

兴业社会责任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：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期： 2009 年 3 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、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的法律责任。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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 3 月 26 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。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2008 年 4 月 30 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.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告.....	15
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16

7.2	利润表.....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注.....	19
§8	投资组合报告.....	40
8.1	期末基金资产组合情况.....	40
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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....	42
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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	45
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明 细.....	45
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	46
8.9	投资组合报告附注.....	46
§9	基金份额持有人信息.....	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
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.....	47
§10	开放式基金份额变动.....	47
§11	重大事件揭示.....	48
11.1	基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4	基金投资策略的改变.....	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8	其他重大事件.....	49
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§13	备查文件目录.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业社会责任股票型证券投资基金
基金简称	兴业社会责任基金
交易代码	340007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 30 日
报告期末基金份额总额	1,137,731,245.85 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值，同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
投资策略	本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略，将定性研究与定量研究相结合，在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业的基础上，采用“兴业双层行业筛选法”进行优化调整。采用“兴业社会责任四维选股模型”精选股票。
业绩比较基准	80%×中信标普 300 指数 + 20%×中信标普国债指数
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		兴业全球基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜建新	尹东
	联系电话	021-58368998	010- 67595003
	电子邮箱	dujx@xyfunds.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099，021-38824536	010 -67595096
传真		021-58368858	010-66275853
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市张杨路 500 号时代广场	北京市西城区闹市口大街 1 号

	20 楼	院 1 号楼
邮政编码	200122	100140
法定代表人	郑苏芬	郭树清

注：2009 年 3 月 12 日起，基金管理人法定代表人变更为兰荣。

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	www.xyfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	安永华明会计师事务所	兴业全球基金管理有限公司
办公地址	上海市静安区南京西路 1601 号越洋广场 29 楼	上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼

§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 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-215,816,919.20
本期利润	-311,106,325.85
加权平均基金份额本期利润	-0.2537
本期加权平均净值利润率	-29.38%
本期基金份额净值增长率	-22.20%

3.1.2 期末数据和指标	2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	-252,774,263.51
期末可供分配基金份额利润	-0.2222
期末基金资产净值	884,956,982.34
期末基金份额净值	0.778
3.1.3 累计期末指标	2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-22.20%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号<主要财务指标的计算及披露>》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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、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、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金成立于 2008 年 4 月 30 日，截止 2008 年 12 月 31 日，本基金成立不满一年。

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-7.16%	2.06%	-13.49%	2.40%	6.33%	-0.34%
过去六个月	-13.07%	1.72%	-26.81%	2.34%	13.74%	-0.62%
自基金合同成立起至今	-22.20%	1.55%	-42.12%	2.34%	19.92%	-0.79%

注：本基金业绩比较基准为 80% × 中信标普 300 指数 + 20% × 中信标普国债指数，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中信标普 300 指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。中信标普 300 指数选择中国 A 股市场中市值规模最大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股，充分反映了 A 股市场的行业代表性，描述了沪深 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

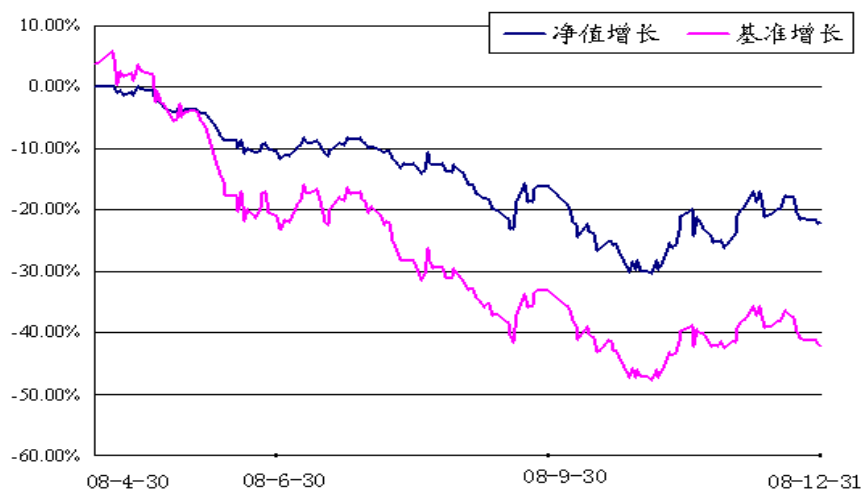
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中信标普 300 指数}_t / \text{中信标普 300 指数}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中信国债指数}_t / \text{中信国债指数}_{t-1} - 1)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times \text{Benchmark}_{t-1}$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

(2008 年 4 月 30 日—2008 年 12 月 31 日)

