(上接D064版)

§ 8 投资组合报告

8.1国泰金鹿保本

8.1.1 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	21,673,316.62	1.88
	其中:股票	21,673,316.62	1.88
2	固定收益投资	118,964,900.00	10.32
	其中:债券	89,249,000.00	7.74
	资产支持证券	29,715,900.00	2.58
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	1,007,145,314.71	87.36%
6	其他资产	5,116,627.61	0.44%
7	合计	1,152,900,158.94	100.00%

8.1.2 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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	12,111,765.41	1.07
C	制造业	3,468,594.91	0.31
C0	食品、饮料	733,996.00	0.06
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	855,502.90	0.08
C5	电子	1,043,187.37	0.09
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	555,615.52	0.05
C8	医药、生物制品	280,293.12	0.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,163,804.40	0.46
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	509,020.05	0.04
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	327,491.20	0.03
K	社会服务业	92,640.65	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	21,673,316.62	1.91

8.1.3 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	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	601001	大同煤业	299,919	11,957,770.53	1.06
2	601186	中国铁建	437,240	5,163,804.40	0.46
3	002215	诺普信	33,031	855,502.90	0.08
4	002221	东华能源	44,071	509,020.05	0.04
5	002214	大立科技	31,969	465,468.64	0.04
6	002216	三全食品	13,886	442,963.40	0.04
7	002212	南洋股份	21,727	391,086.00	0.03
8	002222	福晶科技	23,623	338,045.13	0.03
9	002208	合肥城建	14,116	327,491.20	0.03
10	002220	天宝股份	9,245	291,032.60	0.03

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本管理人网站的年度报告报告正文。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600325	华发股份	36,302,511.76	2.54
2	000623	吉林敖东	26,826,051.79	1.87
3	600000	浦发银行	25,450,961.67	1.78
4	601318	中国平安	25,150,072.94	1.76
5	600026	中海发展	23,838,202.70	1.66
6	000069	华侨城A	22,614,507.10	1.58
7	601628	中国人寿	22,028,114.45	1.54
8	601601	中国太保	21,534,720.78	1.50
9	601166	兴业银行	20,544,350.62	1.43
10	601088	中国神华	18,560,059.20	1.30
11	600683	银泰股份	18,417,257.24	1.29
12	601169	北京银行	17,659,874.72	1.23
13	600019	宝钢股份	16,651,911.08	1.16
14	600067	冠城大通	16,245,493.28	1.13
15	000560	ST昆百大	15,767,680.68	1.10
16	000905	厦门港务	15,180,591.57	1.06
17	600015	华夏银行	14,735,681.65	1.03
18	600036	招商银行	14,470,693.40	1.01
19	600674	川投能源	14,210,738.70	0.99
20	600005	武钢股份	13,820,988.60	0.97

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.1.4.2 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600325	华发股份	36,742,418.19	2.57
2	601088	中国神华	35,420,444.01	2.47
3	601318	中国平安	28,695,170.31	2.00
4	600000	浦发银行	28,581,857.92	2.00
5	601601	中国太保	26,544,081.13	1.85
6	000623	吉林敖东	26,158,793.28	1.83
7	601166	兴业银行	25,712,934.12	1.80
8	601169	北京银行	24,150,358.75	1.69
9	000026	S飞亚达A	23,302,965.22	1.63
10	600026	中海发展	22,542,474.55	1.57
11	601628	中国人寿	21,015,164.28	1.47
12	000069	华侨城A	20,614,616.33	1.44
13	600748	上实发展	19,850,160.23	1.39
14	600036	招商银行	19,550,991.66	1.37
15	600067	冠城大通	17,622,106.04	1.23
16	601390	中国中铁	17,458,388.41	1.22
17	600683	银泰股份	15,980,593.20	1.12
18	600153	建发股份	15,884,821.64	1.11
19	000905	厦门港务	15,388,667.29	1.07
20	600050	中国联通	15,326,477.18	1.07

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.1.4.3 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	1,037,872,264.21
卖出股票收入(成交)总额	1,221,126,264.51

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.1.5 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	-	-
3	金融债券	89,249,000.00	7.88
	其中:政策性金融债	69,485,000.00	6.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	89,249,000.00	7.88%

8.1.6 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	070208	07国开08	500,000	49,535,000.00	4.37
2	060218	06国开18	200,000	19,950,000.00	1.76
3	051001	05兴业01	200,000	19,764,000.00	1.74

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119007	宁建02	300,000	29,715,900.00	2.62

8.1.8 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

本基金本报告期未未持有权证投资。

8.1.9 投资组合报告附注

8.1.9.1本报告期内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报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.1.9.2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股票库之外的情况。

8.1.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	905,963.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,181,650.65
5	应收申购款	1,029,013.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,116,627.61

