

# 国泰金龙系列证券投资基金

## 2012 年半年度报告摘要

（国泰金龙系列证券投资基金由国泰金龙债券证券投资基金  
和国泰金龙行业精选证券投资基金组成）

**2012 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：二〇一二年八月二十七日

# 国泰金龙债券证券投资基金 2012 年半年度报告摘要

## 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 2012 年 8 月 22 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 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                 |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金简称            | 国泰金龙债券            |                 |
| 基金主代码           | 020002            |                 |
| 交易代码            | 020002            |                 |
| 系列基金名称          | 国泰金龙系列证券投资基金      |                 |
| 系列其他子基金名称       | 国泰金龙行业混合(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      | 2,750,706,589.84份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰金龙债券A           | 国泰金龙债券C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 020002            | 020012          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,797,722,252.97份 | 952,984,336.87份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                               |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。                                                                                                                                |
| 投资策略   | 以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。在对拟公开发行股票的公司进行充分研究的基础上，择机参与拟公开发行股票申购。因申购所持有的股票资产自可上市交易之日起在180个自然日内卖出；因可转债转股所持有的股票资产自可上市交易之日起在180个自然日内卖出。 |
| 业绩比较基准 | 本基金以中信全债指数收益率作为衡量基金业绩的比较基准。                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金属于收益稳定、风险较低的品种。                                                                                                                                                            |

## 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   | 李峰                              | 周倩芝                |
|         | 联系电话 | 021-38561600 转                  | 021-61618888       |
|         | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com            | zhouqz@spdb.com.cn |
| 客户服务电话  |      | (021) 38569000,<br>400-888-8688 | 021-61618888       |
| 传真      |      | 021-38561800                    | 021-63602540       |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                                           |
|----------------------|-----------------------------------------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼                                |

## 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日） |                |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
|               | 国泰金龙债券 A                             | 国泰金龙债券 C       |
| 本期已实现收益       | 31,114,531.67                        | 7,283,175.28   |
| 本期利润          | 84,535,345.59                        | 19,748,276.06  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0714                               | 0.0664         |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.97%                                | 7.22%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日)                |                |
|               | 国泰金龙债券 A                             | 国泰金龙债券 C       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0234                               | 0.0204         |
| 期末基金资产净值      | 1,875,513,435.91                     | 991,137,329.84 |
| 期末基金份额净值      | 1.043                                | 1.040          |

注：(1)经中国证监会批准，国泰金龙债券基金于 2008 年 6 月 3 日刊登公告，自 2008 年 6 月 5 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式。

(2)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。

(3)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

##### 国泰金龙债券 A

| 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      | 0.77%    | 0.07%       | 0.37%      | 0.04%         | 0.40%  | 0.03% |
| 过去三个月      | 3.88%    | 0.07%       | 1.98%      | 0.04%         | 1.90%  | 0.03% |
| 过去六个月      | 6.97%    | 0.07%       | 2.88%      | 0.04%         | 4.09%  | 0.03% |
| 过去一年       | 0.38%    | 0.34%       | 5.38%      | 0.06%         | -5.00% | 0.28% |
| 过去三年       | 12.91%   | 0.30%       | 8.75%      | 0.06%         | 4.16%  | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 56.44%   | 0.24%       | 34.18%     | 0.08%         | 22.26% | 0.16% |

##### 国泰金龙债券 C

| 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      | 0.78%    | 0.07%       | 0.37%      | 0.04%         | 0.41%  | 0.03% |
| 过去三个月      | 3.79%    | 0.07%       | 1.98%      | 0.04%         | 1.81%  | 0.03% |
| 过去六个月      | 7.22%    | 0.07%       | 2.88%      | 0.04%         | 4.34%  | 0.03% |
| 过去一年       | 0.39%    | 0.34%       | 5.38%      | 0.06%         | -4.99% | 0.28% |
| 过去三年       | 11.89%   | 0.30%       | 8.75%      | 0.06%         | 3.14%  | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.43%   | 0.24%       | 34.18%     | 0.08%         | 20.25% | 0.16% |

