

富国天博创新主题股票型证券投资基金
(原汉博证券投资基金转型)
二〇〇八年半年度报告

报告期年份：二〇〇八年

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇〇八年八月二十五日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司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、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。

富国天博创新主题股票型证券投资基金由原汉博证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 2007 年 4 月 16 日证监基金字[2007]108 号文《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，汉博证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，并更名为“富国天博创新主题股票型证券投资基金”。

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

签发：富国基金管理有限公司董事长

目 录

基金简介.....	2
主要财务指标、基金净值表现.....	3
一、主要会计数据和财务指标.....	3
二、富国天博基金净值表现.....	4
管理人报告.....	5
一、基金管理人及基金经理情况.....	5
二、遵规守信说明.....	6
三、公平交易专项说明.....	6
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.....	6
五、对宏观经济、证券市场及行业走势的展望.....	7
托管人报告.....	7
富国天博基金财务会计报告（未经审计）.....	8
会计报告书.....	8
会计报表附注.....	12
富国天博基金投资组合报告（2008 年 6 月 30 日）.....	26
一、报告期末基金资产组合情况.....	26
二、报告期末按行业分类的股票投资组合.....	27
三、报告期末所有股票投资明细.....	27
四、报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
五、报告期末按券种分类的债券投资组合.....	31
六、报告期末债券投资的前五名债券明细.....	31
七、投资组合报告附注.....	31
基金份额持有人户数和持有人结构.....	32
开放式基金份额变动.....	33
重大事件揭示.....	33
备查文件目录.....	37

基金简介

一、基金名称：富国天博创新主题股票型证券投资基金

基金简称：富国天博

交易代码：519035

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007 年 4 月 27 日

截至 2008 年 6 月 30 日基金份额总额：12,871,720,628.00 份

二、基金产品说明

投资目标：本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司，在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上，力争实现资本的长期稳定增值。

投资策略：本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。

业绩比较基准：中信标普 300 指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%

风险收益特征：本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。

三、基金管理人：富国基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层

邮政编码：200120

法定代表人：陈敏

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

四、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

信息披露负责人：尹东

联系电话：(010) 67595003

传真：(010) 67595853

电子邮箱：yindong@ccb.cn

五、本基金选用的信息披露报刊：中国证券报、上海证券报、证券时报
 登载半年度报告正文的管理人互联网网址：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

中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

六、注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册登记机构办公地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

主要财务指标、基金净值表现

一、主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

财务指标	2008年上半年度
1、本期利润	-5,628,569,551.29
2、本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-396,640,692.60
3、加权平均份额本期利润	-0.4204
4、期末可供分配利润	-410,946,525.84
5、期末可供分配份额利润	-0.0319
6、期末基金资产净值	9,073,305,137.01
7、期末基金份额净值	0.7049
8、加权平均净值利润率	-44.98%
9、本月份净值增长率	-37.47%
10、份额累计净值增长率	-2.75%

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

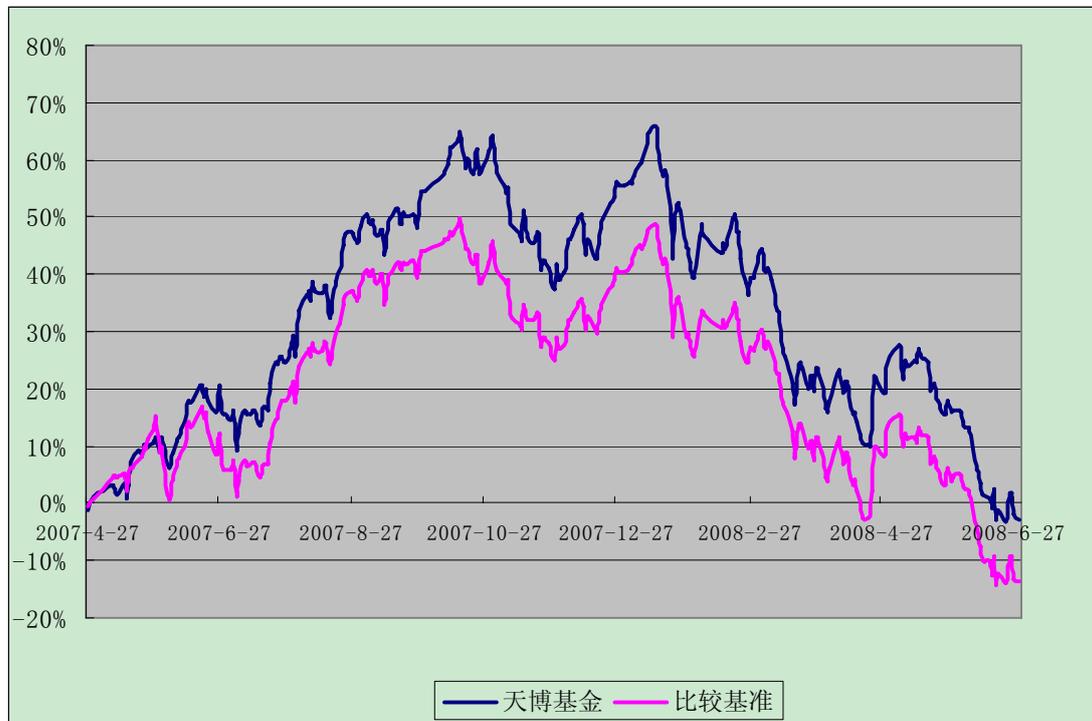
净收益”和“加权平均净值收益率”名称分别调整为“加权平均份额本期利润”和“加权平均净值利润率”，计算方法在原“加权平均基金份额本期净收益”和“加权平均净值收益率”公式的基础上将分子改为本期利润，原“期末可供分配收益”和“期末可供分配份额收益”名称分别调整为“期末可供分配利润”和“期末可供分配份额利润”。

