中信经典配置证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人：中信基金管理有限责任公司　基金托管人：招商银行股份有限公司

第一节 重要提示

（一）重要提示

中信经典配置证券投资基金管理人—中信基金管理有限责任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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年8月15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。

按照中国证监会《证券投资基金信息披露内容格式准则第3号——半年度报告的内容与格式》第六条“基金半年度报告中的财务会计报告无须审计，但中国证监会或证券交易所另有规定的除外”的规定，本基金2008年半年度报告的财务资料未经审计。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

第二节 基金简介

（一）基金基本情况

基金名称：中信经典配置证券投资基金
基金简称：中信经典配置基金
交易代码：288001
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2004年3月15日
报告期末基金份额总额：1,160,536,942.58份
基金合同存续期：不定期

（二）基金投资基本情况

投资目标：在长期投资的基础上，将战略资产配置与时机选择相结合，积极主动地精选证券，并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充，实施全流程的风险管理，力求在风险可控、获取稳定收益的基础上，追求资本最大可能的长期增值。

投资策略：本基金基本的投资策略是采取自上而下与自下而上相结合的主动管理(详见本基金的基金合同和招募说明书)。

业绩比较基准：60%×中信标普300指数+20%×中信全债指数+20%×一年期定期存款利率

风险收益特征：追求资产配置动态平衡、收益和长期资本增值平衡，风险适中。

（三）基金管理人

名称：中信基金管理有限责任公司
信息披露负责人：章月平
联系电话：010-82028888
传真：010-82253396
电子邮箱：service@citicfunds.com

（四）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司
信息披露负责人：姜然
联系电话：0755-83195226
传真：0755-83195201
电子邮箱：jiangran@cmbchina.com

(五) 信息披露方式

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：http://funds.ecitic.com
基金半年度报告置备地点：北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层

第三节 主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标（未经审计）

序号	主要财务指标	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润（元）	-924,670,982.11
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	-29,281,126.65
3	加权平均份额本期利润（元）	-0.7673
4	期末可供分配利润（元）	694,608,489.07
5	期末可供分配份额利润（元）	0.5985
6	期末基金资产净值（元）	1,855,145,431.65
7	期末基金份额净值（元）	1.5985
8	加权平均净值利润率	-38.04%
9	本期份额净值增长率	-32.39%
10	份额累计净值增长率	172.45%

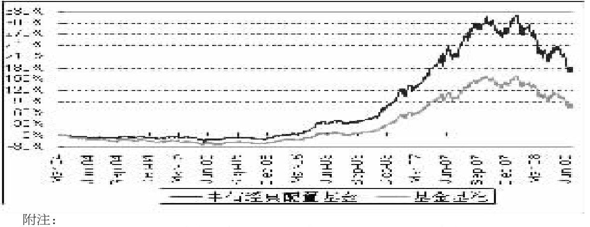
注：上述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）基金净值表现（未经审计）

1、中信经典配置基金各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较例表

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1个月	-14.03%	2.19%	-13.32%	2.02%	-0.71%	0.17%
过去3个月	-15.63%	2.04%	-15.39%	1.96%	-0.24%	0.08%
过去6个月	-32.39%	2.01%	-29.64%	1.84%	-2.75%	0.17%
过去1年	-12.83%	1.75%	-12.57%	1.57%	-0.26%	0.18%
过去3年	201.78%	1.42%	118.46%	1.23%	83.32%	0.19%
自基金合同生效起至今	172.45%	1.26%	74.75%	1.13%	97.70%	0.13%

2、中信经典配置基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比例图



附注：

根据本基金合同所规定的资产投资配置，股票资产45%-75%，债券资产5%-35%，短期金融工具5%-35%。2008年6月30日实际履行情况为，股票资产占基金资产净值为62.01%，债券资产（包括可转换债券、剩余持有期大于365天的国家债券、金融债券、央行票据和其他债券）占基金资产净值为22.56%，短期金融工具占基金资产净值为10.59%。

第四节 管理人报告

(一)基金管理人及基金经理简要介绍

1.基金管理人概况

中信基金管理有限责任公司由中信证券股份有限公司、国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字[2003] 107号文批准，于2003年10月15日正式成立，注册资本金为1亿元人民币。经中国证监会证监基金字（2007）120号文批准，并获得工商局准予变更登记的批复，国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司分别将其持有的本公司31%、10%和10%的股权转让给中信证券股份有限公司，上述股权转让已完成，公司由中信证券股份公司全资持有。

中信基金管理有限责任公司自2004年3月15日中信经典配置证券投资基金正式成立日起，成为该基金的管理人。

2. 基金经理小组成员介绍

基金经理：郑煜女士，中国科技大学管理科学工程专业硕士、天津大学化学工程专业学士。11年证券从业经历，历任中国长城信托投资公司董事会秘书；华夏证券研究所高级分析师；大成基金管理公司高级分析师、基金经理助理等职；2004年8月加盟中信基金管理有限责任公司，现任股权投资部总监、基金经理。

