

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金2008年第四季度报告

2008年12月31日

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2009年01月21日

友邦华泰基金管理有限公司

地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编：200135

电话：(021) 3860 1777

第 1 页 共 8 页

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2008年10月1日起至2008年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	友邦盛世
交易代码	460001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年04月27日
报告期末基金份额总额	13,086,226,857.64
投资目标	主要通过股票选择，辅以适度的大类资产配置调整，追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%
风险收益特征	较高风险、较高收益
基金管理人	友邦华泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2008年10月01日-2008年12月31日）
1. 本期已实现收益	-1,722,981,391.05
2. 本期利润	-397,084,112.65
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0319
4. 期末基金资产净值	5,499,105,977.45
5. 期末基金份额净值	0.4202

友邦华泰基金管理有限公司

地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编：200135

电话：(021) 3860 1777

第2页共8页

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-5.80%	1.65%	-11.27%	2.10%	5.47%	-0.45%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：图示日期为2005年4月27日至2008年12月31日。

1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条（二）投资范围、（八）投资组合中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%，债券投资为基金净资产的0%-40%。

§4 管理人报告

4.1 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	说明
----	----	-------------	-----	----

友邦华泰基金管理有限公司

地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层 邮编：200135

电话：(021) 3860 1777

第 3 页 共 8 页

		任职日期	离任日期	业年限	
梁丰	本基金的基金经理、投资部总监	2007年07月26日	-	14年	梁丰先生，经济学硕士。历任中信集团中大投资管理有限公司证券投资部总经理、总经理助理、中信基金股权投资部总监、2004年3月至2006年1月任中信经典配置基金的基金经理，2005年11月至2007年4月任中信红利精选股票基金的基金经理。2007年4月加入友邦华泰基金管理有限公司，2007年7月起任投资部总监、友邦华泰盛世中国股票型基金基金经理。
郭楷泽	本基金的基金经理	2008年09月03日	-	11年	郭楷泽先生，复旦大学工商管理硕士。历任中信集团深圳中大投资管理有限公司研究员、投资经理，中信基金管理有限公司研究员、基金经理、投委会成员。2005年9月至2007年3月任中信经典配置基金投资经理，2007年4月至2008年5月任中信红利精选基金的基金经理。2008年6月，加入友邦华泰基金管理有限公司。2008年9月起任友邦华泰盛世中国股票型基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

友邦华泰基金管理有限公司

地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编：200135

电话：(021) 3860 1777

第4页共8页

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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

(1) 行情回顾及运作分析

2008年4季度,在外围股市及经济减速影响下,国内股市继续下跌,但在降息驱动下,债市继续上涨。报告期中信标普300指数下跌17.92%,中标国债指数上涨4.3%。

报告期,在发达国家金融危机向经济转移及发展中国家经济减速冲击下,所有大宗商品价格都在跳水,原油价格从90美金跌到了40美金,铜也从6000美金跌到了3000美金。通胀压力迅速消散,通缩威胁取而代之。全球政府采用各种手段拯救经济,降息及扩大政府财政支出成为主旋律。

报告期,本基金净值表现超越业绩比较基准较多,原因分析如下:资产配置层面,维持了低于比较基准的股票仓位;行业配置层面,较好地规避了周期性行业下跌风险,加大了抗周期行业配置。

(2) 本基金业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.4202元,累计净值为2.1670元,本报告期内基金份额净值下跌5.80%,本基金的业绩比较基准下跌11.27%。报告期内,本基金实施了收益分配,每份基金份额获得0.066元红利。

(3) 市场展望和投资策略

在受外需不确定性大和能替代地产的内需新增长点难觅影响下,未来一段时间内经济难有起色,企业盈利下滑趋势进一步明确。在经历了一年多的快速下跌后,相对于全球其他经济体的增长速度,估值水平逐渐步入合理区间,市场的结构性机会逐渐增多。

基金管理人将尽力发现投资机会,规避投资风险,为您的信任奉献回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,413,079,246.59	61.27
	其中:股票	3,413,079,246.59	61.27
2	固定收益投资	541,353,000.00	9.72
	其中:债券	541,353,000.00	9.72
	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	1,587,095,945.65	28.49
6	其他资产	28,919,376.99	0.52

友邦华泰基金管理有限公司

地址:上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编:200135

电话:(021) 3860 1777

第5页共8页

7	合计	5,570,447,569.23	100.00
---	----	------------------	--------

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,222,285.64	0.09
B	采掘业	314,977,520.80	5.73
C	制造业	1,763,707,244.26	32.07
C0	食品、饮料	366,332,069.21	6.66
C1	纺织、服装、皮毛	34,761,383.28	0.63
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	263,828,752.50	4.80
C5	电子	1,537,037.94	0.03
C6	金属、非金属	241,340,981.39	4.39
C7	机械、设备、仪表	492,650,298.34	8.96
C8	医药、生物制品	363,256,721.60	6.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	100,702,939.26	1.83
E	建筑业	268,071,951.66	4.87
F	交通运输、仓储业	177,760,125.78	3.23
G	信息技术业	46,478,726.83	0.85
H	批发和零售贸易	239,046,546.51	4.35
I	金融、保险业	373,270,272.67	6.79
J	房地产业	78,578,956.22	1.43
K	社会服务业	4,509,265.38	0.08
L	传播与文化产业	36,369,542.30	0.66
M	综合类	4,383,869.28	0.08
	合计	3,413,079,246.59	62.07

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000792	盐湖钾肥	3,309,174	187,894,899.72	3.42
2	600030	中信证券	9,682,664	173,997,472.08	3.16
3	000629	攀钢钢钒	18,699,827	171,664,411.86	3.12
4	601766	中国南车	39,488,572	170,195,745.32	3.09
5	600583	海油工程	10,855,520	165,329,569.60	3.01
6	600519	贵州茅台	1,286,161	139,805,700.70	2.54
7	600511	国药股份	4,292,901	122,648,181.57	2.23

友邦华泰基金管理有限公司

地址:上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编:200135

电话:(021) 3860 1777

第6页共8页

8	601186	中国铁建	10,499,909	105,419,086.36	1.92
9	601328	交通银行	20,185,993	95,681,606.82	1.74
10	000028	一致药业	5,154,266	84,581,505.06	1.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	541,353,000.00	9.84
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	541,353,000.00	9.84

5.5 报告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

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	0801037	08央行票据37	1,900,000	183,958,000.00	3.35
2	0801034	08央行票据34	1,000,000	96,770,000.00	1.76
3	0801031	08央行票据31	1,000,000	96,710,000.00	1.76
4	0801016	08央行票据16	1,000,000	96,470,000.00	1.75
5	0801013	08央行票据13	700,000	67,445,000.00	1.23

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.8.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,669,545.66

友邦华泰基金管理有限公司

地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编：200135

电话：(021) 3860 1777

第7页共8页

2	应收证券清算款	6,445,578.10
3	应收股利	-
4	应收利息	17,933,218.37
5	应收申购款	1,871,034.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,919,376.99

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	12,736,320,800.97
报告期期间基金总申购份额	1,059,375,527.00
报告期期间基金总赎回份额	709,469,470.33
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	13,086,226,857.64

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金的公告

7.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人友邦华泰基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.aig-huatai.com

友邦华泰基金管理有限公司

地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层 邮编：200135

电话：(021) 3860 1777

第 8 页 共 8 页