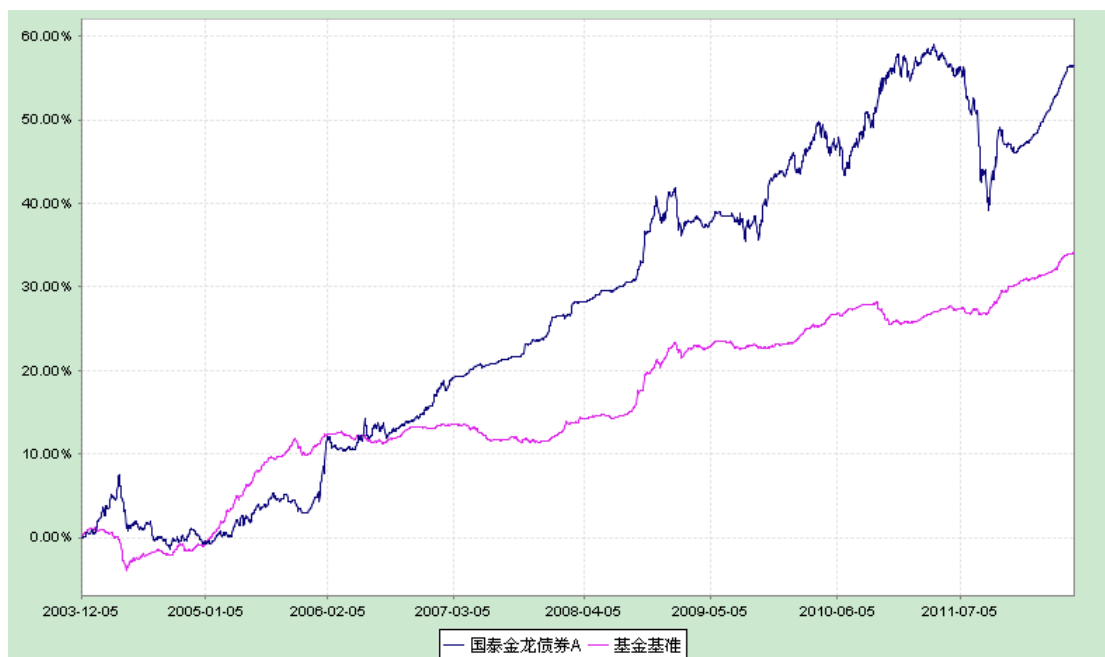
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 国泰金龙债券证券投资基金

自基金合同生效以来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

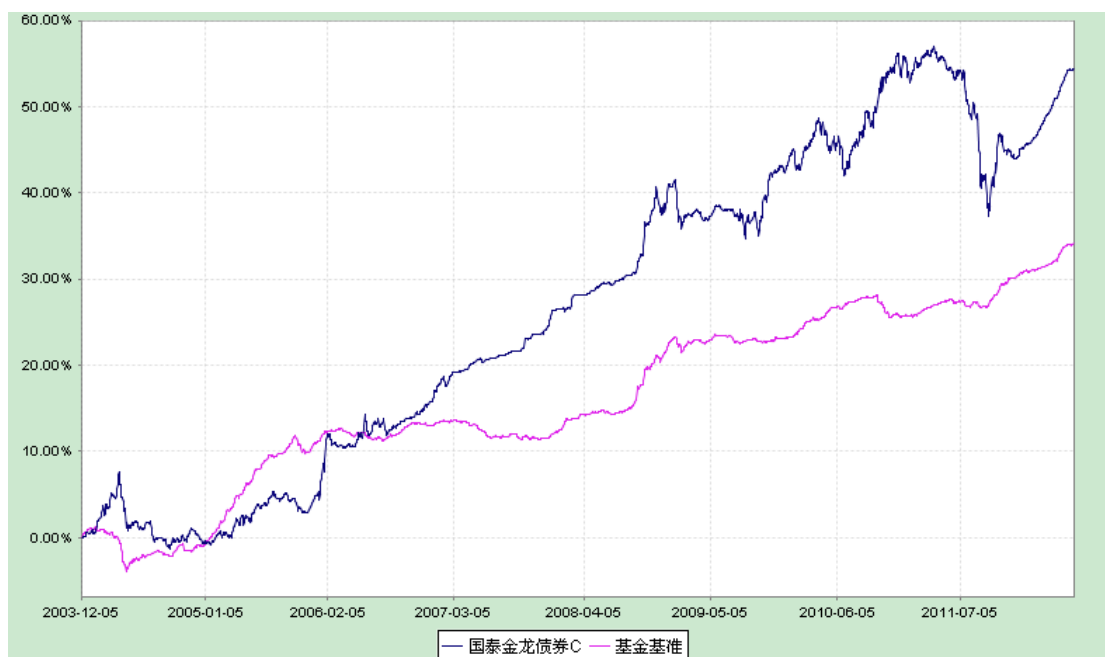
(2003 年 12 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日)

##### 国泰金龙债券 A



注：本基金的合同生效日为 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。

#### 国泰金龙债券 C



注：本基金的合同生效日为 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 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 23 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、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、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（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、国泰价值经典股票型证券投资基金（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、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（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 | 证券 | 说明 |
|----|----|-----------|----|----|
|----|----|-----------|----|----|