（二）基金运作遵规守信情况声明

基金管理人声明：在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

（三）公平交易

1、公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人建立了公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先，比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司交易系统中设置了公平交易模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。

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

按照中信经典配置基金的基金合同，中信经典配置基金属于混合型基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，中信基金旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

3、异常交易行为的专项说明

报告期内，未发生异常交易行为。

（四）投资策略和业绩表现说明及解释

1、报告期基金的业绩表现

截止2008年6月30日，本基金份额净值1.5985元，累计净值为2.5985元。上半年基金净值上涨-32.39%。同期基金业绩比较基准收益率为-29.64%，其中中信标普300股票指数收益率为-46.37%，中信全债指数同期上涨2.07%。

2、报告期内宏观经济与证券市场的简要回顾

今年上半年众多股市投资者尽管都对过高的估值有所顾忌，但都带着奥运年应该大涨的期盼坚守。初期人们忽略了美国次贷危机可能对全球经济的严重影响，对屡创新高的国际能源价格也反应迟钝。然而专业投资者对于经济增长减速和上市公司盈利增长低于预期的担忧日渐浓厚。同时高估值带来两方面的资金需求，一方面，大小非解禁进入高峰年，其高位减持的意愿非常强烈；另一方面，由于高价融资对业绩稀释小，上市公司纷纷启动新一轮大规模融资，资金大量消耗，市场增量资金供给不足。业绩和资金的双重压力，证券市场在投资者的不知不觉中直接进入了熊市，并且出现历史罕见的单边大幅下跌走势，A股指数跌幅近半。

初期，由于担心经济出现过热，所以在宏观政策方面整体表现偏紧。银行贷款增量严格控制，同时为了对冲外汇占款的增加带来的流动性，存款准备金率多次上调，直至历史最高水平的17.5%。财政支出上也未因二月的雪灾出现明显增长。由于国际大宗商品和粮食作物价格的上涨，输入性通胀成为政府重点关注的对象，如何将物价控制在合理范围内，又不牺牲经济增长，成为政府决策需要重点考虑的问题。

5月的地震和奥运前的准备工作，导致部分行业的生产经营受到较明显的影响，加上宏观调控作用逐渐显现，GDP逐季下降，今年上半年增长10.4%，市场开始由过热的担心转向对过冷的疑虑。同时国际能源和大宗原材料的价格迅速上升，导致PPI上升很快。而我国成品油、电力等价格管制，导致利润呈现非正常状态，财政补贴的原则和幅度的不透明，使投资者面前的迷雾更浓。

3、报告期内基金投资回顾

股票投资回顾：

从行业的表现看，今年农业和农化成为明星，而严格监管下，房地产行业出现明显资金紧张和销售萎缩，连累了银行业一起出现大幅度的下跌。行业收益率分化严重。

由于对经济未来增长预期不明确和通货膨胀加剧的前提下，国家对价格的管制是否放开、如何调整均充满不确定性，无法按照正常通胀条件下的投资脉络进行投资，所以在按照防御的原则进行行业配置，加大稳定增长的医药、经常消费品、煤炭行业的投资比例，同时在股票选择上适当降低了集中度。但是考虑绝对业绩较高和相对估值水平较低，一直维持了对投资品和水运行业的配置，在很大程度上影响了业绩表现。

债券和短期金融工具投资回顾

虽然债券市场不确定性增加，但随着收益率的持续上行，债券的吸引力也在增加，考虑到10年期国债收益率4.5%附近，加上免税效应收益率接近6%，从长期看已经具备较好的抗通胀能力，基金对中长期债券进行尝试性建仓。此外，考虑到短期融资券和央行票据的利差下降较快，本基金对短期融资券进行了阶段性减持。

（五）宏观市场、证券市场及行业走势的简要展望

股票投资：

经济将在持续高增长后出现回落调整，此次调整将涉及到明显的结构调整。由于汇率的变化，整体将向高附加值、高科技含量、环境友好型转变，可能对部门行业造成一定的经营压力甚至出现全行业的亏损，但这部分压力是中国转型过程中必须要经历的，因为以往过分依赖的外需出了问题。目前我们较认同09年实现8—9%的经济增长，而且一定时间内会出现明显滞胀特征。

目前随着节能降耗政策的逐步实施，高耗能产业增长明显放缓，工业生产将轻型科技化，这也解释了大家关注较多的发电量和用电量的增长与上年相比出现明显回落的问题。

由于目前要素价格尚未理顺，成品油和电力均可能出现价格变化，同时放松货币政策的传闻较多，所以我们要时时观察国家宏观政策可能出现的变化以及要素价格的改革思路，力求用长线眼光评价各个不同行业目前被扭曲的利润水平，为未来的配置调整做好准备。