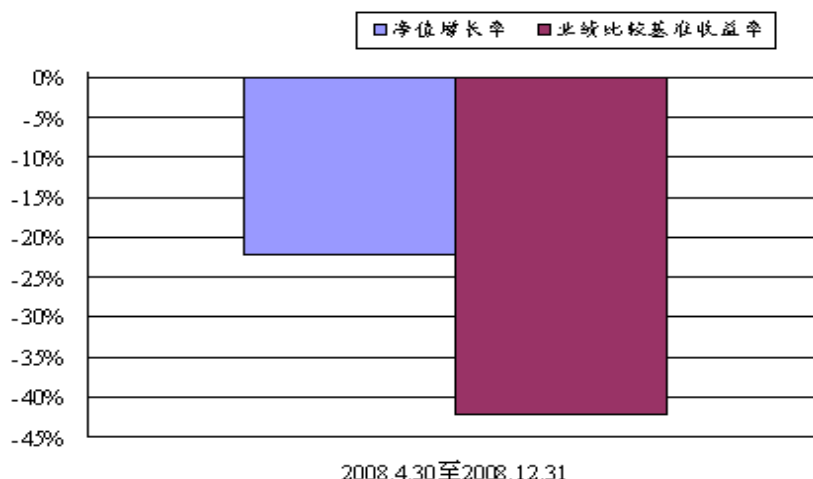


注：1、净值表现所取数据截至到 2008 年 12 月 31 日。

2、按照《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 10 月 29 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2008 年 4 月 30 日，截止 2008 年 12 月 31 日，本基金成立不满一年。

3.2.3 基金合同生效以来各年度净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立于 2008 年 4 月 30 日，截止 2008 年 12 月 31 日，本基金成立不满一年。2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日期间的数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

§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

兴业全球基金管理有限公司是经中国证监会（证监基字[2003]100 号文）批准，于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月 2 日，中国证监会批准（证监许可[2008]6 号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International N.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”。2008 年

7 月 7 日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币 1.2 亿元变更为人民币 1.5 亿元。

截止 2008 年 12 月 31 日，公司旗下管理着五只基金，分别为兴业可转债混合型证券投资基金、兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金和兴业社会责任股票型证券投资基金。

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		
刘兆洋	本基金基金经理	2008-4-30	—	9 年	刘兆洋先生，1972 年生，经济学博士。历任光大证券有限责任公司投资银行部经理、资产经营部高级经理、银华基金管理有限公司基金经理部基金经理助理，兴业全球基金管理有限公司兴业可转债混合型基金基金经理助理、研究策划部总监助理、兴业货币市场基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、“证券从业年限”按照中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定计算。

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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金发生过投资托管人股票的情况，及时发现，予以调整，并已向监管部门报告。该投资行为未对基金资产造成损失。除此之外，本报告期内，本基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。

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

本报告期内，兴业社会责任和兴业全球视野基金净值增长率差异超过 5%，业绩比较情况如下：

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表

项目	本基金指标值（%）	公平指标值（%）
兴业社会责任	-22.20	-42.12
兴业全球视野	-44.16	-55.10

注：1、表中“本基金指标值”为“基金净值增长率”，“公平指标值”为“业绩比较基准增长率”。兴业社会责任的数据计算期间为 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日期间，兴业全球视野的数据计算期间为 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日期间。

2、兴业社会责任和兴业全球视野风格并非完全一致，兴业社会责任基金选股时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。兴业全球视野基金以全球视野的角度，主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司，追求当期收益实现与长期资本增值。

3、2008 年 4 月 30 日至 2008 年 10 月 29 日为兴业社会责任的建仓期，股票投资比例相对比较低，在市场风险较大的时期承担了相对较低的系统性风险。为了排除建仓期的影响，我们比较了上述两只基金 11 月、12 月的业绩，净值增长率的差距为 1.15%。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

多重因素的共同作用使得 2008 年的 A 股市场大幅下跌，首先是 2006 年、2007 年国内股市暴涨后，资产泡沫严重，业绩无法支撑高高的股价，2007 年 10 月上证指数冲高 6000 点后股市泡沫开始破灭，高估值的系统性风险随即释放；其次，次贷

危机在 2008 年愈演愈烈，欧美金融危机爆发，经济全面衰退，股市大幅下挫，估值重心下移，A 股也受到冲击；最后是次贷危机对我国经济的影响愈加明显，我国的出口下降，国内经济减增，企业和投资者对国内经济和上市公司的盈利增长信心不足。2008 年底上证指数报收 1820.81 点，下跌了 65.39%。