8.1.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601001	大同煤业	11,957,770.53	1.06	非公开发行股票
2	601186	中国铁建	5,163,804.40	0.46	新股网下申购
3	002215	诺普信	855,502.90	0.08	新股网下申购
4	002221	东华能源	509,020.05	0.04	新股网下申购
5	002214	大立科技	465,468.64	0.04	新股网下申购
6	002216	三全食品	442,963.40	0.04	新股网下申购
7	002212	南洋股份	391,086.00	0.03	新股网下申购
8	002222	福晶科技	338,045.13	0.03	新股网下申购
9	002220	天宝股份	291,032.60	0.03	新股网下申购

8.2国泰金鹿保本(二期)

8.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,112,247.88	0.21
	其中:股票	7,112,247.88	0.21
2	固定收益投资	2,395,020,378.46	72.01
	其中:债券	2,395,020,378.46	72.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	450,000,000.00	13.53
	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	424,593,048.72	12.77
6	其他资产	49,250,121.98	1.48
7	合计	3,325,975,797.04	100.00

8.2.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,458,492.48	0.08
C0	食品、饮料	910,000.00	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	918,000.00	0.03
C7	机械、设备、仪表	630,492.48	0.02
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,444,255.40	0.05
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,482,500.00	0.08
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	727,000.00	0.02
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	7,112,247.88	0.24

8.2.3 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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600100	同方股份	250,000	2,482,500.00	0.08
2	002267	陕天然气	121,366	1,444,255.40	0.05
3	000629	攀钢钒钛	100,000	918,000.00	0.03
4	000568	泸州老窖	50,000	910,000.00	0.03
5	600015	华夏银行	100,000	727,000.00	0.02
6	002266	浙富股份	30,196	630,492.48	0.02

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	3,112,200.00	0.10
2	600100	同方股份	2,143,901.35	0.07
3	002267	陕天然气	2,095,400.94	0.07
4	002269	美邦服饰	1,681,813.12	0.06
5	600036	招商银行	1,169,500.00	0.04
6	000568	泸州老窖	1,137,000.00	0.04
7	000629	攀钢钒钛	892,000.00	0.03
8	600015	华夏银行	867,050.00	0.03
9	002266	浙富股份	688,720.84	0.02
10	600550	天威保变	669,300.00	0.02
11	000726	鲁 泰A	510,425.52	0.02
12	002258	利尔化学	449,680.00	0.02
13	002254	烟台氨纶	381,095.00	0.01
14	002261	拓维信息	367,512.07	0.01
15	002265	西仪股份	276,511.68	0.01
16	002256	彩虹精化	244,920.00	0.01
17	002268	卫 士 通	214,269.48	0.01
18	002262	恩华药业	164,350.80	0.01
19	002263	大 东 南	155,760.00	0.01
20	002272	川润股份	140,940.00	0.00

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601186	中国铁建	4,072,665.97	0.14
2	601318	中国平安	2,324,009.09	0.08
3	002269	美邦服饰	2,125,443.20	0.07
4	002267	陕天然气	1,163,128.00	0.04
5	600036	招商银行	993,235.87	0.03
6	600550	天威保变	781,138.00	0.03
7	002258	利尔化学	647,000.00	0.02
8	000726	鲁 泰A	549,749.52	0.02
9	002254	烟台氨纶	533,000.00	0.02
10	002261	拓维信息	511,324.97	0.02
11	002266	浙富股份	412,920.00	0.01
12	002265	西仪股份	370,007.11	0.01
13	002221	东华能源	362,817.30	0.01
14	002268	卫 士 通	336,546.86	0.01
15	002262	恩华药业	324,179.50	0.01
16	002264	新 华 都	284,635.00	0.01
17	002256	彩虹精化	278,336.00	0.01
18	002263	大 东 南	256,175.00	0.01
19	002272	川润股份	242,865.00	0.01
20	002222	福晶科技	234,925.85	0.01

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.2.4.3 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	17,946,015.80
卖出股票收入(成交)总额	17,776,883.83

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.2.5 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	228,508,420.50	7.70
2	央行票据	1,397,942,000.00	47.09
3	金融债券	408,710,000.00	13.77
	其中:政策性金融债	408,710,000.00	13.77
4	企业债券	345,288,911.96	11.63
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	14,571,046.00	0.49
7	其他	-	-
8	合计	2,395,020,378.46	80.67

8.2.6 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801047	08央行票据47	2,000,000	213,800,000.00	7.20
2	0801026	08央行票据26	2,000,000	213,080,000.00	7.18
3	0701082	07央行票据82	2,000,000	207,440,000.00	6.99
4	040216	04国开16	2,000,000	204,880,000.00	6.90
5	0701010	07央行票据10	2,000,000	204,040,000.00	6.87

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

8.2.8 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。

8.2.9 投资组合报告附注

8.2.9.1本报告期内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报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.2.9.2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股票库之外的情况。

8.2.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	48,803,238.12
5	应收申购款	196,883.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	49,250,121.98

8.2.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.2.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本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

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
31,842	88,714.92	380,117,529.89	13.46%	2,444,742,883.34	86.54%