但从目前市场的估值看，已经处于长期合理估值范围内，对于未来前景较好的行业和公司，对于产业资本性质的大小非已经不存在减持的动力，所以此时的放大镜将起到更大的作用，我们将根据通胀高位维持到明年年中，经济增长放缓的假设前提，本着防御的心态，专注于在经济减速中仍能够获得稳定增长的优质企业。

债券和短期金融工具投资：

虽然对于经济和物价前景依然不甚明朗，但债券收益率已经处于近10年来高位，具有了一定的吸引力。由于投资者均较为谨慎，预计债券市场将在较长一段时间内继续盘整。而对于信用产品而言，短期融资券经历了上半年的收益率大幅下降，投资吸引力已经明显减弱；需要密切关注的是公司债、可分离债和企业债等信用产品，这些产品由于供给密集而且投资者全体单一，可能会在下半年出现收益率快速攀升的局面，届时一些资质较好、收益率被错位定位的产品将会来带较好的投资机会。

第五节 托管人报告

托管人声明：在本报告期内，基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

招商银行股份有限公司
2008年8月15日

第六节 财务会计报告

（一）中信经典配置基金半年度会计报表（未经审计）

1、 中信经典配置基金资产负债表

单位：人民币元

	附注七	2008年6月30日	2007年12月31日
资产			
银行存款	1	31,189,175.48	234,006,145.54
结算备付金		7,407,299.39	4,540,930.53
存出保证金		1,365,713.60	2,575,988.42
交易性金融资产	2	1,684,082,612.21	2,528,934,670.01
其中：股票投资		1,150,397,240.71	2,036,557,978.01
债券投资		533,685,371.50	492,376,692.00
资产支持证券投资		0.00	0.00
衍生金融资产		0.00	15,107,117.22
买入返售金融资产		50,000,195.00	200,000,420.00
应收证券清算款		124,305,647.15	0.00
应收利息	3	10,086,657.31	5,950,691.41
应收股利		223,184.46	0.00
应收申购款		425,695.26	1,818,722.22
其他资产		0.00	79,564.75
资产合计		1,909,086,179.86	2,993,014,250.10
负债			
短期借款		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债		0.00	0.00
卖出回购金融资产款		45,699,977.15	0.00
应付证券清算款		0.00	45,479,514.63
应付赎回款		1,664,070.29	5,828,628.19
应付管理人报酬		2,458,071.99	3,697,386.51
应付托管费		409,678.65	616,231.09
应付交易费用	4	1,620,376.57	1,499,899.83
应交税费		1,461,560.62	1,461,560.62
应付利息		0.00	0.00
应付利润		0.00	0.00
其他负债	5	627,012.94	597,653.78
负债合计		53,940,748.21	59,180,874.65
所有者权益			
实收基金	6	1,160,536,942.58	1,240,906,892.29
未分配利润	7	694,608,489.07	1,692,926,483.16
所有者权益合计		1,855,145,431.65	2,933,833,375.45
负债和所有者权益总计		1,909,086,179.86	2,993,014,250.10
基金份额净值		1.5985	2.3643
基金份额总额		1,160,536,942.58	1,240,906,892.29

所附附注为本会计报表的组成部分

2、 中信经典配置基金本报告期利润表

单位：人民币元

	附注七	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年1月1日至2007年6月30日
收入		-887,048,239.75	1,463,649,666.18
利息收入		12,381,805.56	9,258,350.51
其中：存款利息收入		1,548,882.22	1,841,250.56
债券利息收入		10,705,238.71	7,051,452.24
资产支持证券利息收入		0.00	0.00
买入返售金融资产收入		127,684.63	365,647.71
投资收益		-4,274,782.46	1,470,362,590.82
其中：股票投资收益	8	-19,144,539.07	1,394,732,282.25
债券投资收益	9	3,194,768.79	-4,339,271.15
资产支持证券投资收益		0.00	0.00
衍生工具收益	10	4,801,084.36	71,611,133.15
股利收益		6,873,903.46	8,358,446.57
公允价值变动收益	11	-895,389,855.46	-16,758,518.20
其他收入	12	234,592.61	787,243.05
费用		37,622,742.36	41,996,339.17
管理人报酬		18,198,044.11	22,006,847.30
托管费		3,033,007.36	3,667,807.88
交易费用	13	12,971,198.99	14,327,890.89
利息支出		3,193,098.19	1,721,871.90
其中：卖出回购金融资产支出		3,193,098.19	1,721,871.90
其他费用	14	227,393.71	271,921.20
利润总额		-924,670,982.11	1,421,653,327.01

