

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金2008年年度报告

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

送出日期：2009年03月28日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年3月27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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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 .....	16
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.....	16
§6 审计报告 .....	16
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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 .....	53
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.....	53
8.9 投资组合报告附注 .....	53
§9 基金份额持有人信息 .....	54

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
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.....	55
§10 开放式基金份额变动 .....	55
§11 重大事件揭示.....	55
11.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	56
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 其他重大事件 .....	58
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
§13 备查文件目录.....	61
13.1 备查文件目录.....	61
13.2 存放地点.....	62
13.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金
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

### 2.2 基金产品说明

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

### 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	友邦华泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	<a href="mailto:cs4008880001@aig-huatai.com">cs4008880001@aig-huatai.com</a>
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼	北京市复兴门内大街1号
办公地址	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	北京市复兴门内大街1号

邮政编码	200135	100818
法定代表人	齐亮	肖钢

## 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	<a href="http://www.aig-huatai.com">http://www.aig-huatai.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

## 2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	友邦华泰基金管理有限公司
办公地址	上海湖滨路202号普华永道中心11楼	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

## § 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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
本期已实现收益	-5,635,424,415.31	480,303,848.86	335,510,870.60
本期利润	-6,999,171,826.17	1,184,298,719.46	476,963,605.64
加权平均基金份额本期利润	-0.5343	0.2749	0.9435
本期加权平均净值利润率	-77.17%	25.80%	77.48%
本期基金份额净值增长率	-51.94%	137.79%	109.81%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
期末可供分配利润	-2,967,733,760.48	3,606,763,733.15	125,109,643.86
期末可供分配基金份额利润	-0.2268	0.2722	0.2830

期末基金资产净值	5,499,105,977.45	13,403,111,697.76	689,793,982.30
期末基金份额净值	0.4202	1.0117	1.5604
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2008 年	2007 年	2006 年
基金份额累计净值增长率	148.54%	417.17%	117.49%

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。

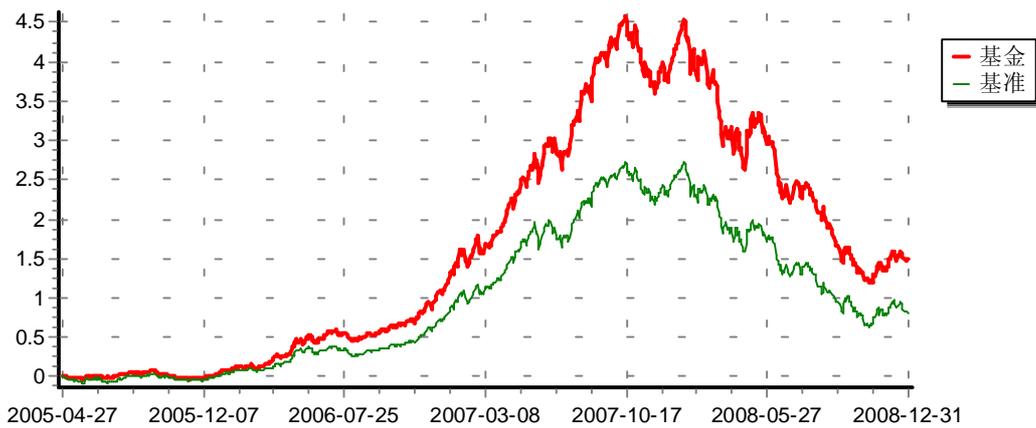
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.80%	1.65%	-11.27%	2.10%	5.47%	-0.45%
过去六个月	-24.34%	1.77%	-22.97%	2.06%	-1.37%	-0.29%
过去一年	-51.94%	2.15%	-49.24%	2.10%	-2.70%	0.05%
过去三年	139.76%	1.80%	78.50%	1.65%	61.26%	0.15%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效日起至今（2005年04月27日-2008年12月31日）	148.54%	1.65%	79.27%	1.54%	69.27%	0.11%

注：本基金的业绩基准由中信标普300指数和中信国债指数按照70%与30%之比构建，并每日进行再平衡。

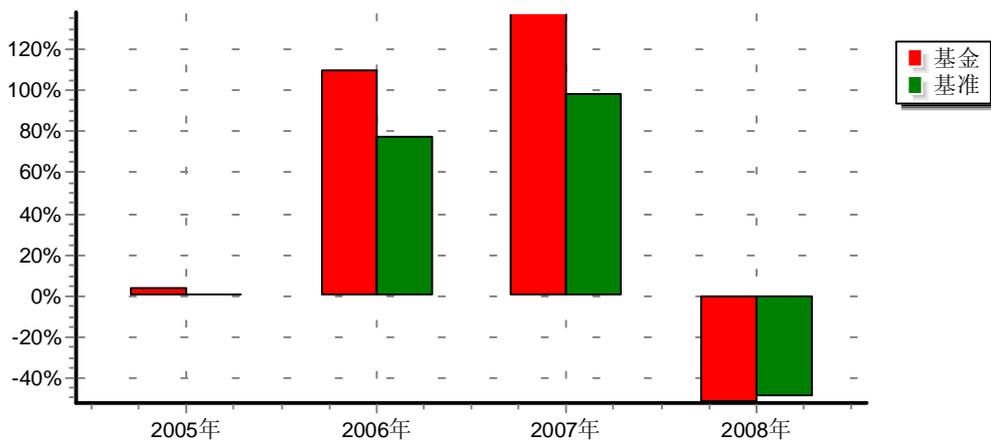
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：图示日期为2005年4月27日至2008年12月31日。

