

(上接D028版)

8.3 期末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

注：本基金合同于2008年4月23日生效。支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报批按前一日基金资产净值1.5%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报批=前一天基金资产净值 × 1.5% /当年天数。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
当期应支付的托管费	4,111,487.33
其中：当期已支付	3,703,031.65
期末未支付	408,455.68

注：本基金合同于2008年4月23日生效。支付基金管理人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值的2.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报批=前一天基金资产净值 × 2.5% /当年天数。

7.4.9.3 与关联方进行同行业场外的债券（含回购）交易

本基金报告期内未与关联方进行银行同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.9.4 关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期
2008年4月23日(基金合同生效日) - 2008年12月31日	4,111,487.33
当期应付的托管费	3,703,031.65
期末未支付	408,455.68

注：本基金合同于2008年4月23日生效。支付基金管理人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值的2.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报批=前一天基金资产净值 × 2.5% /当年天数。

7.4.9.5 与关联方进行同行业场外的债券（含回购）交易

本基金报告期内未与关联方进行银行同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.9.6 与关联方投资本基金的情况

7.4.9.6.1 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金报告期内未与基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.9.5 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

项目	本期
2008年4月23日(基金合同生效日) - 2008年12月31日	15,007,250.00
当期利息收入	0.00
期末余额	15,007,250.00

注：本基金自2008年4月23日成立。

7.4.9.6.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方承销证券的情况

本基金报告期内未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.1 期间(2008年12月11日)本基金持有的流通受限证券

本基金报告期内持有因认购新股而发证券造成的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金报告期内未持有流通受限股票。

7.4.10.3 期末持有的回购交易中作为抵押的债券

本基金报告期末未持有正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

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	1,171,736,388.09	62.70%
2	其中：股票	1,171,736,388.09	62.70%
3	固定收益投资	444,395,000.00	23.78%
4	其中：债券	444,395,000.00	23.78%
5	货币支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	159,353,178.77	8.53%
10	其他资产	93,393,346.51	5.00%
11	合计	1,868,877,913.37	100.00%

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	农、林、牧、渔业	32,104,284.00	1.74
2	采掘业	3,876,152.00	0.21
3	制造业	665,079,925.91	36.14
4	食品、饮料	143,689,665.27	7.81
5	纺织、服装、皮毛	18,381,535.16	1.00
6	木材、家具	-	-
7	造纸、印刷	13,808,322.42	0.75
8	石油、化学、塑胶、塑料	8,594,100.00	0.47
9	电子	37,536,875.92	2.04
10	金属、非金属	28,913,752.15	1.57
11	机械设备、仪表	263,692,911.77	14.33
12	医药、生物制品	150,462,763.22	8.18
13	其他制造业	-	-
14	电力、煤气及水的生产和供应业	27,850,000.00	1.51
15	建筑业	86,294,877.94	4.69
16	交通运输、仓储业	31,714,948.68	1.72
17	信息技术业	38,068,628.39	2.07
18	批发和零售贸易	67,973,207.46	3.69
19	金融、保险业	114,308,140.09	6.21
20	房地产业	100,759,520.62	5.48
21	社会服务业	-	-
22	传播与文化产业	-	-
23	综合类	3,706,703.00	0.20
24	合计	1,717,736,388.09	63.67

8.3 期末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	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,036,793,897.05	58.61%
2	其中：股票	1,036,793,897.05	58.61%
3	固定收益投资	300,124,000.00	16.96%
4	其中：债券	300,124,000.00	16.96%
5	货币支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	300,966,911.84	17.01%
10	其他资产	131,214,609.94	7.42%
11	合计	1,769,099,418.83	100.00%

8.4 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	农、林、牧、渔业	19,963,306.17	1.17
2	采掘业	0.00	0.00
3	制造业	702,477,468.82	41.34
4	食品、饮料	127,265,807.05	7.49
5	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
6	木材、家具	0.00	0.00
7	造纸、印刷	0.00	0.00
8	石油、化学、塑胶、塑料	18,906,206.94	1.11
9	电子	0.00	0.00
10	金属、非金属	25,276,427.48	1.49
11	机械设备、仪表	209,614,287.41	12.33
12	医药、生物制品	321,414,739.94	18.91
13	其他制造业	0.00	0.00
14	电力、煤气及水的生产和供应业	134,635,059.89	7.92
15	建筑业	77,318,422.00	4.55
16	交通运输、仓储业	3,060,000.00	0.18
17	信息技术业	988,099.40	0.06
18	批发和零售贸易	0.00	0.00
19	金融、保险业	23,090,223.48	1.36
20	房地产业	0.00	0.00
21	社会服务业	6,887,845.80	0.41
22	传播与文化产业	66,657,211.49	3.92
23	综合类	1,716,260.00	0.10
24	合计	1,036,793,897.05	61.01

8.5 期末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	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,036,793,897.05	58.61%
2	其中：股票	1,036,793,897.05	58.61%
3	固定收益投资	30	