所附附注为本会计报表的组成部分

3、中信经典配置基金本报告期所有者权益（基金净值）变动表

单位：人民币元

	附注七	2008年1月1日至2008年6月30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）		1,240,906,892.29	1,692,926,483.16	2,933,833,375.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）		0.00	-924,670,982.11	-924,670,982.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		-80,369,949.71	-73,647,011.98	-154,016,961.69
其中：1. 基金申购款		72,217,266.40	80,787,667.82	153,004,934.22
2. 基金赎回款		-152,587,216.11	-154,434,679.80	-307,021,895.91
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	15	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）		1,160,536,942.58	694,608,489.07	1,855,145,431.65
		2007年1月1日至2007年6月30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）		1,594,366,299.18	1,307,677,582.55	2,902,043,881.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）		0.00	1,421,653,327.01	1,421,653,327.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数		97,904,124.87	13,944,077.96	111,848,202.83
其中：1.基金申购款		767,956,062.83	652,619,546.58	1,420,575,609.41
2.基金赎回款		-670,051,937.96	-638,675,468.62	-1,308,727,406.58
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		0.00	-1,332,310,955.19	-1,332,310,955.19
五、期末所有者权益（基金净值）		1,692,270,424.05	1,410,964,032.33	3,103,234,456.38

所附附注为本会计报表的组成部分。

（二）中信经典配置基金半年度会计报表附注

一、基金设立情况

中信经典配置证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]7号文《关于同意中信经典配置证券投资基金设立的批复》批准，由中信基金管理有限责任公司作为发起人向社会公开发行募集，《中信经典配置证券投资基金基金合同》于2004年3月15日正式生效，首次设立募集规模为12,149,371,119.38份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为中信基金管理有限责任公司，注册登记人为中信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。《中信经典配置证券投资基金基金合同》、《中信经典配置证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括：国内依法发行上市的股票、债券、短期金融工具以及由中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金在长期投资的基础上，将战略资产配置与时机选择相结合，积极主动地精选证券，并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充，实施全流程的风险管理，力求在风险可控、获取稳定收益的基础上，追求资本最大可能的长期增值。本基金的业绩比较基准为：60%×中信标普300指数+20%×中信全债指数+20%×一年期定期存款利率。

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》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

根据中国证监会颁布的证监会计字[2006]23号《关于基金管理公司及证券投资基金执行<企业会计准则>的通知》，本基金自2007年7月1日起执行财政部2006年发布的《企业会计准则》。本财务报表按照《企业会计准则第38号——首次执行企业会计准则》以及其他相关规定，对要求追溯调整的项目在相关会计年度进行了追溯调整，并对财务报表进行了重新表述。

可比年度财务报表的列报方式已按照企业会计准则的要求进行了重述。

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6月30日的财务状况以及2008年上半年度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。

三、重要会计政策和会计估计

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。

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）交易印花税税率，由原先的1‰调整为3‰；

根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，从2008年4月24日起，对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据，由立据双方当事人分别按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[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，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、本报告期内重大会计错误。（无）

六、关联方

1、关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信基金管理有限责任公司	基金发起人、基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中信证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
中信万通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构
中信金通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构
中信建投证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构

2、关联方交易

基金管理人声明：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

①本报告期内通过关联方席位进行的交易

关联方名称	股票投资成交金额（人民币元）	占本期股票成交总额的比例%
中信证券	354,395,956.27	9.20
中信万通证券	213,562,098.53	5.54
中信建投证券	101,040,809.08	2.62

关联方名称	债券投资成交金额（人民币元）	占本期债券成交总额的比例%
中信证券	15,037,200.70	11.72
中信万通证券	0.00	0.00
中信建投证券	0.00	0.00

关联方名称	回购交易成交金额（人民币元）	占本期回购成交总额的比例%
中信证券	160,000,000.00	6.32
中信万通证券	80,000,000.00	3.16
中信建投证券	0.00	0.00

关联方名称	佣金（人民币元）	占本期佣金总量的比例%
中信证券	298,113.01	9.22
中信万通证券	175,846.87	5.44
中信建投证券	82,096.77	2.54

②上年同期通过关联方席位进行的交易

关联方名称	股票投资成交金额（人民币元）	占上年同期股票成交总额的比例%
中信证券	2,136,436,978.24	33.58
中信万通证券	229,643,218.57	3.62
中信建投证券	782,206,818.06	12.30

关联方名称	债券投资成交金额（人民币元）	占上年同期债券成交总额的比例%
中信证券	25,501,746.40	64.75
中信万通证券	5,160,000.00	13.10
中信建投证券	882,360.00	2.24

关联方名称	回购交易成交金额（人民币元）	占上年同期回购成交总额的比例%
中信证券	94,300,000.00	8.48
中信万通证券	0.00	0.00
中信建投证券	199,900,000.00	17.99

关联方名称	佣金（人民币元）	占上年同期佣金总量的比例%
中信证券	1,707,887.51	33.36
中信万通证券	179,697.77	3.51
中信建投证券	623,283.73	12.18

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) 股票交易佣金为成交金额的1‰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现券和债券回购交易佣金，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、关联方报酬