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%。

### 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：基金合同生效日为2005年4月27日，2005年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 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份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	0.660	371,065,948.27	425,680,470.82	796,746,419.09	12月25日实施

2007年	6.000	205,686,801.74	97,414,020.42	303,100,822.16	1月19日实施
2006年	3.750	162,910,990.18	35,140,681.87	198,051,672.05	3月10日、6月9日、11月20日实施
合计	10.410	739,663,740.19	558,235,173.11	1,297,898,913.30	

## § 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

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为AIG Global Investment Corp.、华泰证券股份有限公司和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资额分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、友邦华泰积极成长混合型证券投资基金和友邦华泰价值增长股票型证券投资基金。截至2008年12月31日，公司管理规模为127.03亿元。

#### 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		
梁丰	本基金的基金经理、投资部总监	2007年07月26日	—	15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。
汪晖	本基金的基金经理	2007年05月31日	2008年06月05日	15年	汪晖先生，硕士。历任华泰证券有限公司高级经理、华宝信托投资公司信托基金经理、华泰证券有限公司投资经理。2004年7月加入友邦华泰基金管理有限公司，2006年4月至2008年3月任友邦华泰中短期债券基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金基金经理（2007年12月友邦华泰中短期债券基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金），2007年5月31日至2008年6月5日任友邦华泰盛世中国股票型基金基金经理。2008年7月起担任友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金经理。
郭楷泽	本基金的基金经理	2008年09月03日	—	12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。
吕慧建	本基金的基金经理助理	2007年11月26日	—	11年	吕慧建先生, 1992年毕业于中国金融学院金融专业, 1998年获新加坡国立大学MBA学位。曾就职于深圳发展银行; 1998年7月至2003年1月历任中信集团中大投资管理有限责任公司高级证券分析师、上海业务总部副总、董事会秘书; 2003年2月至2007年6月期间在中信基金管理有限公司分别担任营销总监及行业研究员; 2007年6月加入我公司, 担任高级研究员, 2007年11月起任基金经理助理。

注: 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。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《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》及其他相关法律、法规的规定以及《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》的约定, 在严格控制风险的基础上, 忠实履行基金管理职责, 为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内, 基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

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。

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 1、行情回顾及运作分析

2008 年上半年受能源及农产品价格上涨影响，通胀压力增大，但下半年愈演愈烈的次贷危机迅速将大宗商品价格打下。在外围市场和国内宏观经济减速作用下，A股市场2008年迎来了大调整，几乎在整个08年间并未有像样的反弹，直到11月以后，在政府4万亿财政政策拉动下，才开始有所企稳。

报告期，本基金净值表现未能超越业绩比较基准，原因分析如下：资产配置上未能将股票仓位降至比较低的水平，债券的仓位没有提升，久期也过短；在行业配置上，对表现较好的农业、医药、建筑等配置力度不够，未能把握机会及时减持保险、煤炭、铁路运输等下半年表现较差的行业。

##### 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51.94%，本基金的业绩比较基准下跌49.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。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，A股估值水平逐渐步入合理区间。

由于全球经济何时恢复仍不太确定，大宗商品价格难有表现。但我们认为中国能先于其他经济体走出困境，因为政府仍有很多手段可以应用。在政府的刺激经济下，部分内需为主的行业有望率先企稳，同时，较低的原材料成本和利率也有助于这些行业利润回升。

因此，2009年行情并不悲观，结构性的机会将出现。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。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

2008年度，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

##### **(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规**

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置并进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

##### **(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规**

本年度公司监察稽核部门开展了对新基金募集和建仓期运作、公司投资研究业务、公司自有资金投资、投资人员管理、基金销售、员工投资基金合规情况等项目的专项监察稽核活动，并对发现问题及时发出合规提示函，要求整改，有效提高了公司各部门的合规意识。

##### **(3) 促进公司各项内部管理制度的完善**

按照证监会等监管机关的相关制度、规定和业务发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

#### (4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等提高员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

### 4.7 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，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理（除投资总监外）不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多6次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的80%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本基金于2008年12月25日进行了收益分配，每10份基金份额获得0.66元红利。截至本报告期末，基金可分配收益为负。

### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

## § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》

及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核。

本基金本期利润-6,999,171,826.17元、本期已实现收益-5,635,424,415.31元、期末可供分配利润-2,967,733,760.48元。本报告期内，本基金累计实际收益分配金额796,746,419.09元。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2008)第20232号

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金(以下简称“友邦华泰盛世中国基金”)的财务报表，包括2008年12月31日的资产负债表、2008年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是友邦华泰盛世中国基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2)选择和运用恰当的会计政策；

(3)作出合理的会计估计。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了友邦华泰盛世中国基金2008年12月31日的财务状况以及2008年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天	注册会计师	汪棣
会计师事务所有限公司		
中国 上海市	注册会计师	单峰
2009年3月27日		

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：友邦华泰盛世中国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
<b>资产：</b>			
银行存款	<b>7.4.7.1</b>	1,572,110,365.86	492,664,765.22
结算备付金		14,985,579.79	18,776,385.89
存出保证金		2,669,545.66	5,945,778.56
交易性金融资产	<b>7.4.7.2</b>	3,954,432,246.59	11,836,119,023.22