|    |                          | (助理) 期限    |      | 从业<br>年限 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----|--------------------------|------------|------|----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                          | 任职日期       | 离任日期 |          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 吴晨 | 本基金的基金经理、国泰信用互利分级债券的基金经理 | 2010-04-29 | -    | 10       | 硕士研究生，CFA，FRM。2001 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004 年 9 月至 2005 年 10 月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005 年 10 月至 2008 年 3 月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008 年 4 月至 2009 年 3 月在长信基金管理有限公司从事债券研究；2009 年 4 月至 2010 年 3 月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010 年 4 月起担任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理；2010 年 9 月至 2011 年 11 月担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2011 年 12 月起任国泰信用互利分级债券型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，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年受欧债危机影响，全球经济增速普遍放缓，金融市场大幅动荡，大宗商品价格持续下跌。我国宏观经济增长持续回落，汇丰 PMI 指数连续低于 50 的荣枯线。受食品价格下跌以及翘尾因素影响，CPI 指数持续显著回落，5 月 CPI 同比涨幅仅为 3%，为近一年多以来最低水平。货币政策有所放松，连续两次下调存款准备金率，6 月更是首次降息，但总体而言政策放松幅度低于市场预期。同时受贷存比影响，银行新增贷款额度并没有显著提升，实体经济资金环境仍然偏紧。上半年股票市场在对政策放松的预期以及经济持续下滑的现状中进行博弈，总体呈现震荡整理态势。债券市场全线上涨，利率产品和高等级信用债 1-4 月震荡整理，在 5 月中下旬开始外围欧债危机深化、国内货币政策进一步放松刺激迎来一波强劲上涨，但中低等级信用债表现更为突出，收益率持续下行，AA 级短融收益率下行超过 200 个 bp，信用利差大幅收敛。转债市场迎来估值修复，表现较佳。

2012 年上半年本基金拉长组合久期，大幅度增加信用债投资比例，尤其是中等级信用债的配置力度，取得较好收益。上半年为了规避风险，本基金没有参与新股发行等任何偏权益类资产投资。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 在 2012 年上半年的净值增长率为 6.97%，同期业绩比较基准收益率为 2.88%。

国泰金龙债券 C 在 2012 年上半年的净值增长率为 7.22%，同期业绩比较基准收益率为 2.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济将继续探底，但随着 9-10 月年内第二个季节性开工旺季来临，PMI 等指标或有所反弹；信贷数据总体保持会保持稳定，但可能会延续 1-2 季度前两个月投放平稳，季度末最后一月大幅投放的态势。从海外来看，6 月末的欧盟峰会决议会奠定 7-8 月的全球风

险偏好情绪基调。预计三季度 CPI 继续下降并低位运行，7-8 月 CPI 可能回落至 2%左右，四季度 CPI 受基数以及全球央行释放流动性的影响会有所回升，不排除会有超预期情况的发生。下半年在“经济复苏不确定、通胀压力舒缓、外汇占款系统性下降”的背景下，预计央行会对资金市场倍加呵护，政策会继续放松，下调存准率和减息的趋势仍将继续。

下半年债券市场总体仍处在慢牛行情中，短期内大幅转向的概率较小，但继续大幅上涨空间已然有限。随着经济环比的逐步见底，预计股票市场下半年将震荡盘升。

下半年本基金将维持中性的组合久期，类属资产配置方面继续保持信用产品配置力度；权益类资产维持谨慎的投资策略，积极降低组合波动率，寻求基金净值的平稳增长。

#### 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，并制订了相关制度及流程。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副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、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

截止本报告期末，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。

### 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”）在对国泰金龙债券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合规守信、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，对国泰金龙债券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，未发现基金管理人损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

## 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：国泰金龙债券证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |                        |                          |
| 银行存款     | 5,658,334.14           | 10,890,625.05            |
| 结算备付金    | 29,249,833.15          | 2,075,913.66             |
| 存出保证金    | 250,000.00             | 250,000.00               |
| 交易性金融资产  | 3,314,497,076.59       | 758,818,391.90           |
| 其中：股票投资  | -                      | -                        |
| 基金投资     | -                      | -                        |
| 债券投资     | 3,314,497,076.59       | 758,818,391.90           |
| 资产支持证券投资 | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | -                      | 76,700,210.00            |
| 应收证券清算款  | 69,855,483.85          | -                        |
| 应收利息     | 59,553,154.08          | 16,667,578.72            |
| 应收股利     | -                      | -                        |

|                 |                               |                                 |
|-----------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 应收申购款           | 33,358,067.41                 | 88,588.70                       |
| 递延所得税资产         | -                             | -                               |
| 其他资产            | -                             | -                               |
| 资产总计            | 3,512,421,949.22              | 865,491,308.03                  |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b><br>2012 年 6 月 30 日 | <b>上年度末</b><br>2011 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       | 569,499,924.00                | -                               |
| 应付证券清算款         | 59,313,694.94                 | -                               |
| 应付赎回款           | 13,420,249.74                 | 163,126.02                      |
| 应付管理人报酬         | 1,398,888.00                  | 168,330.19                      |
| 应付托管费           | 466,295.99                    | 56,110.05                       |
| 应付销售服务费         | 232,488.74                    | 10,507.77                       |
| 应付交易费用          | 18,905.00                     | 11,465.73                       |
| 应交税费            | 804,614.48                    | 804,614.48                      |
| 应付利息            | 58,921.83                     | -                               |
| 应付利润            | -                             | -                               |
| 递延所得税负债         | -                             | -                               |
| 其他负债            | 557,200.75                    | 355,975.00                      |
| 负债合计            | 645,771,183.47                | 1,570,129.24                    |
| <b>所有者权益:</b>   |                               |                                 |
| 实收基金            | 2,750,706,589.84              | 886,914,724.90                  |
| 未分配利润           | 115,944,175.91                | -22,993,546.11                  |
| 所有者权益合计         | 2,866,650,765.75              | 863,921,178.79                  |
| 负债和所有者权益总计      | 3,512,421,949.22              | 865,491,308.03                  |

