高华证券新增一个席位、

在西南证券新增一个席位，分别向申银万国证券股份有限公司租用了 2 个基金专用交易席位，向海通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、光大证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、湘财证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司和安信证券有限公司这八家证券经营机构各租用了 1 个基金专用交易席位，总共租用了 12 个交易席位，我公司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。有关专用交易席位的 2008 年上半年年交易情况见下表：

交易席位	成交量（元）				佣金（元）
	股票	债券	回购	权证	
申银万国	1,654,276,604.85	390,693,459.80	1,072,200,000.00	0.00	1,389,850.04
海通证券	1,096,246,359.77	47,659,974.30	0.00	0.00	931,808.23
中金公司	1,899,944,960.54	0.00	0.00	3,046,663.50	1,543,714.68
安信证券	1,469,513,563.08	128,083,987.70	262,500,000.00	0.00	1,249,087.88
银河证券	58,932,947.52	0.00	0.00	0.00	50,092.48
光大证券	59,407,940.20	113,179,358.40	2,004,700,000.00	4,087,641.29	50,496.49
东方证券	128,928,681.30	65,549,831.30	0.00	0.00	109,589.85
湘财证券	119,812,652.00	0.00	0.00	25,524,514.90	101,842.16
西南证券	45,013,341.30	0.00	471,700,000.00	0.00	38,263.50
合计	6,532,077,050.56	745,166,611.50	3,811,100,000.00	32,658,819.69	5,464,745.31

交易席位	成交量占比				佣金占总佣金比例%
	股票交易量占股票总交易量的比例%	债券交易量占债券总交易量的比例%	回购交易量占回购总交易量的比例%	权证交易量占权证总交易量的比例%	
申银万国	25.33	52.43	28.13	0.00	25.43
海通证券	16.78	6.40	0.00	0.00	17.05
中金公司	29.09	0.00	0.00	9.33	28.25
安信证券	22.50	17.19	6.89	0.00	22.86
银河证券	0.90	0.00	0.00	0.00	0.92
光大证券	0.91	15.19	52.60	12.52	0.92
东方证券	1.97	8.80	0.00	0.00	2.01
湘财证券	1.83	0.00	0.00	78.16	1.86
西南证券	0.69	0.00	12.38	0.00	0.70
合计	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

9、 本基金管理人于 2008 年 1 月 14 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于富国基金管理有限公司旗下基金在建设银行开通基金定期定额申购业务的公告》。

10、 本基金管理人于 2008 年 1 月 18 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司关于旗下基金参与国泰君安证券网上交易申购费率优惠活动的公告》。

- 11、 本基金管理人于 2008 年 2 月 26 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司增加中信银行股份有限公司为富国旗下部分基金代销机构的公告》。
- 12、 本基金管理人于 2008 年 3 月 5 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金公司增加中国银行为富国旗下部分基金代销机构的公告》。
- 13、 本基金管理人于 2008 年 3 月 6 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司基金定期定额投资业务的公告》。
- 14、 本基金管理人于 2008 年 3 月 14 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行定期定额业务及费率优惠活动的公告》。
- 15、 本基金管理人于 2008 年 4 月 1 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司旗下部分基金继续参与中国工商银行个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告》。
- 16、 本基金管理人于 2008 年 4 月 8 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于增加信泰证券有限责任公司为富国旗下部分基金代销机构的公告》。
- 17、 本基金管理人于 2008 年 4 月 8 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于增加安信证券股份有限公司为富国旗下部分基金代销机构的公告》。
- 18、 本基金管理人于 2008 年 4 月 11 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于富国基金管理有限公司在上海浦东发展银行开展网上基金申购费率优惠活动的公告》。
- 19、 本基金管理人于 2008 年 4 月 15 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于增加瑞银证券有限责任公司为富国旗下部分基金代销机构的公告》。
- 20、 本基金管理人于 2008 年 4 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于增加中国建银投资证券有限责任公司为富国旗下基金代销机构的公告》。
- 21、 本基金管理人于 2008 年 5 月 5 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于富国基金公司在招商银行开立的直销资金专户帐号变更公告》。
- 22、 本基金管理人于 2008 年 5 月 7 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金公司关于旗下部分基金参与民生银行网上银行申购费率优惠活动的公告》。
- 23、 本基金管理人于 2008 年 5 月 8 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司旗下部分基金参与北京银行股份有限公司基金定期定额投资业务的公告》。
- 24、 本基金管理人于 2008 年 5 月 9 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国建设银行网上交易申购费率优惠活动的公告》。
- 25、 本基金管理人于 2008 年 5 月 9 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于增加中国光大银行为富国旗下基金代销机构及参与

- 网银优惠和定投优惠活动的公告》。
- 26、 本基金管理人于 2008 年 5 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于富国基金管理有限公司在瑞银证券开展网上基金申购费率优惠活动的公告》。
- 27、 本基金管理人于 2008 年 5 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理公司关于调整网上直销申购费率的公告》。
- 28、 本基金管理人于 2008 年 6 月 10 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于增加宁波银行股份有限公司为富国旗下基金代销机构及参与网银优惠和定投活动的公告》。
- 29、 本基金管理人于 2008 年 6 月 13 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于富国基金公司旗下天惠、天博、天时基金在交通银行开通定期定额业务，及旗下部分基金参与定期定额申购费率优惠活动的公告》。
- 30、 本基金管理人于 2008 年 6 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于富国基金公司旗下部分基金在中国邮政储蓄银行延长定期定额投资优惠活动的公告》。
- 31、 本基金管理人于 2008 年 6 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金管理有限公司关于旗下基金继续参与国都证券网上交易申购费率优惠活动的公告》。

富国基金管理有限公司  
二 00 八年八月二十五日