其中：股票投资		3,413,079,246.59	11,161,756,696.92
债券投资		541,353,000.00	674,362,326.30
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	<b>7.4.7.3</b>	—	12,612,319.13
买入返售金融资产	<b>7.4.7.4</b>	—	1,000,001,740.00
应收证券清算款		6,445,578.10	37,530,298.23
应收利息	<b>7.4.7.5</b>	17,933,218.37	16,088,065.46
应收股利		—	—
应收申购款		1,871,034.86	54,079,083.68
其他资产	<b>7.4.7.6</b>	—	—
资产总计		5,570,447,569.23	13,473,817,459.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		54,050,621.73	—
应付赎回款		1,299,346.92	45,297,633.24
应付管理人报酬		7,427,422.03	15,862,831.62
应付托管费		1,237,903.68	2,643,805.27
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	<b>7.4.7.7</b>	5,352,832.26	5,180,882.75
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
其他负债	<b>7.4.7.8</b>	1,973,465.16	1,720,608.75
负债合计		71,341,591.78	70,705,761.63
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	<b>7.4.7.9</b>	5,475,348,949.59	5,543,373,598.18
未分配利润	<b>7.4.7.10</b>	23,757,027.86	7,859,738,099.58
所有者权益合计		5,499,105,977.45	13,403,111,697.76
负债和所有者权益总计		5,570,447,569.23	13,473,817,459.39

注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值0.4202元，基金份额总额13,086,226,857.64份。

## 7.2 利润表

会计主体：友邦华泰盛世中国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01月01日-2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007 年12月31日
一、收入		-6,785,460,991.64	1,333,711,832.48
1.利息收入		31,730,442.99	11,508,812.49
其中：存款利息收入	<b>7.4.7.11</b>	10,398,789.76	5,650,560.02
债券利息收入		19,121,877.97	5,566,405.89
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		2,209,775.26	291,846.58
2.投资收益		-5,456,731,767.35	615,537,691.45
其中：股票投资收益	<b>7.4.7.12</b>	-5,543,573,961.31	606,489,203.27
债券投资收益	<b>7.4.7.13</b>	6,510,557.15	-427,317.60
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益	<b>7.4.7.14</b>	10,277,343.65	3,140,368.64
股利收益	<b>7.4.7.15</b>	70,054,293.16	6,335,437.14
3.公允价值变动收益	<b>7.4.7.16</b>	-1,363,747,410.86	703,994,870.60
4.其他收入	<b>7.4.7.17</b>	3,287,743.58	2,670,457.94

二、费用		-213,710,834.53	-149,413,113.02
1. 管理人报酬		-137,101,982.19	-67,758,340.03
2. 托管费		-22,850,330.38	-11,293,056.72
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	<b>7.4.7.18</b>	-53,185,004.13	-69,849,401.75
5. 利息支出		-62,118.95	-86,708.78
其中：卖出回购金融资产支出		-62,118.95	-86,708.78
6. 其他费用	<b>7.4.7.19</b>	-511,398.88	-425,605.74
三、利润总额		-6,999,171,826.17	1,184,298,719.46

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰盛世中国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	本期 2008年01月01日-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	5,543,373,598.18	7,859,738,099.58	13,403,111,697.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	—	-6,999,171,826.17	-6,999,171,826.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-68,024,648.59	-40,062,826.46	-108,087,475.05
其中：1.基金申购款	1,558,556,456.90	1,304,483,792.68	2,863,040,249.58
2.基金赎回款	-1,626,581,105.49	-1,344,546,619.14	-2,971,127,724.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-796,746,419.09	-796,746,419.09
五、期末所有者权益（基金净值）	5,475,348,949.59	23,757,027.86	5,499,105,977.45

项 目	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	442,070,287.33	247,723,694.97	689,793,982.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	—	1,184,298,719.46	1,184,298,719.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	5,101,303,310.85	6,730,816,507.31	11,832,119,818.16
其中：1.基金申购款	6,288,198,773.16	7,879,239,074.63	14,167,437,847.79
2.基金赎回款	-1,186,895,462.31	-1,148,422,567.32	-2,335,318,029.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-303,100,822.16	-303,100,822.16
五、期末所有者权益（基金净值）	5,543,373,598.18	7,859,738,099.58	13,403,111,697.76

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2005]第19号《关于同意友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》核准，由友邦华泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币900,348,752.84元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第48号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》于2005年4月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为900,519,775.77份基金份额，其中认购资金利息折合171,022.93份基金份额。本基金的基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》和《友邦华泰基金管理有限公司关于友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于2007年9月3日进行了基金份额拆分，拆分比例为2.390029438，并于2007

年9月4日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金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%。此外，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的5%。本基金的业绩比较基准为：中信标普300指数×70%+中信国债指数×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司于2009年3月27日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2008年度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2008年12月31日的财务状况以及2008年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

#### (i) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (ii) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(i)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii)当金融工具不存在活跃市场,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公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金

额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

收益分配原则：

1、基金收益分配采用现金方式，投资人可选择获取现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金分红；

- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；
- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多6次；
- 7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的80%；成立不满3个月，收益可不分配；
- 8、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(i)对于特殊事项停牌股票，2008年9月16日之前按停牌前最后交易日的收盘价估值；根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(ii)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（以下简称《指导意见》），经与基金托管人协商一致，友邦华泰基金管理有限公司自2008年9月16日起，参照《指导意见》的原则，对旗下相关基金持有的停牌股票的估值方法进行调整，采用《中国证券业协会基金估值小组关于停牌股票估值的参考方法》中的“指数收益法”，作为对原有估值方法的完善和补充。

本基金于2008年9月16日对持有的长期停牌股票（云天化、长江电力、邯郸钢铁和盐湖钾肥）改用上述估值技术进行估值，确认的公允价值变动损失为116,824,892.82元，本基金的资产净值所受影响相对9月12日的基金资产净值为-1.76%。

截至本报告期末，基金持有的云天化和邯郸钢铁已恢复采用市价法进行估值。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d)基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出

股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
活期存款	1,572,110,365.86	492,664,765.22
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	1,572,110,365.86	492,664,765.22

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2008年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		3,913,225,996.03	3,413,079,246.59	-500,146,749.44
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	539,474,060.00	541,353,000.00	1,878,940.00
	合计	539,474,060.00	541,353,000.00	1,878,940.00
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		4,452,700,056.03	3,954,432,246.59	-498,267,809.44
项目		上年度末 2007年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		10,300,692,339.30	11,161,756,696.92	861,064,357.62
债券	交易所市场	19,965,668.40	21,365,326.30	1,399,657.90
	银行间市场	652,623,970.00	652,997,000.00	373,030.00

	合计	672,589,638.40	674,362,326.30	1,772,687.90
	资产支持证券	—	—	—
	其他	—	—	—
	合计	10,973,281,977.70	11,836,119,023.22	862,837,045.52

注：1、于2008年12月31日，股票投资余额中包括按照指数收益法估值(附注7.4.4.12)的特殊事项停牌相关股票192,745,899.72元(2007年12月31日：无)。采用该估值技术的股票投资于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为80,239,602.65元(2007年度：无)。

2、债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动收益为1,505,910.00元(2007年度：373,030.00元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日			
	名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	—	—	
项目	上年度末 2007年12月31日			
	名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	12,612,319.13	—	成本:9,969,763.23
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	12,612,319.13	—	

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	
	本期末账面余额	其中：买断式逆回购
合计	—	—
项目	上年度末 2007年12月31日	
	本期末账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	1,000,001,740.00	—
合计	1,000,001,740.00	—

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
应收活期存款利息	349,401.65	246,966.25
应收结算备付金利息	7,267.95	9,294.34
应收债券利息	17,576,481.68	15,545,469.21
应收买入返售证券利息	—	286,267.13
应收申购款利息	—	—
其他	67.09	68.53
合计	17,933,218.37	16,088,065.46

**7.4.7.6 其他资产**

无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2008年12月31日	2007年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,348,782.26	5,177,042.75
银行间市场应付交易费用	4,050.00	3,840.00
合计	5,352,832.26	5,180,882.75

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,250,000.00
应付赎回费	3,465.16	170,608.75
预提审计费	170,000.00	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00	200,000.00
合计	1,973,465.16	1,720,608.75

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2008年01月01日-2008年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,248,754,083.02	5,543,373,598.18
本期申购	3,725,005,733.74	1,558,556,456.90
本期赎回	-3,887,532,959.12	-1,626,581,105.49
本期末	13,086,226,857.64	5,475,348,949.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	3,606,763,733.15	4,252,974,366.43	7,859,738,099.58
本期利润	-5,635,424,415.31	-1,363,747,410.86	-6,999,171,826.17
本期基金份额交易产	-142,326,659.23	102,263,832.77	-40,062,826.46

生的变动数			
其中：基金申购款	461,306,648.89	843,177,143.79	1,304,483,792.68
基金赎回款	-603,633,308.12	-740,913,311.02	-1,344,546,619.14
本期已分配利润	-796,746,419.09	—	-796,746,419.09
本期末	-2,967,733,760.48	2,991,490,788.34	23,757,027.86

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
活期存款利息收入	10,248,364.74	5,490,246.62
结算备付金利息收入	150,425.02	160,313.40
其他	—	—
合计	10,398,789.76	5,650,560.02

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
卖出股票成交总额	11,501,904,570.06	4,692,232,812.77
卖出股票成本总额	-17,045,478,531.37	-4,085,743,609.50
买卖股票差价收入	-5,543,573,961.31	606,489,203.27

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日

卖出债券、债转股及债券到期 兑付成交金额	2,341,819,774.82	484,344,944.03
卖出债券、债转股及债券到期 兑付成本总额	-2,299,963,632.98	-481,609,568.37
应收利息总额	-35,345,584.69	-3,162,693.26
债券投资收益	6,510,557.15	-427,317.60

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
卖出权证成交金额	46,307,868.13	6,963,720.85
卖出权证成本总额	-36,030,524.48	-3,823,352.21
买卖权证差价收入	10,277,343.65	3,140,368.64

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
股票投资产生的股利收益	70,054,293.16	6,335,437.14
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	70,054,293.16	6,335,437.14

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
----	-------------------------------------	--

1.交易性金融资产	-1,361,104,854.96	701,352,314.70
——股票投资	-1,361,211,107.06	699,579,626.80
——债券投资	106,252.10	1,772,687.90
——资产支持证券投资	—	—
2.衍生工具	-2,642,555.90	2,642,555.90
——权证投资	-2,642,555.90	2,642,555.90
3.其他	—	—
合计	-1,363,747,410.86	703,994,870.60