二、富国天博基金净值表现

1、富国天博创新主题股票型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	-16.36%	2.51%	-17.53%	2.69%	1.17%	-0.18%
过去三个月	-19.70%	2.43%	-20.58%	2.62%	0.88%	-0.19%
过去六个月	-37.47%	2.37%	-38.46%	2.45%	0.99%	-0.08%
过去一年	-15.81%	2.08%	-18.47%	2.09%	2.66%	-0.01%
自基金成立起至今	-2.75%	2.04%	-13.62%	2.11%	10.87%	-0.07%

2、自基金合同生效以来富国天博创新主题股票型证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图



注：（1）截止日期为 2008 年 6 月 30 日。

（2）2007 年 4 月 5 日，汉博证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会 2007 年 4 月 16 日证监基金字[2007]108 号核准。自 2007 年 4 月 27 日起，汉博证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《汉博证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》正式生效。

（3）富国基金管理有限公司已于 2007 年 5 月 24 日对投资者持有的原汉博证券投资基金（以下简称“基金汉博”）进行了基金份额转换操作。经本基金托管人中国建设银行确认，拆分基准日（5 月 24 日）基金份额净值为 2.6761 元，精确到小数点后第 9 位为 2.676100905 元（第 9 位以后舍去），本基金管理人按照 1: 2.676100905 的转换比例将原基金汉博的基金财产进行了拆分。拆分后，基金份额净值变为 1.0000 元，相应地，原基金汉博每 1 份基金份额转换为 2.676100905 份，基金份额计算结果保留到整数位，所产生的误差归入基金财产。原基金汉博的基金总份额由 500,000,000.00 份转换为 1,338,050,452.56 份。

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：毕天宇先生，生于 1971 年，工商管理硕士，自 2000 年开始从事证券行业工作，曾任中国北方工业上海公司内贸处销售员、兴业证券股份有限公司研究发展中心研究员、富国基金管理公司研究策划部研究员。

本基金基金经理助理：李晓铭，生于 1980 年，硕士，自 2005 年开始从事证券行业工作，曾任华富基金管理有限公司研究员，现任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，兼任富国天博创新主题股票型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博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天博创新主题股票型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，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，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，严格执行交易系统中的公平交易程序，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

沪深 300 指数今年上半年跌幅达到 47.7%，跌幅创出了历史纪录。可以说，

这是对 06、07 年 355%涨幅的修正，但短时间如此大跌幅也确实超出了我们的预期。同期天博基金净值下跌了 37.47%。

导致市场如此大跌的原因在于：

- 宏观经济不确定性逐步增强，全球性通货膨胀不可避免将导致经济减速。从粮价到油价，全球大宗商品价格均出现了大幅上涨。这一方面表明全球经济经过多年快速增长，供需关系趋于紧张。另一方面，美国次贷危机导致美国经济下滑，其弱势美元政策加剧了以美元计价的大宗商品价格上涨。而全球投机资金的推动更加剧了全球性通货膨胀。这对日益融入全球经济的中国来说，面临的挑战将非常艰难。
- 经济不确定性导致市场估值中枢的下降。宏观经济将决定证券市场走向的主导因素。面对宏观经济诸多的不确定性，估值水平的下跌导致市场系统性下跌。
- 大小非解禁加大了市场资金供求矛盾，也加剧了市场下跌的走势。

回顾过去半年操作，最大的失误在于对于宏观经济过于乐观，导致牛市思维下的高仓位操作。尽管对于经济的不确定性我们在年初和二季度的策略中均有所考虑，但通过对重点持有上市公司基本面研究，我们看到大部分上市公司 08 年业绩依旧能够保持快速增长，我们希望能够通过精选个股的业绩增长来抵御市场的振荡，降低估值风险。但事实表明，高仓位操作短期难以回避市场系统风险。

五、对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望下半年，令人担忧的仍旧是全球通货膨胀何时能够得到抑制，全球经济减速的程度会有多大。从长期投资角度来看，市场在经历上半年大幅度下跌后，已经进入了相对安全的区域。我们无法预测市场的最终下跌空间，短期也难以看到市场出现趋势性上涨机会，但我们相信在目前点位时机选择难度在加大，获得超额收益的可能性正逐步减少，而不少优质个股在经历前期大幅度下跌后投资机会却非常明显。“控制仓位、精选个股、长期持有”将是我们下一步的投资选择。

托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》和《富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议》，托管富国天

博创新主题股票型证券投资基金（以下简称富国天博基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在富国天博基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人—富国基金管理有限公司在富国天博基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由富国天博基金管理人—富国基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

富国天博基金财务会计报告（未经审计）

会计报告书

一、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	171,855,940.51	965,143,578.87
结算备付金	3,450,700.07	6,441,891.52
存出保证金	1,753,360.13	3,722,233.85
交易性金融资产	8,744,196,211.12	14,935,265,086.60
其中：股票投资	7,724,993,439.02	14,270,757,401.40
债券投资	1,019,202,772.10	664,507,685.20
衍生金融资产	10,568,073.60	4,130,431.91
应收证券清算款	139,000,000.00	
应收利息	17,060,707.67	11,334,021.85
应收股利	1,826,774.96	
应收申购款	2,846,814.07	36,154,143.60
其他资产	9,356.33	
资产合计	9,092,567,938.46	15,962,191,388.20
负债	2008-06-30	2007-12-31
应付证券清算款		16,926,011.34

应付赎回款	3,470,684.90	96,155,995.42
应付管理人报酬	12,148,493.64	19,201,297.83
应付托管费	2,024,748.92	3,200,216.33
应付交易费用	769,528.26	1,367,793.61
应交税费	102,421.31	102,421.31
其他负债	746,924.42	1,010,002.73
负债合计	19,262,801.45	137,963,738.57
所有者权益		
实收基金	4,809,881,336.92	5,245,412,216.72
未分配利润	4,263,423,800.09	10,578,815,432.91
所有者权益合计	9,073,305,137.01	15,824,227,649.63
负债和所有者权益总计	9,092,567,938.46	15,962,191,388.20