注: 报告截止日 2012 年 6 月 30 日, 下属 A 类基金的份额净值 1.043 元, 下属 C 类基金的份额净值 1.040 元; 基金份额总额 2,750,706,589.84 份, 下属 A 类基金的份额总额 1,797,722,252.97 份, 下属 C 类基金的份额总额 952,984,336.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 国泰金龙债券证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项 目 | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011<br>年 6 月 30 日 |
|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|

|                            |                       |                     |
|----------------------------|-----------------------|---------------------|
| <b>一、收入</b>                | <b>113,871,564.58</b> | <b>676,735.46</b>   |
| 1.利息收入                     | 45,790,137.89         | 3,637,095.78        |
| 其中：存款利息收入                  | 496,345.85            | 89,925.27           |
| 债券利息收入                     | 45,203,749.95         | 3,462,015.07        |
| 资产支持证券利息收入                 | -                     | -                   |
| 买入返售金融资产收入                 | 90,042.09             | 85,155.44           |
| 其他利息收入                     | -                     | -                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 2,019,033.49          | 5,421,035.82        |
| 其中：股票投资收益                  | -                     | 3,458,764.63        |
| 基金投资收益                     | -                     | -                   |
| 债券投资收益                     | 2,019,033.49          | 1,882,894.83        |
| 资产支持证券投资收益                 | -                     | -                   |
| 衍生工具收益                     | -                     | -                   |
| 股利收益                       | -                     | 79,376.36           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 65,885,914.70         | -8,455,830.44       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                     | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 176,478.50            | 74,434.30           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>9,587,942.93</b>   | <b>1,451,080.13</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 4,376,394.09          | 641,829.91          |
| 2. 托管费                     | 1,458,797.93          | 213,943.38          |
| 3. 销售服务费                   | 432,053.13            | 71,164.62           |
| 4. 交易费用                    | 33,843.18             | 44,717.75           |
| 5. 利息支出                    | 3,140,455.60          | 362,883.92          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 3,140,455.60          | 362,883.92          |
| 6. 其他费用                    | 146,399.00            | 116,540.55          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>104,283,621.65</b> | <b>-774,344.67</b>  |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>104,283,621.65</b> | <b>-774,344.67</b>  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金龙债券证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 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） | 886,914,724.90                        | -22,993,546.11 | 863,921,178.79 |
| 二、本期经营活动产生的     | -                                     | 104,283,621.65 | 104,283,621.65 |

|                                        |                                            |                |                  |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|------------------|
| 基金净值变动数（本期利润）                          |                                            |                |                  |
| 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）      | 1,863,791,864.94                           | 34,654,100.37  | 1,898,445,965.31 |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,472,259,519.91                           | 38,992,174.80  | 2,511,251,694.71 |
| 2.基金赎回款                                | -608,467,654.97                            | -4,338,074.43  | -612,805,729.40  |
| 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） | -                                          | -              | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,750,706,589.84                           | 115,944,175.91 | 2,866,650,765.75 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 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）                        | 195,479,077.77                             | 18,336,046.50  | 213,815,124.27   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -774,344.67    | -774,344.67      |
| 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）      | -6,054,573.99                              | -596,932.98    | -6,651,506.97    |
| 其中：1.基金申购款                             | 176,176,502.77                             | 8,746,790.64   | 184,923,293.41   |
| 2.基金赎回款                                | -182,231,076.76                            | -9,343,723.62  | -191,574,800.38  |
| 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） | -                                          | -9,662,613.52  | -9,662,613.52    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 189,424,503.78                             | 7,302,155.33   | 196,726,659.11   |

报告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：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

#### 6.4.2 差错更正的说明

无。

#### 6.4.3 关联方关系

##### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期和本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.3.2 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             |
|------------------------|---------------------|
| 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、基金代销机构        |
| 中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)   | 基金管理人的控股股东          |
| 宏源证券股份有限公司(“宏源证券”)     | 基金代销机构、受中国建投控制的公司   |

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。

#### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.4.2 关联方报酬

###### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,376,394.09               | 641,829.91                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 108,836.07                 | 47,213.06                       |

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 0.6% 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 × 0.6% / 当年天数。

###### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,458,797.93               | 213,943.38                      |

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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

#### 6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日      |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 国泰金龙债券 A                        | 国泰金龙债券 C   | 合计         |
| 浦发银行           | -                               | 1,552.22   | 1,552.22   |
| 国泰基金管理有限公司     | -                               | 247,973.06 | 247,973.06 |
| 合计             | -                               | 249,525.28 | 249,525.28 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 国泰金龙债券 A                        | 国泰金龙债券 C   | 合计         |
| 浦发银行           | -                               | 1,802.34   | 1,802.34   |
| 国泰基金管理有限公司     | -                               | 9,274.75   | 9,274.75   |
| 合计             | -                               | 11,077.09  | 11,077.09  |

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |         | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |         |
|-------------------|----------------------------|---------|---------------------------------|---------|
|                   | 国泰金龙债券A                    | 国泰金龙债券C | 国泰金龙债券A                         | 国泰金龙债券C |
| 期初持有的基金份额         | 16,391,532.91              | -       | 15,638,937.28                   | -       |
| 期间申购/买入总份额        | -                          | -       | 752,595.63                      | -       |
| 期间因拆分变动份额         | -                          | -       | -                               | -       |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                          | -       | -                               | -       |
| 期末持有的基金份额         | 16,391,532.91              | -       | 16,391,532.91                   | -       |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.91%                      | -       | 11.23%                          | -       |

##### 6.4.4.4.2 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

**国泰金龙债券 A**

无。

**国泰金龙债券 C**

份额单位：份

| 关联方名称 | 国泰金龙债券C本期末<br>2012年6月30日 |                      | 国泰金龙债券C上年度末<br>2011年12月31日 |                      |
|-------|--------------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|
|       | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额占<br>基金总份额的比例 | 持有的<br>基金份额                | 持有的基金份额占<br>基金总份额的比例 |
| 中国建投  | -                        | -                    | 206,185,567.01             | 85.32%               |

**6.4.4.5 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<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011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  | 5,658,334.14               | 317,886.85 | 979,579.43                      | 65,846.34 |

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。

**6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

| 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日      |         |         |        |                |               |
|--------------------------------------------|---------|---------|--------|----------------|---------------|
| 关联方名称                                      | 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：<br>股/张） | 总金额           |
| 宏源证券                                       | 1280036 | 12临安城建债 | 新债网下发行 | 300,000        | 30,000,000.00 |
| 宏源证券                                       | 1280056 | 12海城投债  | 新债网下发行 | 200,000        | 20,000,000.00 |
| 宏源证券                                       | 112057  | 11东磁债   | 新债网下发行 | 150,000        | 15,000,000.00 |
| 宏源证券                                       | 1280097 | 12河套水务债 | 新债网下发行 | 100,000        | 10,000,000.00 |
| 宏源证券                                       | 1280045 | 12金坛债   | 新债网下发行 | 300,000        | 30,000,000.00 |
| 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |         |         |        |                |               |
| 关联方名称                                      | 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：<br>股/张） | 总金额           |
| -                                          | -       | -       | -      | -              | -             |

**6.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.5 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

#### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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 569,499,924.00 元,于 2012 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的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。

#### 6.4.6 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) 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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,063,415,476.59 元,属于第二层级的余额为 2,251,081,600.00 元,无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 197,740,135.30 元,第二层级 561,078,256.60 元,无第三层级)。

##### (iii) 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和债券，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，本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -                |
|    | 其中：股票             | -                | -                |
| 2  | 固定收益投资            | 3,314,497,076.59 | 94.37            |
|    | 其中：债券             | 3,314,497,076.59 | 94.37            |
|    | 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      | 34,908,167.29    | 0.99             |
| 6  | 其他各项资产            | 163,016,705.34   | 4.64             |
| 7  | 合计                | 3,512,421,949.22 | 100.00           |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内没有进行股票交易。

#### 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      | 147,392,200.00   | 5.14         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | -                | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 1,340,811,076.59 | 46.77        |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,826,293,800.00 | 63.71        |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债       | -                | -            |
| 8  | 其他        | -                | -            |
| 9  | 合计        | 3,314,497,076.59 | 115.62       |

#### 7.6 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  | 041261016 | 12 浙商集 CP001  | 1,000,000 | 101,290,000.00 | 3.53         |
| 2  | 041259018 | 12 南高轮 CP001  | 800,000   | 81,336,000.00  | 2.84         |
| 3  | 019201    | 12 国债 01      | 750,000   | 75,255,000.00  | 2.63         |
| 4  | 041164014 | 11 博源 CP002   | 700,000   | 71,561,000.00  | 2.50         |
| 5  | 041260018 | 12 厦门轻工 CP001 | 700,000   | 71,008,000.00  | 2.48         |