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
基金赎回费收入	3,209,093.32	2,665,212.69
转换费收入	32,338.01	5,245.25
其他收入	46,312.25	—
合计	3,287,743.58	2,670,457.94

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的25%的部分归入基金财产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
交易所市场交易费用	53,176,554.13	69,845,351.75
银行间市场交易费用	8,450.00	4,050.00
合计	53,185,004.13	69,849,401.75

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期发生 2008年01月01日-2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年 12月31日
审计费用	170,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	41,398.88	25,605.74
合计	511,398.88	425,605.74

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于2009年1月5日对持有的盐湖钾肥恢复采用市价法进行估值。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
友邦华泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东

##### 7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，关联方关系未发生变化。

##### 7.4.9.2 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
-------	---------

友邦华泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日-2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31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
华泰证券股份有限公司	4,896,146,134.08	22.44%	3,711,125,345.38	20.32%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日-2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31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
华泰证券股份有限公司	10,803,163.76	23.33%	249,119.00	2.31%

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2008年01月01日-2008年12月31日	2007年01月01日-2007年12月31日

	日		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
华泰证券股份有限公司	90,295,090.60	37.91%	2,620,723.10	49.12%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日-2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
华泰证券股份有限公司	4,129,965.17	22.59%	1,679,175.81	31.39%
关联方名称	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
华泰证券股份有限公司	2,988,842.61	20.33%	1,181,997.01	22.83%

注：上述佣金按股票交易量的千分之一计算，以扣除证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务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。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2008年01月01日-2008年12月 31日	2007年01月01日-2007年12月 31日
当期应支付的管理费	137,101,982.19	67,758,340.03
其中：当期已支付	129,674,560.16	51,895,508.41
期末未支付	7,427,422.03	15,862,831.62

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，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。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日-2008年12月 31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月 31日
当期应支付的托管费	22,850,330.38	11,293,056.72
其中：当期已支付	21,612,426.70	8,649,251.45
期末未支付	1,237,903.68	2,643,805.27

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

#### 7.4.10.3 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 2008年01月01日-2008年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	602,268,089.32	—	—	—	194,000,000.00	61,707.95
上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	517,112,104.93	—	—	—	69,300,000.00	28,441.48

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期，基金管理公司未投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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：本报告期，基金管理公司主要股东及其控制的机构未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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 2008年01月01日-2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31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
中国银行股份有限公司	1,572,110,365.86	10,248,364.74	492,664,765.22	5,490,246.62

注：本报告期，基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利

率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2008-12-25	2008-12-25	0.660	371,065,948.27	425,680,470.82	796,746,419.09

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600489	中金黄金	2008-03-03	2009-03-02	非公开增发	78.00	37.24	1,948,717	151,999,926.00	72,570,221.08
002257	立立电子	2008-06-30		新股申购	21.81	21.81	70,474	1,537,037.94	1,537,037.94

注：1、根据宁波立立电子股份有限公司2008年7月7日发布的公告，有关监管部门要求保荐人等中介机构对媒体报道的有关问题进行核查，上市日期待定。

2、立立电子网下申购数量43,974股，其余为网上申购。

##### 7.4.12.2 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	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
------	------	------	------	--------	------	--------	----	--------	--------

000792	盐湖钾肥	2008-06-26	重大资产重组	56.78	2008-12-26	78.23	3,309,174	165,129,764.48	187,894,899.72
600900	长江电力	2008-05-08	重大资产重组	7.35		—	660,000	10,979,987.00	4,851,000.00

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自2008年12月26日复牌至2008年12月31日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于2008年12月31日采用指数收益法估值。该股票于2009年1月8日打开跌停板，当日的收盘价为每股37.99元。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，

结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且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的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%。

#### **7.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。

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投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为三个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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，适用于本基金的市场风险包括利率风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	1,572,110,365.86						1,572,110,365.86
结算备付金	14,985,579.79						14,985,579.79
存出保证金	138,549.12					2,530,996.54	2,669,545.66
交易性金融资产	67,445,000.00	289,950,000.00	183,958,000.00			3,413,079,246.59	3,954,432,246.59
应收证券清算款						6,445,578.10	6,445,578.10

应收利息						17,933,218.37	17,933,218.37
应收申购款	1,871,034.86						1,871,034.86
资产总计	1,656,550,529.63	289,950,000.00	183,958,000.00	—	—	3,439,989,039.60	5,570,447,569.60
负债							
应付证券清算款						54,050,621.73	54,050,621.73
应付赎回款						1,299,346.92	1,299,346.92
应付管理人报酬						7,427,422.03	7,427,422.03
应付托管费						1,237,903.68	1,237,903.68
应付交易费用						5,352,832.26	5,352,832.26
其他负债						1,973,465.16	1,973,465.16
负债总计						71,341,591.78	71,341,591.78
利率敏感度缺口	1,656,550,529.63	289,950,000.00	183,958,000.00	—	—	3,368,647,447.82	5,499,105,977.82
上年度末 2007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	492,664,765.22						492,664,765.22
结算备付金	18,776,385.89						18,776,385.89
存出保证金	138,549.12					5,807,229.44	5,945,778.56
交易性金融资产	145,920,000.00	437,175,000.00	69,902,000.00	1,417,132.30	19,948,194.00	11,161,756,696.92	11,836,119,023.22
衍生金融资产						12,612,319.13	12,612,319.13
买入返售金融资产	1,000,001,740.00						1,000,001,740.00
应收证券清算款						37,530,298.23	37,530,298.23
应收利息						16,088,065.46	16,088,065.46
应收申购款	54,079,083.68						54,079,083.68
资产总计	1,711,580,523.91	437,175,000.00	69,902,000.00	1,417,132.30	19,948,194.00	11,233,794,609.18	13,473,817,459.18
负债							
应付赎回款						45,297,633.24	45,297,633.24
应付管理人报酬						15,862,831.62	15,862,831.62
应付托管费						2,643,805.27	2,643,805.27
应付交易费						5,180,882.75	5,180,882.75