本基金于 2008 年 4 月 30 日成立于阶段性的反弹高点，在 6 个月的建仓期内基金保持较低的股票仓位水平，但持续的下跌依然给基金净值造成一定损失。在基金建仓期完成后，我们根据市场新的运行特点，在投资风格类型上进行了灵活的调整，增强了基金持仓的进攻性，四季度，基金的净值稳步回升。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对 2009 年证券市场的走势整体上我们还是持谨慎乐观的态度。我们相对乐观的原因在于：(1) 中国股市经过 2008 年的大跌后，市场的系统性风险快速释放，相当多的股票具备了长期的参与价值；(2) 中国经济最困难的时候可能已经过去或将要过去，股市一般提前经济见底；(3) 流动性比较充裕，2009 年的信贷新增规模比 2008 年有大幅度的增加，同时利率将保持在较低的位置，股市在大类资产配置上有一定的吸引力。尽管相对乐观，我们在整体仓位和投资策略上仍将保持谨慎：(1) 估值上看，A 股市场在 2008 年四季度后相对抗跌，和其他国际股市的估值相比不占优势；(2) 次贷危机引发的金融风暴对全球经济危机的冲击还将持续，我国经济的增速和上市公司的盈利能力在 2009 年将明显下降；(3) 2009 年大小非解禁的规模将非常巨大，供给量的增大对市场将构成心理压力。因此在 2009 年我们仍将非常重视基金资产的仓位管理，精选个股，重点投资有核心竞争力、成长性好、符合社会发展方向、符合社会责任投资原则的上市公司。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总和分析。

2、定期撰写风险管理报告：每个季度结束之后，由公司监察稽核部对本基金的流动性进行压力测试，同时对本基金进行全面的风险评价，并形成书面报告。此外，在对本基金异常交易进行实时监测的基础上，每个季度出具一份异常交易报告。

3、加强对公平交易的监督：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，公司在 2008 年进一步加强了对公平交易的监督。对本基金所有投资品种以及本基金投资管理活动的各个环节进行了全面监控和评估，坚决杜绝利益输送等损害基金持有人利益的行为发生。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引(试行)》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经验，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期末，本基金可供分配利润为负，故本报告期内本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

§ 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,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。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,曾发现买入本托管人股票的行为并及时通知了基金管理人。基金管理人于次日进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

安永华明(2009)审字第60467611_B05号

兴业社会责任股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的兴业社会责任股票型证券投资基金（以下简称“贵基金”）财务报表，包括 2008 年 12 月 31 日的资产负债表和自 2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

一、基金管理人 对财务报表的责任

按照企业会计准则的规定编制财务报表是贵基金的基金管理人兴业全球基金管理有限公司的责任。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，贵基金财务报表已经按照企业会计准则的规定编制，在所有重大方面公允反映了贵基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2008 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所

中国注册会计师 徐 艳

中国 北京

中国注册会计师 蒋燕华

2009 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴业社会责任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
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	154,049,529.25
结算备付金		1,132,744.62
存出保证金		398,503.54
交易性金融资产	7.4.7.2	732,696,872.96
其中：股票投资		580,476,341.96
基金投资		-
债券投资		152,220,531.00
资产支持证券投资		-

衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		2,878,351.84
应收利息	7.4.7.5	1,800,412.28
应收股利		-
应收申购款		104,776.92
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		893,061,191.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008 年 12 月 31 日
负 债：		
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		4,606,472.77
应付赎回款		1,109,891.68
应付管理人报酬		940,006.75
应付托管费		156,667.80
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	946,987.08
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
其他负债	7.4.7.8	344,182.99
负债合计		8,104,209.07
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	1,137,731,245.85
未分配利润	7.4.7.10	-252,774,263.51
所有者权益合计		884,956,982.34
负债和所有者权益总计		893,061,191.41

注：本基金合同于 2008 年 4 月 30 日生效，上表中“本期”指 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日期间，不满一年。报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.778 元，基金份额总额 1,137,731,245.85 份。

7.2 利润表

会计主体：兴业社会责任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

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
一、收入		-293,367,714.96
1.利息收入		8,992,560.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,794,512.28
债券利息收入		6,891,449.75
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		306,598.85
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-207,678,477.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-212,406,803.73
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	1,510,467.87
资产支持证券投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	269,311.02
股利收益	7.4.7.15	2,948,547.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-95,289,406.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.17	607,608.11
二、费用（以“-”号填列）		-17,738,610.89
1、管理人报酬	7.4.10.2.1	-10,634,566.61
2、托管费	7.4.10.2.2	-1,772,427.72
3、销售服务费		—
4、交易费用	7.4.7.18	-4,905,179.37
5、利息支出		-42,687.16
其中：卖出回购金融资产支出		-42,687.16
6、其他费用	7.4.7.19	-383,750.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-311,106,325.85
所得税费用（以“-”号填列）		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-311,106,325.85