所附附注为本会计报表的组成部分

二、2008 年上半年度利润表

金额单位：人民币元

项 目	自 2007 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至	
	2008 年上半年	2007 年 06 月 30 日的期间
一、收入	-5,496,526,171.06	496,262,834.19
1. 利息收入	18,251,801.23	3,119,076.59
其中：存款利息收入	4,052,730.48	2,109,254.37
债券利息收入	14,199,070.75	1,009,822.22
2. 投资收益	-286,223,838.82	32,073,188.87
其中：股票投资收益	-359,730,894.79	18,345,552.40
债券投资收益	1,055,493.00	-99,028.45
衍生工具收益	11,656,960.53	
股利收益	60,794,602.44	13,826,664.92
3. 公允价值变动收益	-5,231,928,858.69	460,450,160.29
4. 其他收入	3,374,725.22	620,408.44
二、费用	132,043,380.23	31,377,063.56
1. 管理人报酬	93,755,714.22	11,620,162.31
2. 托管费	15,625,952.37	1,936,693.70
3. 交易费用	18,949,661.32	17,438,538.55

4. 利息支出	3,451,295.05	292,568.22
其中：卖出回购金融资产支出	3,451,295.05	292,568.22
5. 其他费用	260,757.27	89,100.78
三、利润总额	-5,628,569,551.29	464,885,770.63

所附附注为本会计报表的组成部分

三、2008 年上半年度所有者权益（基金净值）变动表
金额单位：人民币元

项目	2008 年上半年度			自 2007 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2007 年 06 月 30 日的期间		
	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）	5,245,412,216.72	10,578,815,432.91	15,824,227,649.63	500,000,000.00	721,684,131.94	1,221,684,131.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）		-5,628,569,551.29	-5,628,569,551.29		464,885,770.63	464,885,770.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-435,530,879.80	-686,822,081.53	-1,122,352,961.33	2,051,105,616.10	3,462,532,429.43	5,513,638,045.53
其中：1. 基金申购款	548,519,417.42	1,003,689,495.56	1,552,208,912.98	2,220,131,780.20	3,787,714,767.43	6,007,846,547.63
2. 基金赎回款	-984,050,297.22	-1,690,511,577.09	-2,674,561,874.31	-169,026,164.10	-325,182,338.00	-494,208,502.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数						
五、期末所有者权益（基金净值）	4,809,881,336.92	4,263,423,800.09	9,073,305,137.01	2,551,105,616.10	4,649,102,332.00	7,200,207,948.10

所附附注为本会计报表的组成部分

会计报表附注

一、 基金设立说明

富国天博创新主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由汉博证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会2007年4月16日证监基金字[2007]108号文《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，汉博证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“富国天博创新主题股票型证券投资基金”。自2007年4月27日起，《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》生效，原《汉博证券投资基金基金合同》失效。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为富国基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据上述证监基金字[2007]108号文的核准，基金管理人于2007年5月9日至2007年5月18日向社会开放集中申购，集中申购期结束经安永大华会计师事务所有限责任公司验证并出具第597号验资报告。集中申购扣除申购费后的净申购金额为人民币4,754,945,538.62元，在集中申购期间产生的利息为人民币2,410,452.06元，以上实收基金合计为人民币4,757,355,990.68元，折合4,757,355,990.68份基金份额。另外，集中申购验资结束日同时为原汉博证券投资基金的拆分日。

2007年5月24日（拆分日），基金管理人对原汉博证券投资基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币2.6761元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第9位（第9位以后舍去）为2.676100905。本基金管理人于拆分日，按照1:2.676100905的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币1.0000元，基金份额面值为人民币0.3737元。通过基金份额拆分，使得验资结束当日基金份额净值为1.00元，再根据当日基金份额净值（1.00元）计算投资者集中申购应获得的基金份额，并由注册登记人根据基金管理人进行投资者集中申购份额的登记确认。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常的市场情况中，本基金投资组合的浮动范围为：股票60%-95%（投资于创新主题类上市公司股票比例不低于基金股票投资的80%），除股票以外5%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为：中信标普300指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%。

二、 财务报表的编制基础及遵循企业会计准则的声明

本财务报表系按照中国财政部2006年颁布的企业会计准则及应用指南、中国证券业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有

关事项的通知》、《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》及其他中国证监会发布的相关规定而编制。

本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于2008年06月30日的财务状况以及2008年上半年度的经营成果和所有者权益变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

三、重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。自2007年7月1日起，本基金执行新会计准则及中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、修改后的基金合同及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。本基金已按照《企业会计准则第38号-首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及其他相关规定，对2007年1月1日起至2007年6月30日止期间(以下简称“2007年上半年”)的财务报表予以追溯调整。

本财务报表除有特别说明外，均以人民币元为单位。

四、 税项

(1) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》，自2005年1月24日起，按1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券(股票)交易印花税率，由原先的1%调整为3%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税率，由3%调整为1%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金(封闭式证

券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税，该规定执行至股权分置改革结束；根据财政部、国家税务总局财税字[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

五、 财务报表主要项目

1. 银行存款

项目	2008-6-30
活期存款	171,855,940.51

本基金本报告期末投资于定期存款。

2. 交易性金融资产

明细项目	2008-6-30		
	成本	公允价值	估值增值
股票投资	10,165,287,089.12	7,724,993,439.02	-2,440,293,650.10
债券投资	1,021,281,998.16	1,019,202,772.10	-2,079,226.06
其中：交易所市场	286,377,050.51	284,277,772.10	-2,099,278.41
银行间市场	734,904,947.65	734,925,000.00	20,052.35