用							
其他负债						1,720,608.75	1,720,608.75
负债总计						70,705,761.63	70,705,761.63
利率敏感度缺口	1,711,580,523.91	437,175,000.00	69,902,000.00	1,417,132.30	19,948,194.00	11,163,088,847.55	13,403,111,697.55

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至2008年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为9.84%(2007年12月31日：5.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中股票投资比例为基金净资产的60%-90%，债券、现金及其它短期金融工具为0%-40%。此外，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的5%。于2008年12月31日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日		上年度末 2007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	3,413,079,246.59	62.07	11,161,756,696.92	83.28
衍生金融资产-权证投资	—	—	12,612,319.13	0.09
其他	—	—	—	—
合计	3,413,079,246.59	62.07	11,174,369,016.05	83.37

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“中信标普300指数”以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币亿元）	
		本期末	上年度末
	中信标普300指数上涨5%	1.28	5.51
	中信标普300指数下跌5%	-1.28	-5.51

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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（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
7	合计	5,570,447,569.23	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（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

### 8.3 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(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
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
11	600600	青岛啤酒	4,026,134	80,482,418.66	1.46
12	000895	双汇发展	2,171,299	74,866,389.52	1.36
13	600694	大商股份	4,153,909	74,604,205.64	1.36
14	600489	中金黄金	1,948,717	72,570,221.08	1.32
15	000651	格力电器	3,695,471	71,839,956.24	1.31
16	600428	中远航运	10,942,570	70,032,448.00	1.27
17	000983	西山煤电	5,910,427	68,915,578.82	1.25
18	600068	葛洲坝	7,773,990	68,722,071.60	1.25
19	002242	九阳股份	1,494,825	66,519,712.50	1.21
20	002267	陕天然气	5,415,189	64,440,749.10	1.17
21	601398	工商银行	15,999,912	56,639,688.48	1.03
22	601390	中国中铁	10,441,470	56,592,767.40	1.03
23	002028	思源电气	2,000,278	56,007,784.00	1.02

24	000869	张裕A	1,055,969	51,214,496.50	0.93
25	002152	广电运通	1,673,751	49,492,817.07	0.90
26	600033	福建高速	9,617,323	47,028,709.47	0.86
27	600125	铁龙物流	7,690,405	42,989,363.95	0.78
28	600062	双鹤药业	1,768,133	42,594,323.97	0.77
29	600837	海通证券	4,999,939	40,549,505.29	0.74
30	000826	合加资源	4,177,173	39,181,882.74	0.71
31	600697	欧亚集团	2,686,042	38,813,306.90	0.71
32	000963	华东医药	3,467,734	37,347,495.18	0.68
33	600820	隧道股份	3,425,507	37,338,026.30	0.68
34	002038	双鹭药业	1,014,200	37,200,856.00	0.68
35	600161	天坛生物	2,559,996	37,171,141.92	0.68
36	600690	青岛海尔	3,936,940	35,393,090.60	0.64
37	002029	七匹狼	3,304,314	34,761,383.28	0.63
38	600808	马钢股份	9,999,941	32,299,809.43	0.59
39	600267	海正药业	2,140,110	31,973,243.40	0.58
40	600383	金地集团	4,699,966	30,596,778.66	0.56
41	600880	博瑞传播	2,249,874	29,810,830.50	0.54
42	600718	东软集团	2,498,027	29,301,856.71	0.53
43	000800	一汽轿车	3,999,911	28,719,360.98	0.52
44	600323	南海发展	3,480,152	27,771,612.96	0.51
45	000538	云南白药	778,149	26,776,107.09	0.49
46	000616	亿城股份	6,699,922	26,665,689.56	0.48
47	000731	四川美丰	3,999,936	25,559,591.04	0.46
48	002007	华兰生物	614,618	23,662,793.00	0.43
49	600479	千金药业	1,162,271	22,524,811.98	0.41
50	600581	八一钢铁	4,399,907	21,911,536.86	0.40
51	600276	恒瑞医药	504,400	19,424,444.00	0.35
52	600717	天津港	2,040,277	17,709,604.36	0.32
53	000002	万科A	2,627,440	16,946,988.00	0.31