①支付基金管理人的管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年实际天数

单位：人民币元

项目	本报告期间累计计提金额	本报告期间支付金额	上年同期累计计提金额	上年同期支付金额
管理费	18,198,044.11	19,437,358.63	22,006,847.30	21,716,198.94

②支付基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年实际天数

单位：人民币元

项目	本报告期间累计计提金额	本报告期间支付金额	上年同期累计计提金额	上年同期支付金额
托管费	3,033,007.36	3,239,559.80	3,667,807.88	3,619,366.47

③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招商银行股份有限公司保管，并按银行间同业存款利率计息，本半年度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：

单位：人民币元

	2008年6月30日	2007年6月30日
银行存款余额	31,189,175.48	375,973,259.18
	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年1月1日至2007年6月30日
银行存款产生的利息收入	1,480,636.52	1,752,942.01

4、与关联方进行银行间同业市场的债券交易

①本报告期无通过关联方进行的银行间同业市场的债券交易。

②上年同期无通过关联方进行的银行间同业市场的债券交易。

5、关联方持有基金份额

2008年6月30日和2007年12月31日，本基金的关联方均未持有本基金。

6、本报告期内关联方关系没有变化。

七、本报告期内流通转让受到限制的基金资产

1、股票

（1）因认购新发或增发而于期末持有的流通受限股票

单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
002223	鱼跃医疗	2008-4-10	2008-7-18	认购新发	9.48	20.00	19,071	180,793.08	381,420.00
002238	天威视讯	2008-5-14	2008-8-26	认购新发	6.98	12.25	39,463	275,451.74	483,421.75
002242	九阳股份	2008-5-20	2008-8-28	认购新发	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
002251	步步高	2008-6-11	2008-9-19	认购新发	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
002258	利尔化学	2008-6-30	2008-7-8	认购新发	16.06	16.06	5,500	88,330.00	88,330.00
合计								2,192,417.70	3,948,580.57

（2）期末持有的暂时停牌的股票

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
600785	新华百货	2008-6-30	重大事项公告	16.92	2008-7-25	18.61	847,300	16,759,283.52	14,336,316.00
600900	长江电力	2008-5-8	重大事项公告	14.65	不确定	不确定	3,000,000	39,885,275.00	43,950,000.00
合计								56,644,558.52	58,286,316.00

2、债券

（1）期末正回购交易中作为质押的债券

截至2008年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币45,699,977.15元，涉及质押的标准券总金额为45,700,000.00元，于2008年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

除此之外，本基金无因其他原因导致期末持有的证券流通受限的情况。

八、金融工具及其风险分析

1、风险管理政策和组织架构

本基金持有的金融工具的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。

本基金管理人设立的风险控制体系从组织结构上自上而下可分为四个层次：

第一层：公司董事会和监事会，其中，董事会承担公司风险管理的最终责任。

第二层：董事会下设的资格审查与薪酬委员会、审计与风险管理委员会；督察长、监察稽核部配合审计与风险管理委员会对公司风险管理进行独立的监督和指导。

第三层：公司经营管理层负责建立全公司的危机处理机制；经营管理层下设投资管理委员会，就投资运作进行集体决策并针对投资风险进行评估、预警。同时经营管理层组成公司办公会，公司重大事项均由办公会审议通过。

第四层：各部门建立、健全内部风险识别、评估、控制、监督和完善风险控制的管理体系，并指定主要管理人员负责风险管理工作。

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。

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。巨量的赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险。

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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般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。

(1) 市场价格风险

市场价格风险是指：1）基金所持股票的市场价格变动而发生波动的风险；2）基金所持证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券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变动而发生波动的风险。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。

本基金的资产投资配置为股票资产45%-75%，债券资产5%-35%，短期金融工具5%-35%。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：

单位：人民币元

	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	1,150,397,240.71	62.01%	2,036,557,978.01	69.42%
-债券投资	533,685,371.50	28.77%	492,376,692.00	16.78%
衍生金融资产	0.00	0.00%	15,107,117.22	0.51%
合计	1,684,082,612.21	90.78%	2,544,041,787.23	86.71%

本基金管理人运用定量分析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，将对基金利润总额和净值产生的影响。

2008年6月30日			
业绩比较基准	增加/减少%	对利润总额的影响（元）	对净值的影响（元）
60%×中信标普300指数+20%×中信全债指数+20%×一年期定期存款利率	+5	99,250,280.59	99,250,280.59
	-5	-99,250,280.59	-99,250,280.59
2007年12月31日			
业绩比较基准	增加/减少%	对利润总额的影响（元）	对净值的影响（元）
60%×中信标普300指数+20%×中信全债指数+20%×一年期定期存款利率	+5	170,902,696.51	170,902,696.51
	-5	-170,902,696.51	-170,902,696.51

(2) 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、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。