注：本基金合同于 2008 年 4 月 30 日生效，上表中“本期”指 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日期间，不满一年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业社会责任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

项目	本 期 2008 年 4 月 30 日至 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(基金净值)	1,388,696,479.84	-	1,388,696,479.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-311,106,325.85	-311,106,325.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-250,965,233.99	58,332,062.34	-192,633,171.65
其中：1. 基金申购款	359,033,219.85	-65,582,929.91	293,450,289.94
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-609,998,453.84	123,914,992.25	-486,083,461.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,137,731,245.85	-252,774,263.51	884,956,982.34

注：本基金合同于2008年4月30日生效，上表中“本期”指2008年4月30日至2008年12月31日期间，不满一年。

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴业社会责任股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]356号文《关于核准兴业社会责任股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由兴业全球基金管理有限公司（原名“兴业基金管理有限公司”）作为发起人于2008年3月28日至2008年4月25日向社会公开募集，募集期结束经安永大华会计师事务所验证并出具安永大华业字（2008）第588号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2008年4月30日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,388,444,274.71元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币252,205.13元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,388,696,479.84元，折合1,388,696,479.84份基金份额。本基金的基金管理人为兴业全球基金管理有限公司，注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

业绩比较基准为: $80\% \times \text{中信标普300指数} + 20\% \times \text{中信标普国债指数}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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2号《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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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12月31日的财务状况以及自2008年4月30日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.4 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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2008年4月30日(基金合同生效日)起至2008年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，起按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实

施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。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。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 未上市股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确

定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实

际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人选择不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7) 基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

根据中国证券监督管理委员会证监会公告[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”）的要求，本基金自 2008 年 9 月 16 日起，对特定投资品种变更了估值方法，具体如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，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，确定公允价值进行估值；

(2) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，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，确定投资品种的公允价值进行估值；

另外，根据《指导意见》的要求，本基金的管理人对管理的不同基金持有的同一投资品种采用一致的估值政策、程序及相关的方法。对于该会计估计变更，本基

金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更于 2008 年度均系因股票长期停牌而引起，未对本基金 2008 年 9 月 16 日的净利润和资产净值产生影响，未对本基金 2008 年度净利润及 2008 年末资产净值产生影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 主要税项

A. 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、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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。

B. 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》的规定，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、债券的差价收入，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个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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。

C. 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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收

入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴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。

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 2008-12-31
活期存款	154,049,529.25
定期存款	-
合 计	154,049,529.25

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		677,175,724.95	580,476,341.96	-96,699,382.99
债券	交易所市场	102,762,704.66	103,675,531.00	912,826.34
	银行间市场	48,047,850.00	48,545,000.00	497,150.00
	合计	150,810,554.66	152,220,531.00	1,409,976.34
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合 计		827,986,279.61	732,696,872.96	-95,289,406.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

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
应收活期存款利息	19,923.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	549.35
应收债券利息	1,779,939.57
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合 计	1,800,412.28

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项 目	本期末 2008年12月31日
其他应收款	—
待摊费用	—
合 计	—

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	945,462.08
银行间市场应付交易费用	1,525.00
合 计	946,987.08

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
应付券商交易单元保证金	250,000.00
预提审计费	90,000.00
应付赎回费	4,182.99
合 计	344,182.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项 目	本期 2008年4月30日至2008年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,388,696,479.84	1,388,696,479.84
本期申购	359,033,219.85	359,033,219.85
本期赎回	-609,998,453.84	-609,998,453.84
本期末	1,137,731,245.85	1,137,731,245.85

注：1、申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

2、本基金自2008年3月28日至2008年4月25日止期间公开发售，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,388,444,274.71元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币252,205.13元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,388,696,479.84元，折合1,388,696,479.84份基金份额。

3、“本期”指2008年4月30日至2008年12月31日期间，未满一年。

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	—	—	—
本期利润	-215,816,919.20	-95,289,406.65	-311,106,325.85
本期基金份额交易产生的变动数	-33,571,482.67	91,903,545.01	58,332,062.34
其中：基金申购款	-56,451,901.78	-9,131,028.13	-65,582,929.91
基金赎回款	22,880,419.11	101,034,573.14	123,914,992.25
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-249,388,401.87	-3,385,861.64	-252,774,263.51