54	002032	苏泊尔	1,259,383	15,465,223.24	0.28
55	000848	承德露露	950,629	15,086,482.23	0.27
56	600271	航天信息	445,572	11,232,870.12	0.20
57	600315	上海家化	399,300	11,192,379.00	0.20
58	601088	中国神华	465,345	8,162,151.30	0.15
59	001696	宗申动力	1,000,000	7,360,000.00	0.13
60	600831	广电网络	880,364	6,558,711.80	0.12
61	000860	顺鑫农业	475,618	5,222,285.64	0.09
62	600573	惠泉啤酒	909,810	4,876,581.60	0.09
63	600900	长江电力	660,000	4,851,000.00	0.09
64	600415	小商品城	79,881	4,383,869.28	0.08
65	000966	长源电力	1,299,849	3,639,577.20	0.07
66	601169	北京银行	400,000	3,564,000.00	0.06
67	600050	中国联通	700,000	3,521,000.00	0.06
68	002269	美邦服饰	107,612	2,980,852.40	0.05
69	600879	火箭股份	329,999	2,861,091.33	0.05
70	000001	深发展A	300,000	2,838,000.00	0.05
71	600054	黄山旅游	209,401	2,801,785.38	0.05
72	002153	石基信息	50,000	2,423,000.00	0.04
73	000402	金融街	300,000	2,283,000.00	0.04
74	600517	置信电气	100,000	2,239,000.00	0.04
75	600322	天房发展	650,000	2,086,500.00	0.04
76	002122	天马股份	37,910	2,021,740.30	0.04
77	600236	桂冠电力	279,000	1,707,480.00	0.03
78	002257	立立电子	70,474	1,537,037.94	0.03

#### 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	601318	中国平安	850,569,889.99	6.35
2	000983	西山煤电	383,970,044.40	2.86
3	600030	中信证券	315,482,718.77	2.35
4	601088	中国神华	222,579,070.95	1.66
5	600426	华鲁恒升	206,927,491.15	1.54
6	000839	中信国安	205,699,282.15	1.53
7	601006	大秦铁路	202,018,983.29	1.51
8	600550	天威保变	194,164,510.17	1.45
9	002024	苏宁电器	192,147,735.84	1.43
10	600582	天地科技	190,936,783.75	1.42
11	600489	中金黄金	185,314,184.68	1.38
12	600694	大商股份	181,255,864.12	1.35
13	000024	招商地产	179,822,865.97	1.34
14	600036	招商银行	171,380,730.51	1.28
15	000629	攀钢钢钒	170,160,660.50	1.27
16	601766	中国南车	167,873,598.66	1.25
17	600050	中国联通	163,644,399.08	1.22
18	000012	南玻A	162,616,324.67	1.21
19	000968	煤气化	154,883,871.62	1.16
20	601328	交通银行	151,144,974.38	1.13

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	659,081,505.14	4.92
2	000983	西山煤电	454,808,166.39	3.39
3	600005	武钢股份	353,928,159.45	2.64

4	600050	中国联通	350,255,799.78	2.61
5	600030	中信证券	341,416,147.99	2.55
6	600000	浦发银行	336,471,522.15	2.51
7	600036	招商银行	305,688,316.37	2.28
8	601088	中国神华	272,022,218.41	2.03
9	000002	万科A	255,995,493.66	1.91
10	601006	大秦铁路	230,621,950.19	1.72
11	600019	宝钢股份	207,717,931.76	1.55
12	600547	山东黄金	198,109,583.18	1.48
13	000680	山推股份	175,028,146.48	1.31
14	000625	长安汽车	174,595,992.29	1.30
15	000001	深发展A	165,349,398.02	1.23
16	000024	招商地产	165,074,071.19	1.23
17	000898	鞍钢股份	162,442,008.14	1.21
18	000968	煤气化	146,200,834.98	1.09
19	601666	平煤股份	143,427,347.48	1.07
20	002024	苏宁电器	142,872,985.16	1.07

注：不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,658,012,188.10
卖出股票的收入（成交）总额	11,501,904,570.06

注：不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	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

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801037	08央行票据37	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

### 8.7 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。

### 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内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。

8.9.2 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。

#### 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	2,669,545.66
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	其他	—
8	合计	28,919,376.99

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000792	盐湖钾肥	187,894,899.72	3.42	长期停牌复牌后连续跌停

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自2008年12月26日复牌至2008年12月31日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于2008年12月31日采用指数收益法估值。该股票于2009年1月8日打开跌停板，当日的收盘价为每股37.99元。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### § 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	占总份	持有	占总份

		份额	额比例	份额	额比例
709,163	18,453.06	438,776,054.54	3.35%	12,647,450,803.10	96.65%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,512,565.81	0.01%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年04月27日)基金份额总额	900,519,775.77
报告期期初基金份额总额	13,248,754,083.02
报告期期间基金总申购份额	3,725,005,733.74
报告期期间基金总赎回份额	3,887,532,959.12
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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于2008年6月5日发布公告，经友邦华泰基金管理有限公司第一届董事会2008年第一次会议审议通过，并经中国证监会审核批准（证监许可字【2008】753号），友邦华泰基金管理有限公司决定聘任房伟力先生和刘宏友先生担任公司副总经理。

