

国泰金马稳健回报证券投资基金

2008 年度报告摘要

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.报告期间内,本基金未与关联方发生交易。

7.4.3 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间		金额单位:人民币元
	2008年1月1日至2008年12月31日	成交金额	占当期股票成交金额的比例	2007年1月1日至2007年12月31日	
万联证券	2,166,826,943.61	10.15%	3,126,140,445.01	17.60%	
中信建投	1,942,308,205.05	9.10%	1,151,289,000.16	6.48%	
中金公司	3,871,318,623.02	18.14%	-	-	

7.4.3.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间		金额单位:人民币元
	2008年1月1日至2008年12月31日	成交金额	占当期权证成交金额的比例	2007年1月1日至2007年12月31日	
万联证券	-	-	129,266,646.87	60.33%	
中信建投	-	-	36,845,650.06	17.20%	
中金公司	4,175,910.81	11.68%	-	-	

7.4.3.3 应付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间		
	2008年1月1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
万联证券	1,760,561.75	9.80%	-	-	-
中信建投	1,578,141.52	8.79%	596,418.03	25.55%	
中金公司	3,290,620.94	18.33%	224,856.04	9.63%	

7.4.3.4 关联方管理费

金额单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间		
	2008年1月1日至2008年12月31日	当期管理费	占当期管理费总量的比例	期末应付管理费余额	占期末应付管理费总额的比例
万联证券	2,446,222.09	17.04%	887,995.27	14.86%	
中信建投	900,894.23	6.27%	652,237.86	10.91%	
中金公司	-	-	-	-	

7.4.3.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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(%)
				本期	上年度可比期间	
1	080110A	08央穗票据108	1,000,000	98,170,000.00	2.21	
2	1000010	21国债(7)	2,222,430,000.00	5.00		
3	126018	12通银铜	299,950	21,785,368.50	0.49	
4	112002	08中联债	174,852	17,464,217.76	0.39	
5	010303	03国债(3)	144,370	14,779,156.90	0.33	

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	
			本期	上年度可比期间
1	600050	中国联通	478,892,756.09	4.75
2	600030	中信证券	347,574,487.29	3.45
3	601318	中国平安	296,400,940.35	2.94
4	600897	厦门空港	192,497,949.97	1.91
5	000002	万科A	164,675,379.69	1.63
6	600348	国阳新能	139,989,755.84	1.39
7	000709	唐钢股份	138,845,863.86	1.38
8	600266	北京城建	134,595,156.83	1.34
9	11619	北京银行	128,568,231.89	1.28
10	000839	中信国安	126,461,302.31	1.26
11	002122	天马股份	122,975,477.22	1.22
12	600005	武钢股份	122,687,465.39	1.22
13	000009	中国宝安	120,919,986.04	1.20
14	600880	双瑞传播	113,954,737.70	1.13
15	009052	广济药业	113,170,455.16	1.12
16	601088	中国神华	112,258,317.57	1.11
17	600674	川投能源	109,896,031.40	1.09
18	600997	开滦股份	109,694,211.60	1.09
19	600963	双汇发展	107,596,398.04	1.07
20	2000895	双汇发展	104,550,185.88	1.04

注:卖出金额按卖出金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	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	
			本期	上年度可比期间
1	600050	中国联通	478,892,756.09	4.75
2	600030	中信证券	347,574,487.29	3.45
3	601318	中国平安	296,400,940.35	2.94
4	600897	厦门空港	192,497,949.97	1.91
5	000002	万科A	164,675,379.69	1.63
6	600348	国阳新能	139,989,755.84	1.39
7	000709	唐钢股份	138,845,863.86	1.38
8	600266	北京城建	134,595,156.83	1.34
9	11619	北京银行	128,568,231.89	1.28
10	000839	中信国安	126,461,302.31	1.26
11	002122	天马股份	122,975,477.22	1.22
12	600005	武钢股份	122,687,465.39	1.22
13	000009	中国宝安	120,919,986.04	1.20
14	600880	双瑞传播	113,954,737.70	1.13
15	009052	广济药业	113,170,455.16	1.12
16	601088	中国神华	112,258,317.57	1.11
17	600674	川投能源	109,896,031.40	1.09
18	600997	开滦股份	109,694,211.60	1.09
19	600963	双汇发展	107,596,398.04	1.07
20	2000895	双汇发展	104,550,185.88	1.04

注:卖出金额按卖出金额(