注：“本期”指2008年4月30日至2008年12月31日期间，未满一年。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2008年4月30日至2008年12月31日
活期存款利息收入	1,764,332.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,210.81
其他	1,969.04
合计	1,794,512.28

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008年4月30日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	929,351,643.55

卖出股票成本总额	-1,141,758,447.28
买卖股票差价收入	-212,406,803.73

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	334,948,470.99
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-327,103,789.51
应收利息总额	-6,334,213.61
债券投资收益	1,510,467.87

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 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出权证成交金额	1,004,896.00
卖出权证成本总额	-735,584.98
买卖权证差价收入	269,311.02

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,948,547.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,948,547.54

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-95,289,406.65
——股票投资	-96,699,382.99
——债券投资	1,409,976.34
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-95,289,406.65

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	545,011.89
转换费收入	62,596.22
合计	607,608.11

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,901,904.37
银行间市场交易费用	3,275.00
合计	4,905,179.37

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00
信息披露费	270,000.00
银行汇划费	16,850.03
账户维护费	6,000.00
账户开户费	900.00
合计	383,750.03

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

本报告期基金各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International N.V.）	基金管理人的股东

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
兴业全球基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	1,873,065,194.01	68.51%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
兴业证券	86,807,922.87	74.84%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	100,000,000.00	17.07%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

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4月30日至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	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	1,564,808.33	68.14%	569,772.67	60.26%

注：上述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）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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

项目	本期 2008年4月30日至2008年12月31日
当期应支付的管理费	10,634,566.61
其中：当期已支付	9,694,559.86
期末未支付	940,006.75

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：
每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

2、上述表格中“当年已支付”不包含当期已支付的上期应付管理费。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年4月30日至2008年12月31日
当期应支付的托管费	1,772,427.72
其中：当期已支付	1,615,759.92
期末未支付	156,667.80

注：1、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：
每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

2、上述表格中“当年已支付”不包含当期已支付的上期应付托管费。

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4月30日至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

-	-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---

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

份额单位：份

项目	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-
期间认购总份额	37,304,664.21
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	37,304,664.21
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.28%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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

份额单位：份

关联方名称	本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	30,051,250.00	2.64%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	154,049,529.25	1,764,332.43

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.11 利润分配情况

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	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
002257	立立电子	2008-6-30	未知	认购新发证券	21.81	21.81	43,974	959,072.94	959,072.94

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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、风险管理委员会、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。

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，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发行的证券,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。

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。

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 7.4.12 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。

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,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。

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 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	154,049,529.25	-	-	-	-	-	154,049,529.25
结算备付金	1,132,744.62	-	-	-	-	-	1,132,744.62
存出保证金	-	-	-	-	-	398,503.54	398,503.54
交易性金融资产	-	-	48,545,000.00	92,363,121.22	11,312,409.78	580,476,341.96	732,696,872.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,878,351.84	2,878,351.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,800,412.28	1,800,412.28
应收申购款	104,776.92	-	-	-	-	-	104,776.92
资产总计	155,287,050.79	-	48,545,000.00	92,363,121.22	11,312,409.78	585,553,609.62	893,061,191.41
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,606,472.77	4,606,472.77
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,109,891.68	1,109,891.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	940,006.75	940,006.75
应付托管费	-	-	-	-	-	156,667.80	156,667.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	946,987.08	946,987.08
其他负债	-	-	-	-	-	344,182.99	344,182.99
负债总计	-	-	-	-	-	8,104,209.07	8,104,209.07
利率敏感度缺口	155,287,050.79	-	48,545,000.00	92,363,121.22	11,312,409.78	577,449,400.55	884,956,982.34

注：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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；	
	2. 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）。	
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：千元）
		本期末 （2008 年 12 月 31 日）
	+1%	-169.87
	-1%	172.13

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，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 65%-95%；债券为 0%-30%；权证比例为 0%-3%；资产支持证券比例为 0%-20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%。于 2008 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 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）	
	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	580,476,341.96	65.59
交易性金融资产- 债券投资	152,220,531.00	17.20
衍生金融资产- 权证投资	-	-

其他	-	-
合计	732,696,872.96	82.79

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感度分析

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。

假设	1. 假设单个证券价格和市场组合依照 CAPM 模型描述的规律进行变动；	
	2. CAPM 模型中的市场组合此处采用基金的业绩比较基准；	
	3. 业绩基准变化 10%时，对个券价格变化进行加总得到基金净值的变化。	
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：千元）
		本期末 (2008 年 12 月 31 日)
	+10%	67,222.61
	-10%	-67,222.61

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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	580,476,341.96	65.00
	其中：股票	580,476,341.96	65.00
2	固定收益投资	152,220,531.00	17.04
	其中：债券	152,220,531.00	17.04