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为170,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了4年的审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 11.7 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		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
华泰证券	2	4,896,146,134.08	22.44%	4,129,965.17	22.59%
中金公司	2	2,974,076,099.79	13.63%	2,489,537.24	13.62%
中投证券	1	2,778,929,326.62	12.74%	2,257,902.28	12.35%
中信证券	1	1,937,473,683.64	8.88%	1,574,211.19	8.61%
北京高华	1	1,513,771,846.29	6.94%	1,286,698.54	7.04%
中信建投	1	1,166,511,720.36	5.35%	991,526.33	5.42%
安信证券	1	1,134,545,027.64	5.20%	964,363.61	5.28%
国金证券	1	1,100,108,271.18	5.04%	935,089.59	5.12%
联合证券	1	841,841,278.38	3.86%	715,562.37	3.91%
中银国际	1	828,360,312.91	3.80%	704,101.12	3.85%
申银万国	1	754,430,923.96	3.46%	641,268.19	3.51%
国泰君安	1	571,341,153.40	2.62%	485,637.61	2.66%
光大证券	1	532,969,305.51	2.44%	433,041.12	2.37%
齐鲁证券	1	430,219,183.98	1.97%	365,686.45	2.00%

银河证券	1	357,505,718.37	1.64%	303,878.29	1.66%
券商名称	交易 单元 数量	债券交易			
		成交金额		占当期成交总额的比例	
华泰证券	2	90,295,090.60			37.91%
北京高华	1	66,722,384.05			28.01%
中信证券	1	65,758,509.93			27.61%
联合证券	1	10,318,741.87			4.33%
光大证券	1	3,150,000.00			1.32%
安信证券	1	1,293,665.00			0.54%
中信建投	1	645,847.54			0.27%
券商名称	交易 单元 数量	债券回购交易			
		成交金额		占当期成交总额的比例	
国金证券	1	200,000,000.00			100.00%
券商名称	交易 单元 数量	权证交易			
		成交金额		占当期成交总额的比例	
中信证券	1	21,786,016.57			47.05%
华泰证券	2	10,803,163.76			23.33%
安信证券	1	8,804,510.23			19.01%
联合证券	1	2,670,013.31			5.77%
北京高华	1	2,244,164.26			4.85%

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，并能提供全面的信息服。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报及周到的信息服，并能根

据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

## 2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内，基金管理人代表基金新增租用了中银国际证券有限责任公司、齐鲁证券有限责任公司、北京高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司和国金证券股份有限公司的专用交易单元。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	参加国泰君安证券开放式基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-01-18
2	友邦华泰盛世中国基金季度报告 (2007年第4季度)	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-01-21
3	关于增加北京银行为代销机构的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-01-25
4	关于投资中金黄金非公开增发的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-04
5	关于增加农业银行为友邦华泰盛 世中国基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-11
6	关于在交通银行开通基金转换业 务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-18
7	参加工商银行基金定投申购费率 优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-20
8	友邦华泰盛世中国基金参加农业 银行定期定额申购费率优惠活 动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-25
9	参加招商银行网上银行申购费率 优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-28
10	友邦华泰盛世中国基金2007年度 报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-03-28
11	继续参加工行网银申购费率优惠	中国证券报、上海证券报、	2008-03-31

	的公告	证券时报	
12	北京银行开展定期定额业务及网银渠道申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-04-08
13	关于增加民生银行为代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-04-10
14	关于增加中信银行为代销机构并开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-04-11
15	参加德邦证券基金网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-04-17
16	友邦华泰盛世中国基金季度报告 (2008年第1季度)	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-04-19
17	关于增加国元证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-05-06
18	关于增加信泰证券为代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-05-06
19	参加民生银行基金网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-05-07
20	参加财通证券基金网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-05-09
21	关于增加第一创业证券为代销机构并开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-05-21
22	关于增加齐鲁证券为代销机构并开通定期定额及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-05-22
23	友邦华泰基金公司关于调整基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-06-06
24	友邦华泰盛世中国基金招募说明书更新	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-06-10
25	关于增加泰阳证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-06-11
26	参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-06-12

27	关于参加中国银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-06-12
28	关于增加渤海证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-06-13
29	在民生银行推出基金定期定额计划的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-07-09
30	友邦华泰盛世中国基金季度报告（2008年第2季度）	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-07-21
31	关于对农业银行金穗借记卡持有人开通友邦华泰网上交易定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-07-29
32	友邦华泰盛世中国基金2008年半年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-08-28
33	友邦华泰盛世中国基金2008年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-08-28
34	关于调整农行金穗卡网上交易申购费率公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-08-29
35	关于增加友邦华泰盛世中国基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-09-03
36	关于公司旗下基金资产估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-09-16
37	关于公司旗下基金资产估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-09-17
38	友邦华泰盛世中国基金季度报告（2008年第3季度）	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-10-23
39	关于旗下基金参加光大证券网上基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-10-27
40	关于增加方正证券为代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-11-12
41	关于在齐鲁证券开通基金定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-04
42	友邦华泰盛世中国基金更新的招	中国证券报、上海证券报、	2008-12-09

	募说明书	证券时报	
43	友邦华泰盛世中国基金更新的招募说明书（摘要）	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-09
44	关于调整基金定期定额最低申购金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-11
45	参加深圳发展银行网上交易和电话银行交易优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-13
46	关于增加华夏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-17
47	友邦华泰盛世中国基金第六次分红预告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-20
48	友邦华泰盛世中国基金第六次分红公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-26
49	关于公司旗下基金持有的盐湖钾肥等长期停牌股票复牌后估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-27
50	关于参加工商银行-"2009倾心回馈"基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-29
51	友邦华泰基金管理有限公司迁址公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-30
52	关于参加邮储银行定期定额投资优惠期间延长的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-30
53	关于旗下基金持有的邯郸钢铁股票恢复采用收盘价估值的提示公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2008-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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](http://www.aig-huatai.com)