单位：人民币元

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	31,189,175.48	0.00	0.00	0.00	31,189,175.48
结算备付金	7,407,299.39	0.00	0.00	0.00	7,407,299.39
存出保证金	333,333.32	0.00	0.00	1,032,380.28	1,365,713.60
交易性金融资产	115,566,040.40	321,589,331.10	96,530,000.00	1,150,397,240.71	1,684,082,612.21
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	50,000,195.00	0.00	0.00	0.00	50,000,195.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	124,305,647.15	124,305,647.15
应收股利	0.00	0.00	0.00	223,184.46	223,184.46
应收利息	0.00	0.00	0.00	10,086,657.31	10,086,657.31
应收申购款	148,111.36	0.00	0.00	277,583.90	425,695.26
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	204,644,154.95	321,589,331.10	96,530,000.00	1,286,322,693.81	1,909,086,179.86
负债					
卖出回购金融资产	45,699,977.15	0.00	0.00	0.00	45,699,977.15
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	1,664,070.29	1,664,070.29
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	2,458,071.99	2,458,071.99
应付托管费	0.00	0.00	0.00	409,678.65	409,678.65
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	1,620,376.57	1,620,376.57
应交税费	0.00	0.00	0.00	1,461,560.62	1,461,560.62
其他负债	0.00	0.00	0.00	627,012.94	627,012.94
负债总计	45,699,977.15	0.00	0.00	8,240,771.06	53,940,748.21
利率敏感度缺口	158,944,177.80	321,589,331.10	96,530,000.00	1,278,081,922.75	1,855,145,431.65
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	234,006,145.54	0.00	0.00	0.00	234,006,145.54
结算备付金	4,540,930.53	0.00	0.00	0.00	4,540,930.53
存出保证金	400,000.00	0.00	0.00	2,175,988.42	2,575,988.42
交易性金融资产	359,335,271.90	131,136,172.10	1,905,248.00	2,036,557,978.01	2,528,934,670.01
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	15,107,117.22	15,107,117.22
买入返售金融资产	200,000,420.00	0.00	0.00	0.00	200,000,420.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	5,950,691.41	5,950,691.41
应收申购款	36,878.73	0.00	0.00	1,781,843.49	1,818,722.22
其他资产	0.00	0.00	0.00	79,564.75	79,564.75
资产总计	798,319,646.70	131,136,172.10	1,905,248.00	2,061,653,183.30	2,993,014,250.10
负债					
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	45,479,514.63	45,479,514.63
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	5,828,628.19	5,828,628.19
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	3,697,386.51	3,697,386.51
应付托管费	0.00	0.00	0.00	616,231.09	616,231.09
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	1,499,899.83	1,499,899.83
应交税费	0.00	0.00	0.00	1,461,560.62	1,461,560.62
其他负债	0.00	0.00	0.00	597,653.78	597,653.78
负债总计	0.00	0.00	0.00	59,180,874.65	59,180,874.65
利率敏感度缺口	798,319,646.70	131,136,172.10	1,905,248.00	2,002,472,308.65	2,933,833,375.45

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对基金净值产生的影响。

单位：人民币元

	增加/减少基点	对净值的影响
2008年6月30日		
利率	+25	-4,228,701.42
利率	-25	4,297,515.67
	增加/减少基点	对净值的影响
2007年12月31日		
利率	+25	-1,400,346.35
利率	-25	1,411,318.60

(3) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

第七节 投资组合报告

（一）期末基金资产组合情况

期末各类资产：	金额（单位：人民币元）	占基金总资产比例%
股票	1,150,397,240.71	60.26
*债券	533,685,371.50	27.96
权证	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	38,596,474.87	2.02
其它资产	186,407,092.78	9.76
合计：	1,909,086,179.86	100.00

*债券类资产包括可转换债券、剩余持有期大于365天的国家债券、金融债券、央行票据和其他债券，以及本基金“短期金融工具”投资类别中持有期365天以内（包括365天）的国家债券、金融债券、央行票据和其他债券。

（二）期末按行业分类的股票投资组合

行业分类	期末市值(单位：人民币元)	占基金资产净值比例%
A 农、林、牧、渔业	36,058,956.01	1.94
B 采掘业	107,968,281.00	5.82
C 制造业	607,646,153.75	32.75
C0 食品、饮料	164,354,112.77	8.86
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2 木材、家具	0.00	0.00
C3 造纸、印刷	49,310,294.00	2.66
C4 石油、化学、塑胶、塑料	32,821,585.00	1.77
C5 电子	10,052,914.00	0.54
C6 金属、非金属	65,552,260.81	3.53
C7 机械、设备、仪表	200,224,295.52	10.79
C8 医药、生物制品	85,330,691.65	4.60
C99 其他制造业	0.00	0.00
D 电力、煤气及水的生产和供应业	43,950,000.00	2.37
E 建筑业	18,252,000.00	0.98
F 交通运输、仓储业	115,693,560.69	6.24
G 信息技术业	0.00	0.00
H 批发和零售贸易	64,493,894.82	3.48
I 金融、保险业	77,003,279.10	4.15
J 房地产业	10,706,200.00	0.58
K 社会服务业	60,627,777.00	3.27
L 传播与文化产业	5,060,576.84	0.27
M 综合类	2,936,561.50	0.16
合计	1,150,397,240.71	62.01