	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	155,182,273.87	17.38
6	其他资产	5,182,044.58	0.58
7	合计	893,061,191.41	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

序号	行业	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	56,929,326.39	6.43
C	制造业	334,946,239.47	37.85
C0	食品、饮料	49,618,495.56	5.61
C1	纺织、服装、皮毛	10,956,170.17	1.24
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	8,115,000.00	0.92
C4	石油、化学、塑胶、塑料	54,710,438.70	6.18
C5	电子	959,072.94	0.11
C6	金属、非金属	108,121,104.66	12.22
C7	机械、设备、仪表	3,947,440.18	0.45
C8	医药、生物制品	89,281,081.80	10.09
C99	其他制造业	9,237,435.46	1.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	8,626,841.30	0.97
G	信息技术业	8,440,500.00	0.95
H	批发和零售贸易	81,863,335.81	9.25
I	金融、保险业	80,555,626.24	9.10
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	9,114,472.75	1.03
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合 计		580,476,341.96	65.59

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	占基金资产净值比例（%）
1	000629	攀钢钢钒	9,532,004	87,503,796.72	9.89
2	600036	招商银行	4,814,114	58,539,626.24	6.62
3	600600	青岛啤酒	2,167,144	43,321,208.56	4.90
4	600196	复星医药	3,140,396	33,319,601.56	3.77
5	600123	兰花科创	2,704,834	32,214,572.94	3.64
6	600309	烟台万华	2,925,339	29,253,390.00	3.31
7	600000	浦发银行	1,508,000	19,981,000.00	2.26
8	002091	江苏国泰	2,200,000	19,404,000.00	2.19
9	600500	中化国际	2,195,900	17,106,061.00	1.93
10	000061	农产品	1,036,335	16,477,726.50	1.86
11	600693	东百集团	1,503,891	13,068,812.79	1.48
12	600664	哈药股份	1,154,960	12,912,452.80	1.46
13	000919	金陵药业	2,428,521	12,458,312.73	1.41
14	000983	西山煤电	999,982	11,659,790.12	1.32
15	600426	华鲁恒升	1,084,184	11,503,192.24	1.30
16	600361	华联综超	1,599,930	9,855,568.80	1.11
17	600085	同仁堂	799,947	9,847,347.57	1.11
18	002003	伟星股份	893,369	9,237,435.46	1.04
19	600456	宝钛股份	806,727	9,180,553.26	1.04
20	000726	鲁泰A	1,414,488	8,684,956.32	0.98
21	000423	东阿阿胶	638,024	8,613,324.00	0.97
22	600019	宝钢股份	1,513,837	7,024,203.68	0.79
23	600348	国阳新能	700,000	6,811,000.00	0.77
24	600050	中国联通	1,350,000	6,790,500.00	0.77
25	601699	潞安环能	499,917	6,243,963.33	0.71
26	600655	豫园商城	599,916	5,951,166.72	0.67
27	000895	双汇发展	160,000	5,516,800.00	0.62
28	000059	辽通化工	999,904	5,089,511.36	0.58
29	600258	首旅股份	523,943	4,846,472.75	0.55
30	600717	天津港	500,000	4,340,000.00	0.49
31	600350	山东高速	880,000	4,268,000.00	0.48
32	600521	华海药业	333,777	4,058,728.32	0.46
33	600201	金宇集团	689,100	3,728,031.00	0.42
34	002054	德美化工	400,000	3,220,000.00	0.36
35	600005	武钢股份	661,950	3,164,121.00	0.36

36	600352	浙江龙盛	495,999	3,124,793.70	0.35
37	600308	华泰股份	500,000	3,050,000.00	0.34
38	600004	白云机场	386,786	2,726,841.30	0.31
39	600686	金龙汽车	555,273	2,587,572.18	0.29
40	600436	片仔癀	136,902	2,583,340.74	0.29
41	000488	晨鸣纸业	500,000	2,570,000.00	0.29
42	600963	岳阳纸业	500,000	2,495,000.00	0.28
43	600232	金鹰股份	769,903	2,271,213.85	0.26
44	600016	民生银行	500,000	2,035,000.00	0.23
45	002038	双鹭药业	47,981	1,759,943.08	0.20
46	002194	武汉凡谷	100,000	1,650,000.00	0.19
47	600269	赣粤高速	200,000	1,560,000.00	0.18
48	600315	上海家化	50,380	1,412,151.40	0.16
49	002204	华锐铸钢	89,465	1,359,868.00	0.15
50	600529	山东药玻	131,000	1,248,430.00	0.14
51	000822	山东海化	226,000	1,107,400.00	0.13
52	002257	立立电子	43,974	959,072.94	0.11
53	600300	维维股份	148,100	780,487.00	0.09