本基金本报告期所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

3. 衍生金融资产

明细项目	2008-6-30		
	成本	公允价值	估值增值
权证投资	13,093,179.59	10,568,073.60	-2,525,105.99

4. 应收利息

项目	2008-6-30
应收银行存款利息	70,109.17
应收结算备付金利息	1,552.80
应收债券利息	16,988,982.40
应收权证保证金利息	63.30
合计	17,060,707.67

5. 其他资产

项目	2008-6-30
应收申购款利息	9,356.33
合计	9,356.33

6. 应付交易费用

项目	2008-6-30
应付佣金	767,164.61
其中:国泰君安证券股份有限公司	136,412.80
中信证券股份有限公司	3,523.59
中国建银投资证券有限责任公司	124,283.19
中银国际证券有限责任公司	45,934.47
长江证券股份有限公司	36,232.06
北京高华证券有限责任公司	78,000.83
国信证券有限责任公司	315,525.36
安信证券股份有险公司	27,252.31
应付银行间交易费用	2,363.65
合计	769,528.26

7. 其他负债

项目	2008-6-30
应付结算保证金	500,000.00
应付后端申购费	9,742.37
预提费用	223,770.82
应付赎回费	13,411.23
合计	746,924.42

8. 实收基金（单位：份）

项目	2008年上半年	
	份额(份)	金额
期初实收基金	14,037,256,364.92	5,245,412,216.72
加: 本期申购	1,467,889,793.34	548,519,417.42
其中: 分红转份额		
减: 本期赎回	2,633,425,530.26	984,050,297.22
期末实收基金	12,871,720,628.00	4,809,881,336.92

9. 未分配利润

项目	2008年上半年
期初余额	10,578,815,432.91
本期利润	-5,628,569,551.29
其中: 已实现	-396,640,692.60
未实现	-5,231,928,858.69
损益平准金-已实现	17,494,448.38
其中: 本期申购/转入	-2,329,538.69
本期赎回/转出	19,823,987.07
损益平准金-未实现	-704,316,529.91
其中: 本期申购/转入	1,006,019,034.25
本期赎回/转出	-1,710,335,564.16
减: 已分配利润	
期末余额	4,263,423,800.09

10. 股票投资收益

项目	2008年上半年
卖出股票成交总额	3,094,437,165.29
减: 卖出股票成本总额	3,454,168,060.08
股票投资收益	-359,730,894.79

11. 债券投资收益

项目	2008年上半年
卖出及到期兑付债券成交总额	395,885,836.53

减：卖出及到期兑付债券成本总额	384,709,651.69
减：应收利息总额	10,120,691.84

债券投资收益	1,055,493.00
--------	--------------

12. 衍生工具收益

项目	2008年上半年
卖出权证成交总额	39,963,462.16
减：卖出权证成本总额	28,306,501.63
权证投资收益	11,656,960.53

13. 公允价值变动收益

项目	2008年上半年
交易性金融资产	-5,229,219,103.85
其中：股票投资	-5,227,450,938.29
债券投资	-1,768,165.56
衍生工具	-2,709,754.84
其中：权证投资	-2,709,754.84
合计	-5,231,928,858.69

14. 其他收入

项目	2008年上半年
赎回费收入	3,374,725.22
其他	
合计	3,374,725.22

15. 交易费用

项目	2008年上半年
交易所交易费用	18,948,086.32
银行间交易费用	1,575.00
合计	18,949,661.32

16. 其他费用

项目	2008年上半年
----	----------

审计费用	74,590.88
信息披露费	149,179.94
账户维护费	9,000.00
其他	27,986.45
合计	260,757.27

17. 本期已分配基金净利润

2008年上半年本基金未进行收益分配。

18. 本基金期末持有的流通受限证券

(1) 股票：

a. 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		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
			(年/月/日)	日						
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	
601899	紫金矿业	2008/4/18	2008/7/25	网下新股申购	7.13	7.80	3,527,731	25,152,722.03	27,516,301.80	
601958	金钼股份	2008/4/11	2008/7/17	网下新股申购	16.57	17.02	421,387	6,982,382.59	7,172,006.74	

合计 43,004,876.28 49,428,636.62

b. 期末持有的暂时停牌的股票

股票 代码	股票 名称	停牌日期		期末估 值单价	复牌日期 (年/月/日)	复牌 开盘单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
		(年/月/日)	停牌原因						
000792	盐湖钾肥	2008/6/26	重大事项	88.12	—	—	4,068,071	190,031,710.06	358,478,416.52

(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		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
			(年/月/日)	(年/月/日)						
126016	08 宝钢债	2008/6/20	2008/7/4		老股东优先获配可分离债	76.27	75.08	551,800	42,086,820.41	41,429,144.00

(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

代码	名称	成功认购日 (年/月/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
			(年/月/日)	(年/月/日)						
580024	宝钢 CWB1	2008/6/20	2008/7/4		老股东优先获配可分离债	1.48	1.1970	8,828,800	13,093,179.59	10,568,073.60

六、 关联方关系及其交易

1. 关联方关系

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
中国证券登记结算有限责任公司	基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	注册登记人
海通证券股份有限公司 (“海通证券”)	基金托管人、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 年上半年	2007年4月27日 (基金合同生效日) 至 2007年6月30日止期间
-------	-----------	--

股票交易	期间成交金额	占期间交易 金额的比例	期间成交金额	占期间交易 金额的比例
海通证券	9,613,039.00	0.20%	751,570,614.92	15.31%
申银万国证券	115,161,211.63	2.36%	740,873,968.87	15.10%
债券交易	期间成交金额	占期间交易 金额的比例	期间成交金额	占期间交易 金额的比例
海通证券			10,483,800.00	6.43%
申银万国证券			8,080,000.00	4.96%
权证交易	期间成交金额	占期间交易 金额的比例	期间成交金额	占期间交易 金额的比例
海通证券				
申银万国证券				
回购交易	期间成交金额	占期间交易 金额的比例	期间成交金额	占期间交易 金额的比例
海通证券				
申银万国证券				