#### 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

### 7.9.3 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   | 250,000.00     |
| 2  | 应收证券清算款 | 69,855,483.85  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 59,553,154.08  |
| 5  | 应收申购款   | 33,358,067.41  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 163,016,705.34 |

### 7.9.4 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。

### 7.9.5 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的情况。

## 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

| 份额<br>级别 | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 国泰金龙债    | 9,766            | 184,079.69    | 1,627,264,235.52 | 90.52%     | 170,458,017.45 | 9.48%      |

|          |        |            |                  |        |                |        |
|----------|--------|------------|------------------|--------|----------------|--------|
| 券 A      |        |            |                  |        |                |        |
| 国泰金龙债券 C | 4,491  | 212,198.69 | 780,745,165.72   | 81.93% | 172,239,171.15 | 18.07% |
| 合计       | 14,257 | 192,937.27 | 2,408,009,401.24 | 87.54% | 342,697,188.60 | 12.46% |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                | 份额级别     | 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基金 | 国泰金龙债券 A | 141,429.24 | 0.01%    |
|                   | 国泰金龙债券 C | 51,446.32  | 0.01%    |
|                   | 合计       | 192,875.56 | 0.01%    |

注：国泰金龙债券 A：

1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 0。

国泰金龙债券 C：

1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 国泰金龙债券 A         | 国泰金龙债券 C         |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2003 年 12 月 5 日)基金份额总额 | 1,887,374,602.86 | -                |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 645,264,060.05   | 241,650,664.85   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,369,719,471.20 | 1,102,540,048.71 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 217,261,278.28   | 391,206,376.69   |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 1,797,722,252.97 | 952,984,336.87   |

## 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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 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。

### 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 |    |
| 申银万国 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：基金租用席位的选择标准是：

(1) 资质雄厚，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。

### 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 |
| 申银万国 | 220,575,088.18 | 51.06%       | 21,223,800,000.00 | 84.89%       | -    | -            |
| 国泰君安 | 211,432,678.58 | 48.94%       | 3,778,093,000.00  | 15.11%       | -    | -            |

## 国泰金龙行业精选证券投资基金 2012 年半年度报告摘要

### 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 2012 年 8 月 22 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 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 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          |
| 系列基金名称     | 国泰金龙系列证券投资基金    |
| 系列其他子基金名称  | 国泰金龙债券(020002)  |
| 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 | 897,939,091.90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。<br>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                              | 李峰                   | 周倩芝                |
|         | 联系电话                            | 021-38561600 转       | 021-61618888       |
|         | 电子邮箱                            | xinxipilu@gtfund.com | zhouqz@spdb.com.cn |
| 客户服务电话  | (021) 38569000,<br>400-888-8688 |                      | 021-61618888       |
| 传真      | 021-38561800                    |                      | 021-63602540       |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                                           |
|----------------------|-----------------------------------------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼                                |

## 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -10,478,319.15                       |
| 本期利润          | -25,096,201.16                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0277                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -5.72%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0111                              |
| 期末基金资产净值      | 419,417,071.83                       |
| 期末基金份额净值      | 0.467                                |

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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

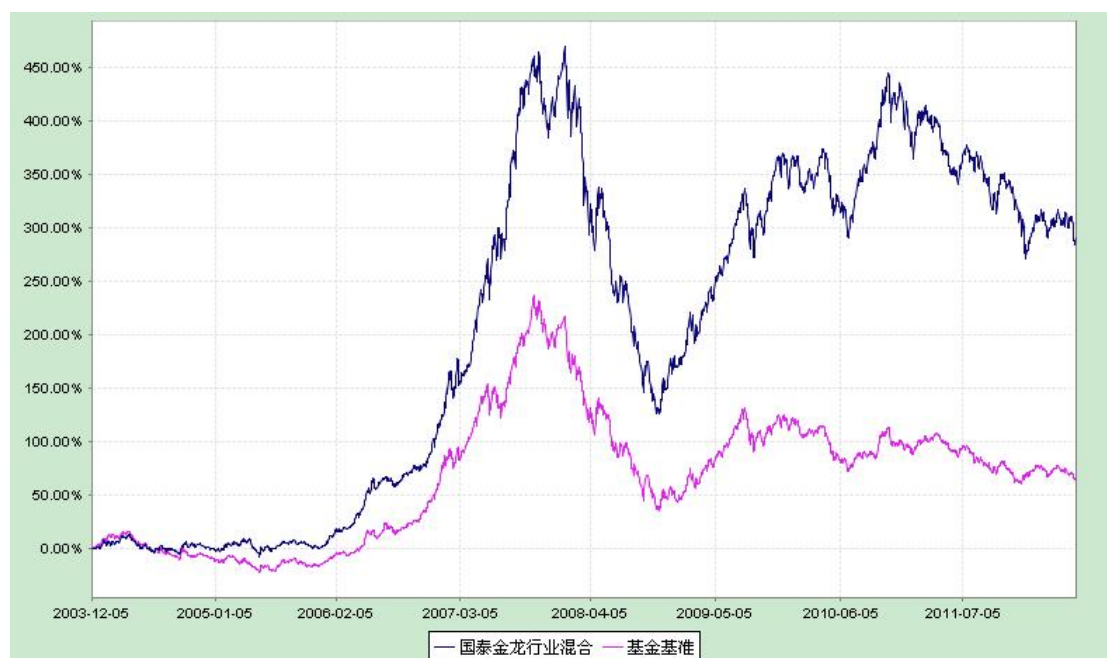
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去一个月      | -5.27%  | 1.20% | -4.61%  | 0.73% | -0.66%  | 0.47% |
| 过去三个月      | 0.00%   | 1.00% | -1.15%  | 0.71% | 1.15%   | 0.29% |
| 过去六个月      | -5.72%  | 1.14% | 1.19%   | 0.84% | -6.91%  | 0.30% |
| 过去一年       | -14.93% | 1.05% | -14.26% | 0.88% | -0.67%  | 0.17% |
| 过去三年       | 0.40%   | 1.15% | -19.66% | 1.05% | 20.06%  | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 291.29% | 1.37% | 65.82%  | 1.32% | 225.47% | 0.05% |