（三）基金投资前十名股票明细

(截止到2008年6月30日)

股票代码	股票名称	股票数量（股）	期末市值（单位：人民币元）	市值占净值比例%
601666	平煤天安	2,214,850	82,968,281.00	4.47
000729	燕京啤酒	4,590,829	77,125,927.20	4.16
601006	大秦铁路	4,284,629	58,313,800.69	3.14
600202	哈空调	5,816,331	57,756,166.83	3.11
601919	中国远洋	2,528,000	49,928,000.00	2.69
000858	五粮液	2,559,998	46,643,163.56	2.51
600900	长江电力	3,000,000	43,950,000.00	2.37
000157	中联重科	3,010,900	41,700,965.00	2.25
601166	兴业银行	1,633,550	41,606,518.50	2.24
600016	民生银行	6,209,958	35,396,760.60	1.91

提示：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http://funds.ecitic.com网站的半年度报告正文。

（四）投资组合的重大变动

1. 本报告期内投资组合重大变动

（1）累计买入金额前20名股票明细（或超出期初基金资产净值2%）

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额（成交金额）（单位：人民币元）	占期初净值比例%
1	600202	哈空调	121,664,783.52	4.15
2	601166	兴业银行	112,174,948.21	3.82
3	600005	武钢股份	104,150,856.37	3.55
4	601666	平煤天安	103,333,576.04	3.52
5	600028	中国石化	68,255,538.69	2.33
6	000729	燕京啤酒	52,042,366.34	1.77
7	600050	中国联通	50,341,516.66	1.72
8	000069	华侨城A	44,410,892.91	1.51
9	600584	长电科技	41,082,769.26	1.40
10	600351	亚宝药业	40,975,350.15	1.40
11	600572	康恩贝	39,454,393.21	1.34
12	600308	华泰股份	39,193,384.38	1.34
13	600016	民生银行	39,005,699.92	1.33
14	600685	广船国际	37,862,520.36	1.29
15	601898	中煤能源	36,689,769.50	1.25
16	600312	平高电气	35,903,988.83	1.22
17	600795	国电电力	34,817,443.78	1.19
18	600809	山西汾酒	34,425,314.13	1.17
19	000972	新中基	32,025,829.41	1.09
20	601169	北京银行	29,894,751.07	1.02

（2）累计卖出金额前20名股票明细（或超出期初基金资产净值2%）

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额（成交金额）（单位：人民币元）	占期初净值比例%
1	600005	武钢股份	144,978,250.22	4.94
2	600028	中国石化	107,082,364.54	3.65
3	601166	兴业银行	90,856,618.72	3.10
4	002092	中泰化学	67,408,322.79	2.30
5	600685	广船国际	63,650,695.04	2.17
6	600000	浦发银行	60,636,805.99	2.07
7	601088	中国神华	57,718,666.65	1.97
8	000680	山推股份	54,681,135.80	1.86
9	600511	国药股份	53,697,390.74	1.83
10	600690	青岛海尔	47,538,279.63	1.62
11	600518	康美药业	47,359,606.80	1.61
12	600795	国电电力	46,385,964.90	1.58
13	600308	华泰股份	45,619,556.07	1.55
14	600900	长江电力	43,733,803.83	1.49
15	600050	中国联通	41,159,069.59	1.40
16	600592	龙溪股份	40,557,368.90	1.38
17	600115	东方航空	40,204,925.81	1.37
18	600572	康恩贝	38,321,883.40	1.31
19	000800	一汽轿车	38,128,905.43	1.30
20	601898	中煤能源	37,708,101.19	1.29

2、本报告期内买入股票成本总额为1,961,423,106.85元，卖出股票收入总额（成交金额）为1,947,343,143.41元。

（五）按品种分类的债券组合

品种分类	市值(单位：人民币元)	占基金资产净值比例%
国家债券投资	215,898,701.50	11.64
金融债券投资	227,551,000.00	12.27
可转换债投资	0.00	0.00
央行票据投资	89,915,000.00	4.85
企业债券投资	320,670.00	0.01
合计	533,685,371.50	28.77

（六）基金投资债券前五名明细

债券名称	市值(单位：人民币元)	占基金资产净值比例%
21国债⒂	111,644,150.00	6.02
07进出10	98,590,000.00	5.31
08国债03	96,530,000.00	5.20
08农发02	50,190,000.00	2.71
08国开02	50,070,000.00	2.70