2008 年上半年

佣金	期间佣金	占期间佣金 总量的比例	期末余额	占期末应付佣 金余额的比例
海通证券	7,810.59	0.19%		
申银万国证券	97,886.51	2.39%		

2007 年 4 月 27 日（基金合同生效日）
至 2007 年 6 月 30 日止期间

佣金	期间佣金	占期间佣金 总量的比例	期末余额	占期末应付佣 金余额的比例
海通证券	604,926.69	15.23%	604,926.69	15.23%
申银万国证券	607,433.12	15.30%	607,433.12	15.30%

注：(1) 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。

(2) 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年上半年度通过银行间同业市场与基金托管人中国建设银行股份有限公司进行如下交易：

融资回购业务交易金额为人民币374,400,000.00元，相应的利息支出为人民币330,739.72元；

本基金2007年4月27日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间未与基金托管人中国建设银行股份有限公司进行银行间同业市场债券买卖及融资回购业务。

4. 基金管理人及托管人报酬

(1) 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。

	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2008年上半年	19,201,297.83	93,755,714.22	100,808,518.41	12,148,493.64
2007年4月27日（基金合同生效日）至2007年6月30日止期间	1,298,559.37	11,620,162.31	4,509,754.73	8,408,966.95

(2) 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。

	期初余额	本期计提	本期支付	期末余额
2008年上半年	3,200,216.33	15,625,952.37	16,801,419.78	2,024,748.92
2007年4月27日（基金合同生效日）至2007	216,426.55	1,936,693.70	751,625.76	1,401,494.49

年 6 月 30 日止期间

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中国建设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	171,855,940.51	711,462,523.96

项目	2008年上半年	2007年4月27日 (基金合同生效日)至 2007年6月30日止期间
银行存款产生的利息收入	3,920,882.15	2,030,719.25

6. 关联方持有基金份额（单位：份）

(1) 基金管理人所持有的本基金份额

	2008年上半年	2007年4月27日 (基金合同生效日)至 2007年6月30日止期间
期初持有基金份额	-	21,904,143.00
加：本期申购/转入	-	-
其中：基金分红再投资	-	-
本期拆分	-	36,713,554.00
减：本期赎回/转出	-	-
期末持有实收基金	-	58,617,697.00
占期末基金总份额的比例	-	0.86%

(2) 基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构持有的本基金份额

	2008-6-30	2007-6-30
海通证券	-	3,528,104.39

七、或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

八、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

九、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，除在附注五-18 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约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投资比例范围为基金资产净值的 60%-95%；除股票以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于 5%。于 2008 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2008 年 6 月 30 日		2007 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值的比例	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	7,724,993,439.02	85.14%	14,270,757,401.40	90.18%
- 债券投资	1,019,202,772.10	11.23%	664,507,685.20	4.20%
衍生金融资产	10,568,073.60	0.12%	4,130,431.91	0.03%
合计	8,754,764,284.72	96.49%	14,939,395,518.51	94.41%

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
中信标普 300 指数×80%+中 信标普国债指数×15%+同业 存款利率×5%	+1.00	91,865.54
	-1.00	-91,865.54
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
中信标普 300 指数×80%+中 信标普国债指数×15%+同业 存款利率×5%	+0.10	142,428.47
	-0.10	-142,428.47

(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
资产					
银行存款	171,855,940.51				171,855,940.51
结算备付金	3,450,700.07				3,450,700.07

存出保证金	140,741.00			1,612,619.13	1,753,360.13
交易性金融资产	387,895,000.00	517,894,137.20	113,413,634.90	7,724,993,439.02	8,744,196,211.12
衍生金融资产				10,568,073.60	10,568,073.60
应收股利				1,826,774.96	1,826,774.96
应收利息				17,060,707.67	17,060,707.67
应收申购款				2,846,814.07	2,846,814.07
应收证券清算款				139,000,000.00	139,000,000.00
其他资产				9,356.33	9,356.33
资产总计	563,342,381.58	517,894,137.20	113,413,634.90	7,897,917,784.78	9,092,567,938.46
负债					
应付赎回款				3,470,684.90	3,470,684.90
应付管理人报酬				12,148,493.64	12,148,493.64
应付托管费				2,024,748.92	2,024,748.92
应付交易费用				769,528.26	769,528.26
应交税费				102,421.31	102,421.31
其他负债				746,924.42	746,924.42
负债总计				19,262,801.45	19,262,801.45
利率敏感度缺口	563,342,381.58	517,894,137.20	113,413,634.90	7,878,654,983.33	9,073,305,137.01

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	965,143,578.87	-	-	-	965,143,578.87
结算备付金	6,441,891.52	-	-	-	6,441,891.52
存出保证金	140,741.00	-	-	3,581,492.85	3,722,233.85
交易性金融资产	632,061,433.20	23,379,348.00	9,066,904.00	14,270,757,401.40	14,935,265,086.60
衍生金融资产	-	-	-	4,130,431.91	4,130,431.91
应收利息	-	-	-	11,334,021.85	11,334,021.85
应收申购款	-	-	-	36,154,143.60	36,154,143.60
资产总计	1,603,787,644.59	23,379,348.00	9,066,904.00	14,325,957,491.61	15,962,191,388.20
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16,926,011.34	16,926,011.34
应付赎回款	-	-	-	96,155,995.42	96,155,995.42
应付管理人报酬	-	-	-	19,201,297.83	19,201,297.83
应付托管费	-	-	-	3,200,216.33	3,200,216.33
应付交易费用	-	-	-	1,367,793.61	1,367,793.61
应交税费	-	-	-	102,421.31	102,421.31
其他负债	-	-	-	1,010,002.73	1,010,002.73
负债总计	-	-	-	137,963,738.57	137,963,738.57
利率敏感度缺口	1,603,787,644.59	23,379,348.00	9,066,904.00	14,187,993,753.04	15,824,227,649.63

