

国泰金龙行业精选证券投资基金
2016 年半年度报告摘要
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

1 重要提示

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金龙行业混合
基金主代码	020003
交易代码	020003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 12 月 5 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,976,816,322.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	有效把握我国行业的发展趋势，精心选择具有良好行业背景的成长性企业，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取定量分析与定性分析相结合的方式，通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险；通过行业精选，确定拟投资的优势行业及相应比例；通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均，债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。 基金整体业绩比较基准=75%×[上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均]+25%×[上证国债指数]。
风险收益特征	承担中等风险，获取相对超额回报。

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		国泰基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李永梅	廖原
	联系电话	021-31081600转	021-61618888
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95528
传真		021-31081800	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
----------------------	---

基金半年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层
-------------	--------------------------------------

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	73,948,553.77
本期利润	158,142,744.00
加权平均基金份额本期利润	0.0848
本期基金份额净值增长率	2.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0652
期末基金资产净值	1,978,042,245.65
期末基金份额净值	0.664

注：（1）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。

（2）所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.79%	1.30%	1.31%	0.85%	1.48%	0.45%
过去三个月	10.85%	1.49%	-0.95%	0.90%	11.80%	0.59%
过去六个月	2.88%	2.23%	-12.18%	1.52%	15.06%	0.71%
过去一年	20.67%	2.58%	-21.65%	1.75%	42.32%	0.83%
过去三年	113.96%	1.16%	43.38%	1.35%	70.58%	-0.19%
自基金合同生效起至今	730.64%	1.74%	121.86%	1.30%	608.78%	0.44%

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

国泰金龙行业精选证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2003 年 12 月 5 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 62 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典混合型证券投资

基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来，自 2016 年 7 月 1 日起转型为国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF））。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨飞	本基金的基金经理、国泰估值优势混合（LOF）（原国泰估值优势股票（LOF））、国泰中小盘成长混合（LOF）（原国泰中小盘成长股票（LOF））、国泰大健康股票、国泰金马稳健混合的基金经理	2014-10-21	-	8 年	硕士研究生。2008 年 7 月至 2009 年 8 月在诺德基金管理有限公司任助理研究员，2009 年 9 月至 2011 年 2 月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011 年 2 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（原国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015 年 5 月起兼任国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（原国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）），2015 年 5 月至 2016 年 5 月任国泰成长优选混合型证券投资基金（原国泰成长优选股票型证券投资基金）的基金经理，2016 年 2 月起兼任国泰大健康股票型证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组

保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年在宏观经济增速放缓、货币政策中性、风险偏好下降的背景下，A 股市场出现了大幅震荡。2016 年 1 月在人民币大幅贬值、整体估值偏高、熔断机制的催化下，A 股出现了大幅调整，随着风险偏好企稳、高估值消化以及熔断机制中止后，A 股市场出现了反弹，但 A 股表现的是存量市场的机构性投资机会，景气度持续向上且估值合理的优质成长股表现出明显的绝对收益与超额收

益。

今年年初我们判断整年经济 L 型的背景下，传统行业很难再有趋势性的投资机会，虽然期间周期性行业在供给侧改革的催化下有短暂的表现，但从上半年来看还是代表新兴行业的成长股以及稳定预期的消费股有明显的超额收益以及绝对收益。随着上半年电子、食品饮料等行业走出非常明显的超额收益后，下半年的结构性行情可能会再次分化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2016 年上半年的净值增长率为 2.88%，同期业绩比较基准为-12.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，除了依旧看好与新能源汽车、智能汽车、智能手机相关的电子产业链外，基金会加大配置高景气度的光通信行业，估值合理、预期偏低的医药行业与环保行业也将是基金重点配置的方向。从投资方向看，医药行业比较偏向医药商业、医用消费品领域；环保领域比较偏重环评以及污泥处理等子领域。

下半年市场在经济平稳增长、货币政策中性的背景下，我们判断依然只有结构性的投资机会，市场的波动依旧是比较大的，因此基金下半年将继续保持中性的仓位灵活操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，金龙行业基金期末可供分配利润为 194,200,117.14 元，可供分配的份额利润为 0.0652 元。本基金管理人根据本基金基金合同和相关法律法规的规定已于 2016 年 1 月 19 日进行第一次利润分配，每 10 份基金份额派发红利 1.10 元；于 2016 年 2 月 23 日进行第二次利润分配，每 10 份基金份额发红利 1.18 元。