（七）投资组合报告附注

1、本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

3、其他资产的构成

资产项目	金额(单位：人民币元)
存出保证金	1,365,713.60
买入返售金融资产	50,000,195.00
应收股利	223,184.46
应收利息	10,086,657.31
应收申购款	425,695.26
待摊费用	0.00
应收证券清算款	124,305,647.15
合计	186,407,092.78

4、本报告期末无处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内投资权证明细

①本报告期没有因股权分置改革被动持有权证

②本报告期因配售分离交易可转债而获得权证

权证代码	权证名称	数量（份）	成本（单位：人民币元）
580017	赣粤CWB1	440,625	1,808,437.50
580018	中远CWB1	218,638	1,125,762.60
580022	国电CWB1	998,203	2,338,780.30
580023	康美CWB1	497,650	824,265.20

③本报告期没有主动投资权证

6、本报告期末本基金没有持有权证

7、本报告期末本基金没有持有资产支持证券

第八节 基金份额持有人户数、持有人结构

(截止日期：2008年6月30日)

1	本基金份额持有人户数		29,989户
2	平均每户持有基金份额		38,698.75份
序号	项目	份额（份）	占总份额比例%
1	机构投资者持有基金份额	97,686,694.79	8.42
2	个人投资者持有基金份额	1,062,850,247.79	91.58
	合计	1,160,536,942.58	100.00

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）	占本基金总份额比例%
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	4,861.19	0.0004

第九节 开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	合同生效日的份额总额	12,149,371,119.38
2	期初基金份额总额	1,240,906,892.29
3	加：本期申购基金份额总额	72,217,266.40
4	其中：红利再投资份额	0.00
5	减：本期赎回基金份额总额	152,587,216.11
6	期末基金份额总额	1,160,536,942.58

第十节 重大事件揭示

（一）本报告期没有举行基金份额持有人大会。
（二）基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
（三）本报告期基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务没有发生诉讼事项。
（四）本报告期基金投资策略没有改变。
（五）本报告期本基金没有进行收益分配。
（六）本报告期继续聘请安永华明会计师事务所作为本基金的审计事务所。
（七）本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。
（八）基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

单位：人民币元

证券公司名称	股票投资成交金额	占本期股票成交总额的比例%
中信证券	354,395,956.27	9.20
中信建投证券	101,040,809.08	2.62
招商证券	775,710,724.02	20.14
申银万国	831,935,530.99	21.60
国泰君安	285,462,715.52	7.41
中金公司	257,775,420.66	6.69
中信万通证券	213,562,098.53	5.54
中银国际	489,323,006.98	12.70
光大证券	140,819,034.40	3.66
齐鲁证券	401,883,349.01	10.44

单位：人民币元

证券公司名称	债券投资成交金额	占本期债券成交总额的比例%
中信证券	15,037,200.70	11.72
中信建投证券	0.00	0.00
招商证券	44,333.79	0.03
申银万国	26,272,685.75	20.47
国泰君安	0.00	0.00
中金公司	0.00	0.00
中信万通证券	0.00	0.00
中银国际	21,816,569.10	17.00
光大证券	1,771,192.40	1.38
齐鲁证券	63,406,750.72	49.40

单位：人民币元

证券公司名称	回购交易成交金额	占本期回购成交总额的比例%
中信证券	160,000,000.00	6.32
中信建投证券	0.00	0.00
招商证券	1,206,300,000.00	47.63
申银万国	317,100,000.00	12.52
国泰君安	279,000,000.00	11.02
中金公司	335,100,000.00	13.23
中信万通证券	80,000,000.00	3.16
中银国际	0.00	0.00
光大证券	0.00	0.00
齐鲁证券	155,000,000.00	6.12

单位：人民币元

证券公司名称	佣金	占本期佣金总量的比例%
中信证券	298,113.01	9.22
中信建投证券	82,096.77	2.54
招商证券	650,503.91	20.11
申银万国	707,143.66	21.86
国泰君安	242,638.43	7.50
中金公司	219,108.71	6.77
中信万通证券	175,846.87	5.44
中银国际	397,578.23	12.29
光大证券	119,696.87	3.70
齐鲁证券	341,601.25	10.57

证券公司名称	席位租用数量(个)
中信证券	2
中信建投证券	2
中信万通证券	2
招商证券	2
国泰君安	1
中金公司	1
申银万国	1
中银国际	1
光大证券	1
齐鲁证券	1

本报告期内未新增租用或退租的证券公司席位。

（九）其他重要事项

除上述事项之外，已在临时报告中披露过本报告期内发生的其他重要事项如下：

事项名称	信息披露报纸	披露日期
关于中信基金参与国泰君安证券网上交易费率优惠活动的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2008年1月19日
中信经典配置证券投资基金2007年第4季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2008年1月22日
中信经典配置证券投资基金2007年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2008年3月29日
中信经典配置证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2008年4月12日
中信经典配置证券投资基金2008年第1季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2008年4月22日

中信基金管理有限责任公司
2008年8月28日