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	-1,979.17
利率	-0.10	1,979.17
2007 年 12 月 31 日	%	千元
利率	+0.10	-373.32
利率	-0.10	373.32

(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。

十、 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

十一、其他重要事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

十二、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	自 2007 年 4 月 27 日（基金合同生 效日）至 2007 年 6 月 30 日的净损益 (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	-	4,435,610.34	7,200,207,948.10
金融资产公允价值变动的调整数	-	460,450,160.29	-
按新会计准则列报的金额	-	464,885,770.63	7,200,207,948.10

富国天博基金投资组合报告（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	7,724,993,439.02	84.96

2	债 券	1, 019, 202, 772. 10	11. 21
3	权 证	10, 568, 073. 60	0. 12
4	银行存款及结算备付金	175, 306, 640. 58	1. 93
5	其他资产	162, 497, 013. 16	1. 79
	合 计	9, 092, 567, 938. 46	100. 00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	证券板块名称	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	198, 468, 564. 58	2. 19
3	C 制造业	3, 856, 440, 599. 74	42. 50
	C0 食品、饮料	706, 288, 657. 10	7. 78
	C1 纺织、服装、皮毛	235, 096. 40	0. 00
	C2 木材、家具	971, 774. 61	0. 01
	C3 造纸、印刷	510, 273. 00	0. 01
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	1, 034, 347, 512. 44	11. 40
	C5 电子	1, 113, 831. 40	0. 01
	C6 金属、非金属	1, 192, 300, 886. 21	13. 14
	C7 机械、设备、仪表	476, 006, 842. 61	5. 25
	C8 医药、生物制品	416, 612, 140. 19	4. 59
	C9 其他制造业	28, 053, 585. 78	0. 31
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业		
5	E 建筑业	7, 222, 176. 00	0. 08
6	F 交通运输、仓储业	351, 308, 856. 70	3. 87
7	G 信息技术业	810, 493, 366. 20	8. 93
8	H 批发和零售贸易	911, 023, 216. 44	10. 04
9	I 金融、保险业	1, 400, 293, 068. 02	15. 43
10	J 房地产业	162, 790, 829. 58	1. 79
11	K 社会服务业	169, 267. 32	0. 00
12	L 传播与文化产业	26, 456, 679. 16	0. 29
13	M 综合类		
	合计:	7, 724, 993, 439. 02	85. 14

三、报告期末所有股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量(股)	市值 (元)	市值占基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	32, 502, 364	761, 205, 364. 88	8. 39

2	002024	苏宁电器	14,658,291	605,387,418.30	6.67
3	600519	贵州茅台	3,970,000	550,162,600.00	6.06
4	600596	新安股份	7,520,676	454,549,657.44	5.01
5	600271	航天信息	16,003,442	427,291,901.40	4.71
6	000792	盐湖钾肥	4,068,071	358,478,416.52	3.95
7	000063	中兴通讯	5,011,291	313,706,816.60	3.46
8	600019	宝钢股份	31,000,000	270,010,000.00	2.98
9	601398	工商银行	50,042,160	248,209,113.60	2.74
10	600585	海螺水泥	5,951,622	238,005,363.78	2.62
11	600000	浦发银行	9,103,371	200,274,162.00	2.21
12	601166	兴业银行	7,000,732	178,308,644.04	1.97
13	600196	复星医药	12,787,908	154,605,807.72	1.70
14	600309	烟台万华	8,001,879	149,875,193.67	1.65
15	000898	鞍钢股份	10,003,570	130,346,517.10	1.44
16	000061	农产品	6,250,155	126,628,140.30	1.40
17	601006	大秦铁路	9,085,316	123,651,150.76	1.36
18	000895	双汇发展	3,312,935	123,572,475.50	1.36
19	600009	上海机场	7,045,367	111,457,705.94	1.23
20	000338	潍柴动力	2,707,859	109,126,717.70	1.20
21	600005	武钢股份	10,040,765	97,997,866.40	1.08
22	600583	海油工程	4,465,830	97,310,435.70	1.07
23	600276	恒瑞医药	2,626,307	91,658,114.30	1.01
24	600383	金地集团	10,001,194	90,710,829.58	1.00
25	600320	振华港机	8,708,563	90,307,798.31	1.00
26	000825	太钢不锈	8,000,000	86,640,000.00	0.95
27	000157	中联重科	6,093,082	84,389,185.70	0.93
28	600428	中远航运	3,000,000	77,040,000.00	0.85
29	600456	宝钛股份	3,092,832	75,650,670.72	0.83
30	600219	南山铝业	7,000,000	73,850,000.00	0.81
31	002028	思源电气	3,259,018	73,327,905.00	0.81
32	000002	万科A	8,000,000	72,080,000.00	0.79
33	000538	云南白药	2,654,566	71,912,192.94	0.79
34	002153	石基信息	1,000,481	68,232,804.20	0.75
35	000012	南玻A	4,571,474	67,703,529.94	0.75
36	600660	福耀玻璃	10,030,054	63,490,241.82	0.70
37	600694	大商股份	1,805,961	61,944,462.30	0.68
38	600066	宇通客车	4,332,517	57,492,500.59	0.63
39	601088	中国神华	1,343,040	50,458,012.80	0.56
40	600282	南钢股份	9,620,105	47,427,117.65	0.52
41	600327	大厦股份	4,577,452	46,918,883.00	0.52
42	002022	科华生物	1,775,443	39,414,834.60	0.43
43	002088	鲁阳股份	3,001,085	39,194,170.10	0.43
44	600269	赣粤高速	4,000,000	39,160,000.00	0.43