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的

利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰金龙行业精选证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰金龙行业精选证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了二次利润分配，分配金额为 233,828,301.91 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国泰基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰金龙行业精选证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

资产：	-	-
银行存款	291,676,138.86	10,296,782.74
结算备付金	6,846,714.40	1,929,643.82
存出保证金	960,437.02	415,007.24
交易性金融资产	1,809,964,496.03	476,637,963.34
其中：股票投资	1,341,950,776.03	363,516,105.74
基金投资	-	-
债券投资	468,013,720.00	113,121,857.60
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	6,445,273.70
应收利息	4,522,749.53	2,761,599.03
应收股利	-	-
应收申购款	20,705,693.08	4,744,667.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,134,676,228.92	503,230,937.42
负债和所有者权益	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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	1,748,322.45	4,104,216.70
应付赎回款	148,703,454.04	10,914,486.75
应付管理人报酬	2,388,630.17	582,255.20
应付托管费	398,105.02	97,042.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,056,971.45	983,346.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	338,500.14	124,832.48
负债合计	156,633,983.27	16,806,179.88
所有者权益：	-	-
实收基金	959,394,513.72	172,458,736.92
未分配利润	1,018,647,731.93	313,966,020.62
所有者权益合计	1,978,042,245.65	486,424,757.54
负债和所有者权益总计	2,134,676,228.92	503,230,937.42

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.664 元，基金份额总额 2,976,816,322.18 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰金龙行业精选证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	174,679,548.18	136,786,077.44
1.利息收入	4,306,856.45	1,559,445.88
其中：存款利息收入	1,080,838.17	136,690.87
债券利息收入	3,226,018.28	1,422,755.01
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	85,018,076.49	167,855,036.55
其中：股票投资收益	80,178,268.56	166,277,108.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-332,636.03	525,717.31
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,172,443.96	1,052,211.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	84,194,190.23	-32,753,797.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,160,425.01	125,392.88
减：二、费用	16,536,804.18	7,168,518.25
1. 管理人报酬	8,547,993.78	2,604,155.93
2. 托管费	1,424,665.65	434,025.98
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,497,108.94	3,681,206.10
5. 利息支出	-	383,994.62
其中：卖出回购金融资产支出	-	383,994.62
6. 其他费用	67,035.81	65,135.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	158,142,744.00	129,617,559.19
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	158,142,744.00	129,617,559.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金龙行业精选证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	172,458,736.92	313,966,020.62	486,424,757.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	158,142,744.00	158,142,744.00
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）	786,935,776.80	780,367,269.22	1,567,303,046.02
其中：1.基金申购款	2,000,894,760.43	1,926,366,352.02	3,927,261,112.45
2.基金赎回款	-1,213,958,983.63	-1,145,999,082.80	-2,359,958,066.43
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）	-	-233,828,301.91	-233,828,301.91
五、期末所有者权益（基金净值）	959,394,513.72	1,018,647,731.93	1,978,042,245.65
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	172,113,675.00	111,349,574.74	283,463,249.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,617,559.19	129,617,559.19
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）	-12,615,049.65	-510,516.42	-13,125,566.07
其中：1.基金申购款	172,347,119.31	252,853,919.30	425,201,038.61
2.基金赎回款	-184,962,168.96	-253,364,435.72	-438,326,604.68
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）	-	-16,578,482.83	-16,578,482.83
五、期末所有者权益（基金净值）	159,498,625.35	223,878,134.68	383,376,760.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：李辉，会计机构负责人：倪莹

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰金龙系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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[2003]第 114 号《关于同意国泰金龙系列证券投资基金设立的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《国泰金龙系列证券投资基金基金契约》(后更名为《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 12 月 5 日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设两个子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金(以下简称“本基金”)和国泰金龙债券证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,570,221,715.39 元，其中包括本基金人民币 684,100,738.03 元和国泰金龙债券证券投资基金人民币 1,886,120,977.36 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 174 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《国泰金龙系列证券投资基金招募说明书》和《关于国泰金龙行业精选证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 3 月 10 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:3.103139324，并于 2008 年 3 月 11 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。投资组合中股票投资比例不高于 75%，债券投资比例不低于 20%，其余为现金。本基金的投资重点是预期具有良好发展态势的优势行业中的成长性上市公司，这部分投资比例不低于股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：75%×上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均+25%×上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2016 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金

信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰金龙行业精选证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息

