

(上接D154版)

9.4.8.1 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
期间认购的基金份额	-
期间申购赎回总份额	-
期间因拆分增加的份额	27,035,642.18
期间赎回转出总份额	-
期末持有的基金份额	49,710,103.18
期末持有的基金份额占基金份额总额比例	1.54%

注:基金管理人于本基金转型前持有融通基金 22,674,461.00 份,期间因拆分增加份额 27,035,642.18 份。该等投资的交易费率与交易所公告费率及本基金拆分公告一致。

9.4.8.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于 2008 年度未持有本基金。

9.4.8.5 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1月10日至2008年12月31日	当期利息收入
中国工商银行	342,818,219.52	6,822,611.01

9.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

本基金自 2008 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止会计期间,未在承销期间内参与关联方承销证券。

9.4.9 期末(2008 年 12 月 31 日)本基金持有的受限受限证券

9.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的受限受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	数量(股)	期末 成本/公允价值	期末 估值总额
002257	立立电子	2008年6月30日	17,000	370,770.00

注:本基金可以使用以基金名义开立的股票账户,比照个人投资者和一般法人,战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人,或战略投资者认购新股,根据基金与上市公司所签订的申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上网下公开发行的新股或增发新股,从新股发行后上市之日起不得进行转让。

根据宁波成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了核查,上市日期待定。

9.4.9.2 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	停牌原因	期末 估值总额
000792	盐湖钾肥	2008年6月26日资产重组	56,78

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 日证券交易所停牌时连续跌停且成交量极低,故作为受限受限证券予以披露。该股票于 2009 年 1 月 5 日行开涨停板,当日的收盘价仅为 37.99 元。

9.4.9.3 期末债券正回购交易中作为质押的债券

本基金于 2008 年 12 月 31 日无正回购融资,没有质押债券。

§ 1.0 转型后融通基金证券投资基金投资组合报告

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,828,861,483.97	97.66
	其中:股票	1,828,861,483.97	97.66
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
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	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	-	-
B	采掘业	203,409,307.24	10.87
C	制造业	903,183,917.40	48.32
D	建筑业	120,605,390.00	6.46
E	国防军工	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术	3,918,520.00	0.21
H	公用事业	199,629,108.72	10.68
I	金融业	11,785,971.18	0.63
J	房地产业	174,608,326.02	9.21
K	商业贸易	333,270,222.08	17.83
L	医药、生物制品	89,827,378.50	4.78
M	其他制造业	24,500,140.80	1.33
N	合计	1,828,861,483.97	97.66

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(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	3,632,079	148,225,143.99	7.93
2	600000	浦发银行	1,895,549	107,780,916.14	5.77
3	000204	苏宁电器	1,363,154	93,444,206.70	5.00
4	000051	格力电器	1,580,244	81,382,560.00	4.35
5	600123	兰花科创	1,122,587	65,951,986.25	3.53
6	600157	中联重科	1,073,600	62,162,282.00	3.33
7	600423	柳化股份	1,844,917	58,299,372.20	3.12
8	600039	贵州茅台	1,281,150	54,128,587.50	2.90
9	600019	宝钢股份	2,847,420	53,730,815.40	2.88
10	600031	三一重工	930,222	52,604,054.10	2.81

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubschina.com)的年度报告正文。

10.4 报告期内基金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

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无买入股票。

10.4.2 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

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无卖出股票。

10.4.3 买入股票的成本/成交金额/卖出股票的收入/卖出股票的成本/成交金额

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无买入股票。

10.4.4 卖出股票的成本/成交金额/买入股票的收入/买入股票的成本/成交金额

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无卖出股票。

10.4.5 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.6 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.7 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.8 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.9 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.10 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.11 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.12 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.13 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.14 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.15 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.16 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.17 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.18 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.19 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.20 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.21 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.22 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.23 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.24 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.25 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.26 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.27 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.28 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.29 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.30 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.31 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.32 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.33 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.34 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.35 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.36 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.37 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.38 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.39 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.40 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.41 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.42 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.43 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.44 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.45 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.46 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.47 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.2 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	占基金资产净值比例(%)
1	000793	华闻传媒	17,114,722.82	0.59
2	000983	西山煤电	13,671,298.80	0.47
3	000061	农产品	13,301,157.10	0.46
4	000088	盐田港	13,204,853.74	0.45
5	600033	福建高速	12,650,076.83	0.43
6	601318	中国平安	11,756,246.63	0.40
7	600050	中国联通	11,086,591.22	0.38
8	600157	中联重科	10,425,708.50	0.36
9	600423	柳化股份	10,385,421.45	0.36
10	000051	格力电器	10,260,530.53	0.35
11	600036	招商银行	10,100,105.00	0.35
12	600607	钢钼钼业	9,974,119.37	0.34
13	600809	山西汾酒	7,536,654.00	0.25
14	600028	新世界	7,004,680.08	0.24
15	600887	伊利股份	6,253,730.59	0.21
16	000987	广州友谊	6,194,163.04	0.21
17	000002	万科 A	5,534,161.00	0.19
18	601066	中航资源	5,370,522.23	0.18
19	002008	太钢不锈	4,960,534.14	0.17
20	600123	兰花科创	4,568,224.46	0.16

注:“卖出金额”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。

10.4.3 买入股票的成本/成交金额/卖出股票的收入/卖出股票的成本/成交金额

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无买入股票。

10.4.4 卖出股票的成本/成交金额/买入股票的收入/买入股票的成本/成交金额

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无卖出股票。

10.4.5 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.6 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.7 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.8 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.9 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.10 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.11 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.12 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.13 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.14 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.15 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.16 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.17 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.18 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可转换债券明细

基金自 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 1 月 9 日(基金合同生效前一日)止期间无处于转股期的可转换债券。

10.4.19 基金合同生效前一日持有的处于转股期的可