45	600557	康缘药业	1,914,776	37,453,018.56	0.41
46	600693	东百集团	2,666,866	36,642,738.84	0.40
47	600315	上海家化	1,245,954	35,571,986.70	0.39
48	600352	浙江龙盛	2,186,386	32,970,700.88	0.36
49	000987	广州友谊	1,209,947	32,426,579.60	0.36
50	000869	张裕A	489,751	32,323,566.00	0.36
51	600166	福田汽车	5,000,000	32,200,000.00	0.35
52	002003	伟星股份	1,956,317	28,053,585.78	0.31
53	601899	紫金矿业	3,527,731	27,516,301.80	0.30
54	600761	安徽合力	2,036,763	26,131,669.29	0.29
55	600880	博瑞传播	2,188,143	25,973,257.41	0.29
56	000423	东阿阿胶	809,813	20,893,175.40	0.23
57	601601	中国太保	638,742	12,295,783.50	0.14
58	601808	中海油服	377,600	8,839,616.00	0.10
59	601186	中国铁建	771,600	7,222,176.00	0.08
60	601898	中煤能源	448,823	7,172,191.54	0.08
61	601958	金铂股份	421,387	7,172,006.74	0.08
62	002242	九阳股份	47,488	1,920,414.72	0.02
63	002251	步步高	22,142	1,074,994.10	0.01
64	002254	烟台氨纶	36,308	995,202.28	0.01
65	002240	威华股份	79,719	971,774.61	0.01
66	002237	恒邦股份	21,890	896,833.30	0.01
67	002233	塔牌集团	81,297	788,580.90	0.01
68	002252	上海莱士	27,141	674,996.67	0.01
69	002241	歌尔声学	24,635	661,203.40	0.01
70	002230	科大讯飞	17,585	529,132.65	0.01
71	002238	天威视讯	39,463	483,421.75	0.01
72	002256	彩虹精化	36,032	480,306.56	0.01
73	002236	大华股份	12,573	452,628.00	0.00
74	002255	海陆重工	19,865	390,148.60	0.00
75	002223	鱼跃医疗	19,071	381,420.00	0.00
76	002227	奥特迅	24,134	339,082.70	0.00
77	002250	联化科技	26,001	332,812.80	0.00
78	002234	民和股份	16,147	326,815.28	0.00
79	002243	通产丽星	39,414	316,100.28	0.00
80	002246	北化股份	37,754	310,337.88	0.00
81	002225	濮耐股份	46,153	299,994.50	0.00
82	002232	启明信息	23,382	295,782.30	0.00
83	002229	鸿博股份	19,853	269,603.74	0.00
84	002224	三力士	18,444	253,973.88	0.00
85	002253	川大智胜	11,905	251,314.55	0.00
86	002235	安妮股份	22,243	240,669.26	0.00
87	002239	金飞达	26,180	235,096.40	0.00

88	002220	天宝股份	9,245	230,015.60	0.00
89	002226	江南化工	14,727	212,805.15	0.00
90	002231	奥维通信	21,837	185,614.50	0.00
91	002245	澳洋顺昌	10,566	169,267.32	0.00
92	002217	联合化工	1	18.40	0.00

四、报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值前 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	002024	苏宁电器	221,081,783.01	1.40
2	600456	宝钛股份	197,390,140.97	1.25
3	600585	海螺水泥	176,987,691.52	1.12
4	600519	贵州茅台	160,495,683.00	1.01
5	601006	大秦铁路	134,891,391.28	0.85
6	600196	复星医药	117,242,012.94	0.74
7	000898	鞍钢股份	101,597,482.60	0.64
8	600596	新安股份	91,612,447.81	0.58
9	600036	招商银行	84,913,551.56	0.54
10	601166	兴业银行	78,565,767.45	0.50
11	600271	航天信息	58,666,310.57	0.37
12	002028	思源电气	58,433,867.80	0.37
13	002088	鲁阳股份	51,343,931.33	0.32
14	600327	大厦股份	48,233,564.70	0.30
15	600315	上海家化	45,627,015.26	0.29
16	002003	伟星股份	44,565,071.17	0.28
17	600880	博瑞传播	43,563,944.88	0.28
18	600557	康缘药业	38,625,360.68	0.24
19	600005	武钢股份	36,637,413.25	0.23
20	600660	福耀玻璃	35,127,491.10	0.22

2、报告期内累计卖出价值前 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	493,164,259.66	3.12
2	601318	中国平安	296,319,864.32	1.87
3	000983	西山煤电	228,634,646.82	1.44
4	600028	中国石化	227,084,906.93	1.44
5	000024	招商地产	225,328,170.52	1.42
6	601919	中国远洋	208,270,313.56	1.32
7	601628	中国人寿	167,109,707.79	1.06
8	600900	长江电力	150,166,064.91	0.95

9	600348	国阳新能	127,793,874.98	0.81
10	000002	万科A	125,351,507.36	0.79
11	000402	金融街	83,454,348.31	0.53
12	600123	兰花科创	75,545,506.58	0.48
13	600016	民生银行	71,864,926.09	0.45
14	000001	深发展A	66,322,347.25	0.42
15	000069	华侨城A	52,817,854.10	0.33
16	002018	华星化工	42,403,206.43	0.27
17	601857	中国石油	38,312,845.26	0.24
18	600026	中海发展	34,643,321.58	0.22
19	601390	中国中铁	34,194,620.25	0.22
20	600019	宝钢股份	32,818,277.00	0.21

3. 整个报告期内买入股票的成本总额为 2,135,855,035.99 元；卖出股票的收入总额为 3,094,437,165.29 元。

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	170,864,137.20	1.88
2	央行票据	637,645,000.00	7.03
3	企业债券	113,413,634.90	1.25
4	国家政策金融债券	97,280,000.00	1.07
	合计	1,019,202,772.10	11.23

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	3.30
2	07 央行票据 91	145,260,000.00	1.60
3	99 国债(8)	107,520,102.00	1.19
4	08 央行票据 34	96,080,000.00	1.06
5	08 石化债	56,059,047.80	0.62