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	3,269,748.67	0.12%

§ 10 开放式基金份额变动

单位:份

国泰金鹿保本基金(二期)基金合同生效日(2008年6月12日)基金份额总额	3,186,908,566.53
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,531,926.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-381,580,079.45
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,824,860,413.23

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内,本基金无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人重大人事变动如下:

2008年6月7日,本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司副总经理变动的公告》,经本基金管理人董事会审议通过,同意陈▮女士因个人原因辞去公司副总经理职务。陈坚先生因已到法定退休年龄,不再担任公司副总经理。

2008年12月27日,本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》,经本基金管理人第四届董事会第一次会议审议通过,同意聘任巴立康先生担任公司副总经理。巴立康先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准(证监许可[2008]1429号文)。

报告期内,本基金托管人的托管部门无重大人事变动。

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,本基金无涉及基金管理人、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,本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为120,000.00元。目前的审计机构已提供审计服务的年限为3年。

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,基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

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	
国泰君安证券股份有限公司	2	2,271,357,883.81	100.00%	1,909,271.47	100.00%	

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购交易成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,126,470,994.06	100.00%	19,988,000,000.00	100.00%	19,024,365.22	100.00%

注:基金租用席位的选择标准是:

(1)资力雄厚,信誉良好;

(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

(3)经营行为规范,在最近一年内无重大违规经营行为;

(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(5)公司具有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务;能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

选择程序是:根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果,符合席位券商标准的,由公司研究部提出席位券商的调整意见(调整名单及调整原因),并经公司批准。

(上接D066版)

7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

7.4.7.2.1关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大阳光集合资产管理计划系列产品	基金管理人的股东所管理的集合理财产品

7.4.7.2.2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
光大保德信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司("光大证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
光大阳光2号集合资产管理计划("阳光2号")	基金管理人的股东所管理的集合理财产品

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	2,313,253,076.31	20.05%	2,029,918,408.28	20.44%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	1,147,500.00	83.63%

7.4.8.1.3 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
光大证券	1,966,257.02	20.35%	643,603.77	31.27%

关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007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
光大证券	1,664,530.71	20.95%	323,362.78	11.34%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当年应支付的管理费	86,219,633.22	37,535,798.02
其中:当年已支付	82,541,537.87	30,558,643.09
年末未支付	3,678,095.35	6,977,154.93

注:(1)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×1.50%/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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,由基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2)上述表格中"当年已支付"不包含当年已支付的上年应付管理费

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当年应支付的托管费	14,369,938.93	6,255,966.39
其中:当年已支付	13,756,923.02	5,093,107.22
年末未支付	613,015.91	1,162,859.17

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:

H=E×0.25%/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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,由基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2)上述表格中"当年已支付"不包含当年已支付的上年应付托管费

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金2008年度和2007年度均未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人2008年度和2007年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2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	本期末 2008年12月31日		上年度末 2007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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
阳光2号	-	-	11,647,956.55	0.72%

注:光大阳光2号集合资产管理计划在本报告期内分红获得基金份额2,214,342.88份,累计赎回本基金13,862,299.43份,赎回费102,844.08元,全部按照招募说明书公示费率收费。

7.4.8.5 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1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	416,200,273.31	8,079,446.75	925,619,171.89	3,166,308.86

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日				
	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:股)	总金额
-	-	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日				
	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:股)	总金额
光大证券	002152	广电运通	公开发行	7,000	118,160.00

注:(1)上述数据系本基金在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况;

(2)2007年数据为本基金在承销期内直接购入本基金关联方主承销证券。

7.4.9期末(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

本基金本年末未持有流通受限证券。

§ 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	2,362,571,343.19	84.46
	其中:股票	2,362,571,343.19	84.46
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	433,796,825.27	15.51
6	其他资产	924,666.39	0.03
7	合计	2,797,292,834.85	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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	181,778,919.89	6.56
C	制造业	1,119,601,186.61	40.40
C0	食品、饮料	38,218,325.60	1.38
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,241,384.36	2.17
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	178,200,100.12	6.43
C7	机械、设备、仪表	547,107,095.35	19.74
C8	医药、生物制品	280,973,808.96	10.14
C99	其他制造业	14,860,472.22	0.54
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,709,938.73	0.60
E	建筑业	42,338,013.12	1.53
F	交通运输、仓储业	87,597,096.51	3.16
G	信息技术业	113,591,889.20	4.10
H	批发和零售贸易	194,477,819.06	7.02
I	金融、保险业	452,400,202.37	16.32
J	房地产业	65,597,271.04	2.37
K	社会服务业	88,479,006.66	3.19
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,362,571,343.19	85.25

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	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	600089	特变电工	5,595,731	133,626,056.28	4.82%
2	600000	浦发银行	8,000,000	106,000,000.00	3.83%
3	000063	中兴通讯	3,135,961	85,298,139.20	3.08%
4	600036	招商银行	6,099,917	74,174,990.72