### 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

自基金合同生效以来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 2012 年 6 月 30 日)



注：本基金的合同生效日为 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 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 23 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、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、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（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、国泰价值经典股票型证券投资基金（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、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（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<br>(助理) 期限 |            | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                      |
|----|----------------------------|----------------------|------------|----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                            | 任职日期                 | 离任日期       |                |                                                                                                                                                                         |
| 王航 | 本基金的基金经理、国泰事件驱动股票、国泰金鑫封闭的基 | 2008-05-17           | 2012-01-19 | 11             | 硕士研究生，CFA，曾任职于南方证券有限公司；2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司；历任社保 111 组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金经理助理、国泰金马稳健混合的基金经理助理、国泰金牛创新股票的基金经理助理；2008 年 5 月至 2012 年 1 月任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理；2010 年 |

|     |                          |            |   |   |                                                                                                                                                                             |
|-----|--------------------------|------------|---|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 金经理                      |            |   |   | 4 月起兼任金鑫证券投资基金的基金经理；2011 年 8 月起兼任国泰事件驱动策略股票型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                    |
| 周广山 | 本基金的基金经理、国泰估值优势分级封闭的基金经理 | 2012-01-19 | - | 8 | 硕士研究生，长江商学院 MBA；2005 年 12 月至 2007 年 3 月在凯基证券大陆研究所任行业研究员；2007 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理；2011 年 4 月起任国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的基金经理；2012 年 1 月 19 日起兼任国泰金龙行业混合型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，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年，市场整体运行格局较为震荡。由于受到国内宏观调控政策放松预期的影响，在市场低估值的支持及部分利好政策的刺激下，国内 A 股市场反复出现了政策放松预期提高时上涨，政策预期落空后又回落的走势。分行业看，白酒、地产、建筑装饰、安防等行业涨幅较大；从风格上看，部分持续高速成长的中小盘股票上涨幅度较大，而以煤炭、水泥、有色金属为代表的周期类股票震荡幅度较大。

本基金在年初重点配置消费行业中的绩优成长股，并增加早周期行业房地产和汽车的配置，同时对部分有资源优势的有色企业也做了布局；从二季度开始，对涨幅较好的信息设备、医药公司减持，并提高采掘、地产行业配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2012 年上半年的净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准为 1.19%。

#### 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 2012 年下半年，GDP 增速将有望在三季度见底，CPI 回落较为确定，政府对经济调控空间将逐步放开。7~8 月份是上市公司中报披露的时间段，将是影响市场走势的关键点，而后续出台的有实质措施的经济刺激措施将是推动市场上涨的动力。经历连续下跌后，A 股市场具备良好成长性的上市公司已经纳入长期投资价值区域，可为我们提供较大的选择空间，同时把握政策放松带来的投资机会，适度配置周期行业，中长期关注人口老龄化催生的医疗保健行业和劳动生产率改善带来的机会，努力为基金持有人创建一个稳健、持续的投资回报。

#### 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，并制订了相关制度及流程。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副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、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

本基金已于 2012 年实施利润分配 3,234,600.48 元。

截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 -9,968,449.43 元，可供分配的份额利润为 -0.0111 元。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。

