

(上接D154版) 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期
	2008年1月10日至2008年12月31日
期初持有的基金份额	22,674,461.00
期间认购的份额	-
期间申购或定投的份额	-
期间因分红增加的份额	27,035,642.18
期间赎回或卖出的份额	49,710,103.18
期末持有的基金份额	22,674,461.00
期末持有的基金份额占基金资产净值比例(%)	1.54%

注:基金持有的基金资产净值为22,674,461.00份,期间因分红增加份额27,035,642.18份。该等投资的交易费用、申购费用及赎回费用已从基金资产中扣除。

9.4.8.2 报告期末基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于2008年末未持有本基金。

9.4.8.3 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

项目	本期
	2008年1月10日至2008年12月31日
期初存款余额	342,818,199.52
当期利息收入	6,822,611.01

9.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销券的情况

本基金自2008年1月10日至(基金生效日)至2008年12月31日止计价期间,未在承销期内参与关联方承销证券。

9.4.9 报告期(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

9.4.9.1 因认购新发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

关联方名称	本期
	2008年1月10日至2008年12月31日
中国工商银行	342,818,199.52
当期利息收入	6,822,611.01

9.4.8.8 本基金在承销期内参与关联方承销券的情况

本基金自2008年1月10日至(基金生效日)至2008年12月31日止计价期间,未在承销期内参与关联方承销证券。

9.4.9.2 报告期末本基金持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通受限证券数量(单)	期末估值(单位:亿元)	期末总份额(单)	期末估值(单)
002257 立讯 2008年6月30日	未确权新股网下申购	21.81	21.81	17,000	370,770.00	370,770.00

注:基金已使用其名义开立的股票账户,比照个人投资者和一般法人,普通投资者参与新股认购,其中基金作为一般法人或机构投资者的身份,根据基金与上市公司签署的协议,在新股上市后的约定时间内不能自由转让。转让时应作为个人投资者或机构在网上购买股票的权限或增发新股,从新股发行日起至股票上市之日起不能自由转让。

9.4.9.3 期末持有的流通受限证券的公司名称:立讯精密有限公司 2008年7月7日公布的公告,有关监管层将要求保荐人等中介机构对媒体报道的有关问题进行核查,上市公司暂停上市。

9.4.9.4 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)	复牌日期	开盘价(单)	期末总份额(单)	期末估值(单)
000790 盐湖钾肥 2008年6月26日	资产重组	56.78	2008年12月26日	87.23	185,183	1,729,720.34	10,514,690.74	1,304,255.95

注:香港盐湖钾肥有限公司股票自2008年12月26日交易开始日起即停牌,股票价格以停牌前一日的收盘价为每股价37.99元。

9.4.9.5 期末货币市场基金投资情况

本基金在报告期末未持有货币市场基金。

9.4.9.6 期末持有的长期股权投资

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	1,828,861,483.97	97.66
2	固定收益投资	1,828,861,483.97	97.66
3	货币市场基金投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	42,535,839.32	2.27
6	其他资产	1,304,025.95	0.07
7	合计	1,872,701,349.24	100.00

10.1 基金合同生效前一日基金资产组合情况

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	1,828,861,483.97	97.66
2	固定收益投资	1,828,861,483.97	97.66
3	货币市场基金投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	42,535,839.32	2.27
6	其他资产	1,304,025.95	0.07
7	合计	1,872,701,349.24	100.00

10.2 基金合同生效前一日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 制造业	200,049,307,397.00	10.97	
C 交通运输、仓储和邮政业	309,185,979.00	0.17	
D 钢铁、有色、建材、家具、家电	120,695,890.90	0.64	
E 化工、石油、化学、塑胶、塑料	—	—	
F 通信、计算机、电子	3,910,550,000.00	0.21	
G 其他行业	199,679,166.72	0.10	
H 采掘业	11,785,971.18	0.06	
I 金属、非金属	174,000,826.02	0.93	
J 机械设备	333,270,222.08	1.78	
K 医药生物	59,827,378.50	0.30	
L 造纸、印刷及文化用品业	—	—	
M 其他	2,410,140.80	0.13	
N 水力、电力、燃气及水的生产和供应业	—	—	
O 建筑业	—	—	
P 交通运输、仓储和邮政业	—	—	
Q 金融、保险业	40,946,648.80	2.19	
R 信息技术业	—	—	
S 其他	—	—	
T 买入返售金融资产	—	—	
U 融资融券	210,904,790.28	11.39	
V 其他	356,931,876.06	19.10	
W 证券业	45,519,920.58	2.44	
X 社会公众服务业	18,622,978.53	1.00	
Z 其他	22,700,000.00	1.22	
合计	1,828,861,483.97	97.86	

10.3 基金合同生效前一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(单)	公允价值(单)	占基金资产净值比例(%)
1	000036 招商银行	3,623,079	148,225,143.99	7.93	
2	000001 中国平安	1,861,544	104,246,207.60	5.77	
3	002024 苏宁电器	1,363,154	91,444,206.70	5.00	
4	000651 格力电器	1,580,244	81,382,566.00	4.35	
5	000123 花旗银行	1,122,387	65,951,986.25	3.53	
6	000057 中联重科	80,162	162,282.00	0.33	
7	000423 柳钢股份	1,844,917	58,299,377.20	3.12	
8	000309 航天动力	1,281,150	54,128,587.50	2.90	
9	000019 宝钢股份	2,847,420	51,730,815.40	2.88	
10	000031 三一重工	930,222	52,604,054.10	2.81	

注:投资人欲了解本报告期末持有的所有股票明细,请阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(<http://www.usbc.com>)的年度报告正文。

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 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	000036 招商银行	3,623,079	148,225,143.99	7.93
2	000001 中国平安	1,861,544	104,246,207.60	5.77
3				