红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,547,993.78	2,604,155.93
其中：支付销售机构的客户维护费	1,757,355.84	537,933.03

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	1,424,665.65	434,025.98
----------------	--------------	------------

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	291,676,138.86	1,032,826.75	56,536,552.18	114,147.91

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金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中属于第一层次的余额为 1,341,950,776.03 元，属于第二层次的余额为 468,013,720.00 元，无第三层次(2015 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 355,876,495.16 元，属于第二层次的余额为 120,761,468.18 元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：未持有)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	1,341,950,776.03	62.86
	其中：股票	1,341,950,776.03	62.86
2	固定收益投资	468,013,720.00	21.92
	其中：债券	468,013,720.00	21.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	298,522,853.26	13.98
7	其他各项资产	26,188,879.63	1.23
8	合计	2,134,676,228.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采矿业	-	-
C	制造业	1,179,669,085.63	59.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,370,691.00	1.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,138,963.00	0.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	76,597,807.28	3.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	49,174,229.12	2.49
S	综合	-	-
	合计	1,341,950,776.03	67.84

7.3 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	002635	安洁科技	5,122,471	196,600,436.98	9.94
2	002179	中航光电	4,323,024	187,273,399.68	9.47
3	300207	欣旺达	6,600,242	169,428,212.14	8.57
4	300145	中金环境	7,510,138	164,321,819.44	8.31
5	300219	鸿利光电	6,512,507	101,464,859.06	5.13
6	300389	艾比森	2,974,537	73,084,374.09	3.69
7	300296	利亚德	1,883,804	59,641,234.64	3.02
8	300336	新文化	1,968,544	49,174,229.12	2.49
9	002400	省广股份	3,205,140	45,288,628.20	2.29
10	002138	顺络电子	2,267,860	41,116,301.80	2.08

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300207	欣旺达	239,580,783.38	49.25
2	002635	安洁科技	184,581,403.60	37.95
3	002179	中航光电	170,801,448.52	35.11
4	002138	顺络电子	155,205,281.61	31.91
5	300145	中金环境	133,915,235.90	27.53
6	300296	利亚德	125,496,943.13	25.80
7	300389	艾比森	107,800,527.32	22.16
8	300219	鸿利智汇	95,665,753.62	19.67
9	601012	隆基股份	91,874,951.30	18.89
10	300232	洲明科技	82,997,591.68	17.06
11	002048	宁波华翔	77,308,065.91	15.89
12	601199	江南水务	75,695,742.29	15.56
13	600054	黄山旅游	71,771,924.73	14.75
14	300269	联建光电	68,465,895.59	14.08
15	300336	新文化	46,894,965.08	9.64
16	002400	省广股份	44,212,607.23	9.09
17	600525	长园集团	40,638,476.55	8.35
18	002705	新宝股份	40,058,755.73	8.24
19	002479	富春环保	39,537,674.33	8.13
20	000858	五 粮 液	37,544,682.79	7.72
21	002108	沧州明珠	37,485,998.37	7.71
22	002298	中电鑫龙	36,988,528.55	7.60
23	002557	洽洽食品	33,870,799.43	6.96
24	000601	韶能股份	32,380,576.05	6.66
25	300274	阳光电源	29,624,682.89	6.09
26	002111	威海广泰	29,538,711.13	6.07
27	600563	法拉电子	28,981,319.69	5.96
28	600885	宏发股份	28,215,625.70	5.80
29	000418	小天鹅 A	26,643,596.75	5.48
30	600597	光明乳业	24,509,922.91	5.04
31	000333	美的集团	24,303,477.22	5.00
32	002169	智光电气	21,609,909.19	4.44
33	300198	纳川股份	21,110,371.10	4.34
34	300071	华谊嘉信	20,347,689.80	4.18

35	000568	泸州老窖	20,298,769.02	4.17
36	300476	胜宏科技	20,202,740.46	4.15
37	600518	康美药业	18,992,951.27	3.90
38	600887	伊利股份	18,681,724.00	3.84
39	002311	海大集团	18,206,065.89	3.74
40	002035	华帝股份	17,702,535.64	3.64
41	300083	劲胜精密	15,279,335.65	3.14
42	300063	天龙集团	15,005,459.48	3.08
43	002518	科士达	11,913,865.76	2.45
44	002090	金智科技	11,437,159.40	2.35
45	600285	羚锐制药	11,301,423.50	2.32
46	002131	利欧股份	10,780,987.00	2.22
47	000541	佛山照明	10,092,233.68	2.07
48	002032	苏泊尔	9,964,581.17	2.05
49	600750	江中药业	9,811,543.77	2.02
50	002271	东方雨虹	9,775,390.54	2.01