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末基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000629	攀钢钢钒	160,338,354.70	18.12
2	600036	招商银行	136,338,258.56	15.41
3	600176	中国玻纤	103,243,045.83	11.67
4	600000	浦发银行	94,615,983.15	10.69
5	600016	民生银行	81,876,389.91	9.25
6	600019	宝钢股份	76,252,314.33	8.62
7	600686	金龙汽车	64,140,204.00	7.25
8	600123	兰花科创	55,871,003.16	6.31
9	600309	烟台万华	45,023,687.07	5.09
10	600600	青岛啤酒	43,178,319.56	4.88
11	600270	外运发展	40,059,877.49	4.53
12	000061	农产品	34,793,457.59	3.93
13	600500	中化国际	34,343,696.74	3.88
14	601898	中煤能源	29,826,542.37	3.37
15	601318	中国平安	29,737,179.08	3.36

16	601398	工商银行	29,460,586.86	3.33
17	600050	中国联通	29,354,042.00	3.32
18	600196	复星医药	28,819,105.24	3.26
19	000895	双汇发展	26,043,192.00	2.94
20	000515	攀渝钛业	25,643,695.87	2.90
21	601628	中国人寿	24,527,141.30	2.77
22	600616	金枫酒业	23,655,246.47	2.67
23	002024	苏宁电器	22,766,936.19	2.57
24	600009	上海机场	21,955,522.30	2.48
25	600015	华夏银行	21,720,015.51	2.45
26	600150	中国船舶	19,453,376.21	2.20
27	600426	华鲁恒升	18,650,305.03	2.11
28	601166	兴业银行	18,038,356.92	2.04
29	600798	宁波海运	17,807,069.42	2.01

8.4.2 累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000629	攀钢钢钒	70,572,897.20	7.97
2	600176	中国玻纤	63,003,759.64	7.12
3	600000	浦发银行	57,980,833.73	6.55
4	600016	民生银行	47,321,055.74	5.35
5	600019	宝钢股份	47,153,953.61	5.33
6	601898	中煤能源	32,489,941.16	3.67
7	601398	工商银行	28,002,094.70	3.16
8	000515	攀渝钛业	25,657,741.41	2.90
9	002024	苏宁电器	25,403,288.78	2.87
10	600686	金龙汽车	25,380,587.03	2.87
11	600050	中国联通	25,149,846.72	2.84
12	601628	中国人寿	23,390,066.29	2.64
13	600270	外运发展	22,512,995.68	2.54
14	600015	华夏银行	21,585,592.15	2.44
15	600009	上海机场	21,577,834.28	2.44
16	000895	双汇发展	21,439,890.01	2.42
17	601318	中国平安	18,520,315.04	2.09
18	601166	兴业银行	17,377,656.00	1.96
19	600616	金枫酒业	17,376,272.91	1.96
20	000061	农产品	16,978,095.31	1.92

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

买入股票成本（成交）总额	1,818,934,172.23
卖出股票收入（成交）总额	929,351,643.55

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	48,545,000.00	5.49
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	103,675,531.00	11.72
7	其他	-	-
8	合计	152,220,531.00	17.20

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	0801052	08 央票 52	500,000	48,545,000.00	5.49
2	110227	赤化转债	327,050	37,175,773.50	4.20
3	125572	海马转债	262,109	28,467,658.49	3.22
4	125709	唐钢转债	193,609	19,645,505.23	2.22
5	125528	柳工转债	101,493	11,312,409.78	1.28

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证 券投资明细

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

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 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

8.9.2 本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库之外的股票。

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	398,503.54
2	应收证券清算款	2,878,351.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,800,412.28
5	应收申购款	104,776.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,182,044.58

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110227	赤化转债	37,175,773.50	4.20
2	110971	恒源转债	3,303,396.00	0.37
3	125528	柳工转债	11,312,409.78	1.28
4	125572	海马转债	28,467,658.49	3.22
5	125709	唐钢转债	19,645,505.23	2.22

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

基金持有人户数 (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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,838	96,108.40	530,851,973.02	46.66%	606,879,272.83	53.34%

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	3,720,561.49	0.33%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 4 月 30 日) 基金份额总额	1,388,696,479.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	359,033,219.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	609,998,453.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,137,731,245.85

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

1、报告期内基金管理人的重大人事变动：经兴业全球人寿基金管理有限公司股东会 2008 年第一次会议审议通过，解散公司第一届董事会，选举兰荣、张训苏、郑苏芬、刘先觉、万维德（Marc van Weede）、祖百瑞（Imaad Zuberi）担任公司董事，陈百助、黄明、于宁担任公司独立董事。