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备选股票库之外的股票。

(3) 报告期末本基金的其他资产项目构成如下：

序号	其他资产项目	金额（元）
1	存出保证金	1,753,360.13
2	应收利息	17,060,707.67
3	应收股利	1,826,774.96
4	应收证券交易清算款	139,000,000.00
5	其他应收款	9,356.33
6	应收申购款	2,846,814.07
	其他资产项目合计	162,497,013.16

(4) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转债。

(5) 本基金本报告期内及本报告期末均不持有资产支持证券。

(6) 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）
上海汽车	580016	上汽 CWB1	买入可分离可转债	454,608	3,945,783.06	0
赣粤高速	580017	赣粤 CWB1	买入可分离可转债	180,480	940,318.80	0
中远航运	580018	中远 CWB1	买入可分离可转债	181,986	1,268,780.61	0
中国石化	580019	石化 CWB1	买入可分离可转债	6,639,033	15,376,469.20	0
中兴通讯	031006	中兴 ZXC1	买入可分离可转债	302,231	3,036,526.06	0
青岛啤酒	580021	青啤 CWB1	买入可分离可转债	158,130	586,188.42	0
国电电力	580022	国电 CWB1	买入可分离可转债	998,203	2,338,601.72	0
康美药业	580023	康美 CWB1	买入可分离可转债	489,140	813,833.76	0
宝钢股份	580024	宝钢 CWB1	买入可分离可转债	8,828,800	13,093,179.59	8,828,800

(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。

基金份额持有人户数和持有人结构

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
590,853 户	21,784.98 份	379,959,385.00 份	2.95%	12,491,761,243.00 份	97.05%

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	1,357,884.37	0.0105

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	500,000,000.00
本报告期初基金份额总额	14,037,256,364.92
本报告期间基金总申购份额	1,467,889,793.34
本报告期间基金总赎回份额	2,633,425,530.26
本报告期末基金份额总额	12,871,720,628.00

重大事件揭示

- 1、本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。
- 2、本报告期本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期有关托管人重大事项:

2008年5月6日,因工作变动,赵林先生辞去本行董事、副行长的职务;

2008年5月19日,本行第二届董事会第十次会议决议聘任朱小黄先生为本行副行长;

2008年5月27日,本行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告,美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权;

2008年6月12日,本行股东大会选举辛树森女士为本行执行董事并经中国银行业监督管理委员会核准同意任职资格,于2008年7月21日起任职;

2008年6月13日,中国证券监督管理委员会核准本行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

- 3、本报告期无涉及基金管理人、基金资产、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、富国天博基金本报告期未进行收益分配。
- 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、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

8、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。2008年上半年度富国天博基金各券商股票、债券、权证、回购交易量及佣金明细如下:

券商名称	席位数量	成交量(元)				佣金(元)
		回购	股票	债券	权证	

海通证券	2		9,613,039.00			7,810.59
申银万国	1		115,161,211.63			97,886.51
国泰君安	2		750,648,342.06	60,947,422.60		634,525.55
湘财证券	1	49,900,000.00	511,008,398.82			434,355.75
中信建投	1		110,806,227.22			94,184.62
中银国际	1		981,936,308.38	14,516,466.81	5,372,396.49	797,833.74
上海证券	1	159,500,000.00	515,980,777.81	8,915,368.00	5,783,633.26	438,581.34
高华证券	1	79,900,000.00	370,441,594.57			314,874.32
国信证券	1		449,899,809.55			365,546.45
安信证券	1	244,800,000.00	414,661,529.19	62,182,526.03	20,281,390.17	352,468.01
长城证券	1					
中信证券	1	219,900,000.00	416,755,840.23		2,059,597.93	354,234.13
中投证券	1	164,500,000.00	146,212,374.25		714,854.36	124,283.19
长江证券	1	328,500,000.00	91,060,905.95	116,366,953.91	5,751,589.95	77,402.46
兴业证券	1					
合计	17	1,247,000,000.00	4,884,186,358.66	262,928,737.35	39,963,462.16	4,093,986.66

席位	成交量占比				佣金占总佣金比例
	回购交易量占回购总交易量比例	股票交易量占股票总交易量比例	债券交易量占债券总交易量比例	权证交易量占权证总交易量比例	
海通证券		0.20%			0.19%
申银万国		2.36%			2.39%
国泰君安		15.37%	23.18%		15.50%
湘财证券	4.00%	10.46%			10.61%
中信建投		2.27%			2.30%
中银国际		20.10%	5.52%	13.44%	19.49%
上海证券	12.79%	10.56%	3.39%	14.47%	10.71%
高华证券	6.41%	7.58%			7.69%
国信证券		9.21%			8.93%
安信证券	19.63%	8.49%	23.65%	50.75%	8.61%
中信证券	17.63%	8.53%		5.15%	8.65%
中投证券	13.19%	2.99%		1.79%	3.04%
长江证券	26.34%	1.86%	44.26%	14.39%	1.89%
合计	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

本基金本期新增席位:

中投证券	22347 席位
兴业证券	24031 席位

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 4 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《关于修改富国天惠基金和富国天博基金在销售机构(网点)最低保留基金份额和赎回申请最低份额的公告》。

12、 本基金管理人于 2008 年 2 月 19 日在中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站上刊登《富国基金公司关于增加中国民生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 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》。

14、 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》。

15、 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》。

16、 本基金管理人于 2008 年 3 月 20 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工商银行开通定期定额业务及定期定额投资优惠活动的公告》。

17、 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》。

18、 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》。

19、 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》。

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 4 月 28 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》。

22、 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《关于富国基金管理公司在招商银行开立的直销资金专户帐号变更公告》。

23、 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》。

24、 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》。

25、 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》。

26、 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》。

27、 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》。

28、 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》。

备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立汉博证券投资基金的文件
- 2、汉博证券投资基金基金合同
- 3、汉博证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
- 6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同
- 7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议
- 8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注
- 9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

查阅地点：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司

二〇〇八年八月二十五日