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。

7.4.2 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	300296	利亚德	160,280,318.55	32.95
2	002138	顺络电子	135,922,479.59	27.94
3	300232	洲明科技	120,503,845.86	24.77
4	601012	隆基股份	98,141,165.67	20.18
5	300389	艾比森	98,094,673.38	20.17
6	002635	安洁科技	94,513,358.17	19.43
7	300269	联建光电	90,501,982.13	18.61
8	600054	黄山旅游	71,433,977.47	14.69
9	300207	欣旺达	70,239,964.45	14.44
10	601199	江南水务	65,905,272.13	13.55
11	300376	易事特	47,069,920.79	9.68
12	002048	宁波华翔	46,755,566.19	9.61
13	300083	劲胜精密	42,832,296.78	8.81
14	002108	沧州明珠	42,002,492.64	8.63
15	600525	长园集团	38,224,325.97	7.86
16	002479	富春环保	36,746,527.14	7.55
17	002705	新宝股份	36,282,492.89	7.46
18	002557	洽洽食品	32,587,294.52	6.70
19	002104	恒宝股份	31,991,926.48	6.58

20	002298	中电鑫龙	29,832,474.02	6.13
21	600563	法拉电子	29,540,916.15	6.07
22	002111	威海广泰	29,520,106.56	6.07
23	300274	阳光电源	29,020,121.53	5.97
24	600597	光明乳业	24,952,479.86	5.13
25	300145	中金环境	22,553,313.27	4.64
26	300198	纳川股份	20,692,666.28	4.25
27	300476	胜宏科技	19,986,100.60	4.11
28	002035	华帝股份	19,284,663.31	3.96
29	600518	康美药业	18,805,571.71	3.87
30	002169	智光电气	18,315,921.73	3.77
31	600887	伊利股份	18,254,262.80	3.75
32	002311	海大集团	17,027,878.05	3.50
33	000858	五 粮 液	16,935,395.94	3.48
34	000418	小天鹅 A	16,461,055.70	3.38
35	600285	羚锐制药	10,638,544.88	2.19
36	002090	金智科技	10,635,017.66	2.19
37	300071	华谊嘉信	10,593,426.59	2.18
38	600750	江中药业	10,589,020.38	2.18
39	002518	科士达	10,315,780.65	2.12
40	000541	佛山照明	10,212,169.13	2.10

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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	2,676,602,794.80
卖出股票的收入（成交）总额	1,863,183,793.42

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。

7.5 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	432,613,720.00	21.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,400,000.00	1.79

	其中：政策性金融债	35,400,000.00	1.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	468,013,720.00	23.66

7.6 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(%)
1	019539	16 国债 11	1,000,000	99,940,000.00	5.05
2	160005	16 附息国债 05	900,000	89,946,000.00	4.55
3	160011	16 附息国债 11	700,000	69,958,000.00	3.54
4	160001	16 附息国债 01	600,000	60,006,000.00	3.03
5	019533	16 国债 05	500,000	49,970,000.00	2.53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	960,437.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,522,749.53
5	应收申购款	20,705,693.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,188,879.63

7.12.4 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可转换债券。

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
162,882	18,275.91	865,497,681.05	29.07%	2,111,318,641.13	70.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,377,886.00	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003 年 12 月 5 日）基金份额总额	684,348,868.87
本报告期期初基金份额总额	535,134,528.25
本报告期基金总申购份额	6,208,800,011.65
减：本报告期基金总赎回份额	3,767,118,217.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,976,816,322.18

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，聘任李永梅女士担任公司督察长；

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理，且不再代为履行督察长职务；

2016 年 6 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过，张峰先生不再担任本基金管理人总经理，由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务。

2016 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理，公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

2016 年 1 月起，本基金托管人专门基金托管部门进行了组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 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、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
上海证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	2,348,975,677.54	51.74%	2,187,603.58	51.74%	-
中信建投	1	1,336,018,758.61	29.43%	1,244,236.95	29.43%	-
中投证券	1	854,655,522.17	18.83%	795,942.48	18.83%	-

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：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	118,892,040. 50	100.00%	-	-	-	-