2、报告期内本基金托管人的重大人事变动：2008 年 6 月 13 日，中国证券监督管理委员会核准本基金的托管人投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

因安永会计师事务所对旗下两家合作所“安永大华会计师事务所”和“安永华明会计师事务所”进行合并，合并后的名称为“安永华明会计师事务所”，经公司第二届董事会 2008 年第四次会议审议同意，公司及公司旗下基金的审计服务机构由“安永大华会计师事务所”变更为“安永华明会计师事务所”。公司已于 2008 年 11 月 22 日在公司网站上对此进行了公告。

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 9 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 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		备注
		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	
兴业证券	2	1,873,065,194.01	68.51%	1,564,808.33	68.14%	新增
国元证券	1	-	-	-	-	新增
湘财证券	1	418,768,385.06	15.32%	355,950.62	15.50%	新增
华泰证券	2	-	-	-	-	新增
德邦证券	1	441,982,365.97	16.17%	375,689.41	16.36%	新增

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并经公司董事会批准。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加中国银行股份有限公司为兴业社会责任股票型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-3-27
2	关于暂停受理部分银联通客户网上交易认、申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-4-11
3	关于股权转让、增加注册资本、公司更名、公司章程修改的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-4-12
4	关于增加浦发银行为兴业社会责任基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-4-14
5	兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-5-5
6	关于增加江南证券为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-5-12
7	关于增加光大银行为旗下四基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-5-14
8	关于兴业社会责任基金参加部分销售机构网上交易系统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、基金管理人网站	2008-5-24
9	兴业社会责任股票型证券投资基金开放申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-5-24
10	关于董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、	2008-5-27

		证券时报、基金管理人网站	
11	关于通过中国建设银行网上银行申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-5-28
12	关于运用公司固有资金投资旗下兴业社会责任股票型证券投资基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-5-29
13	关于旗下部分基金参加建设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、基金管理人网站	2008-5-30
14	关于旗下部分基金参加交通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、基金管理人网站	2008-6-12
15	关于社会责任基金参加中国邮储银行定期定额业务申购费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-6-24
16	关于调整定期定额投资业务最低申购金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-6-27
17	关于增加农业银行为旗下三基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-6-27
18	关于在农业银行开通旗下三只基金定期定额申购及赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-6-27
19	旗下各基金 2008 年半年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-7-1
20	关于开通中国农业银行金穗卡基金网上交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-7-9
21	关于通过民生银行办理旗下基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-7-9
22	兴业社会责任股票型证券投资基金开放赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-7-11
23	关于旗下部分基金参加光大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、基金管理人网站	2008-7-18
24	关于旗下部分基金参加中信建投证券定时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、基金管理人网站	2008-7-19
25	关于通过德邦证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-7-26

	的公告		
26	关于调整中国农业银行金穗卡基金网上交易申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-8-29
27	关于变更公司名称、注册资本及修改公司章程的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-9-2
28	关于延长农行金穗卡网上交易申购费率优惠期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-9-2
29	关于长期停牌股票等没有市价的投资品种估值问题的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-9-16
30	关于长期停牌股票等没有市价的投资品种估值政策调整及对基金资产净值影响的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-9-17
31	关于调整中国农业银行金穗卡基金网上交易申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-9-26
32	关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-9-26
33	关于通过光大证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-10-25
34	关于旗下基金参加上海浦东发展银行基金定投申购优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-10-31
35	关于变更直销账户的公告(兴业银行)	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-11-15
36	关于变更直销账户的公告(工行建行)	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-11-18
37	关于变更为旗下基金提供审计服务的会计师事务所的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-11-22
38	关于调整中国建设银行龙卡基金网上交易申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-12-27
39	关于旗下部分基金参加建设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、基金管理人网站	2008-12-30
40	关于社会责任基金参加中国邮储银行定期定额业务申购费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2008-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

- 1、2008 年 5 月 27 日，中国建设银行股份有限公司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；
- 2、2008 年 9 月 23 日，中国建设银行股份有限公司公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持中国建设银行股份有限公司股份的公告；
- 3、2008 年 11 月 17 日，中国建设银行股份有限公司公告美国银行公司行使认购期权的事宜；
- 4、2008 年 12 月 2 日，中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

§ 13 备查文件目录

- 1、中国证监会批准兴业社会责任股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴业社会责任股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴业社会责任股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

存放地点：基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536

兴业全球基金管理有限公司

2009 年 3 月 28 日