### 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一次利润分配，分配金额为 3,234,600.48 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产       | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：      |                        |                          |
| 银行存款      | 24,254,498.85          | 11,494,362.46            |
| 结算备付金     | 1,160,051.09           | 1,220,333.87             |
| 存出保证金     | 500,000.00             | 1,840,000.00             |
| 交易性金融资产   | 409,627,983.05         | 437,677,732.61           |
| 其中：股票投资   | 313,552,335.05         | 332,787,298.61           |
| 基金投资      | -                      | -                        |
| 债券投资      | 96,075,648.00          | 104,890,434.00           |
| 资产支持证券投资  | -                      | -                        |
| 衍生金融资产    | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产  | -                      | -                        |
| 应收证券清算款   | 5,852,912.63           | 3,803,422.86             |
| 应收利息      | 1,063,078.97           | 2,094,699.77             |
| 应收股利      | 36,000.00              | -                        |
| 应收申购款     | 271,184.22             | 181,664.72               |
| 递延所得税资产   | -                      | -                        |
| 其他资产      | -                      | -                        |
| 资产总计      | 442,765,708.81         | 458,312,216.29           |
| 负债和所有者权益  | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2011 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 | 20,000,000.00          | 10,000,000.00            |
| 应付证券清算款   | 1,353,952.36           | 786,433.40               |
| 应付赎回款     | 336,422.25             | 397,391.41               |
| 应付管理人报酬   | 529,377.80             | 585,604.21               |
| 应付托管费     | 88,229.63              | 97,600.71                |
| 应付销售服务费   | -                      | -                        |
| 应付交易费用    | 467,352.46             | 363,590.09               |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应交税费          | 2,103.20       | 2,103.20       |
| 应付利息          | 4,882.44       | 2,312.42       |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 566,316.84     | 588,503.61     |
| 负债合计          | 23,348,636.98  | 12,823,539.05  |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 289,376,155.87 | 287,655,897.96 |
| 未分配利润         | 130,040,915.96 | 157,832,779.28 |
| 所有者权益合计       | 419,417,071.83 | 445,488,677.24 |
| 负债和所有者权益总计    | 442,765,708.81 | 458,312,216.29 |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.467 元，基金份额总额 897,939,091.90 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至<br>2011 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>-19,520,305.98</b>                    | <b>-59,368,449.43</b>                         |
| 1.利息收入                | 1,616,707.00                             | 1,834,824.77                                  |
| 其中：存款利息收入             | 244,209.21                               | 256,865.74                                    |
| 债券利息收入                | 1,372,497.79                             | 1,573,646.95                                  |
| 资产支持证券利息收入            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            | -                                        | 4,312.08                                      |
| 其他利息收入                | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -6,546,843.72                            | 32,919,762.65                                 |
| 其中：股票投资收益             | -9,173,023.05                            | 30,070,882.02                                 |
| 基金投资收益                | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 93,947.36                                | -270,135.79                                   |
| 资产支持证券投资收益            | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 2,532,231.97                             | 3,119,016.42                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -14,617,882.01                           | -94,200,851.47                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 27,712.75                                | 77,814.62                                     |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>5,575,895.18</b>                      | <b>6,715,487.30</b>                           |

|                            |                       |                       |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 3,241,291.11          | 3,969,890.18          |
| 2. 托管费                     | 540,215.15            | 661,648.37            |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                     |
| 4. 交易费用                    | 1,638,696.81          | 1,768,678.71          |
| 5. 利息支出                    | 91,238.83             | 251,037.07            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 91,238.83             | 251,037.07            |
| 6. 其他费用                    | 64,453.28             | 64,232.97             |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-25,096,201.16</b> | <b>-66,083,936.73</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-25,096,201.16</b> | <b>-66,083,936.73</b> |

### 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 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）                        | 287,655,897.96                             | 157,832,779.28 | 445,488,677.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -25,096,201.16 | -25,096,201.16 |
| 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）      | 1,720,257.91                               | 538,938.32     | 2,259,196.23   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 54,679,578.62                              | 26,748,999.60  | 81,428,578.22  |
| 2. 基金赎回款                               | -52,959,320.71                             | -26,210,061.28 | -79,169,381.99 |
| 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） | -                                          | -3,234,600.48  | -3,234,600.48  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 289,376,155.87                             | 130,040,915.96 | 419,417,071.83 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 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）                        | 210,243,448.90                             | 428,928,192.20 | 639,171,641.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -66,083,936.73 | -66,083,936.73 |
| 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）      | 83,195,985.04                              | 72,277,105.64  | 155,473,090.68 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 184,246,401.82                             | 161,719,001.85 | 345,965,403.67 |

|                                        |                 |                 |                 |
|----------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款                               | -101,050,416.78 | -89,441,896.21  | -190,492,312.99 |
| 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） | -               | -225,025,454.75 | -225,025,454.75 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 293,439,433.94  | 210,095,906.36  | 503,535,340.30  |

报告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：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 差错更正的说明

无。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期和本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.3.2 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             |
|------------------------|---------------------|
| 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、基金代销机构        |

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。

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,241,291.11               | 3,969,890.18                    |
| 其中：支付销售机构的客户   | 659,102.64                 | 347,970.31                      |

|     |  |  |
|-----|--|--|
| 维护费 |  |  |
|-----|--|--|

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 × 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 540,215.15                 | 661,648.37                      |

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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.4.4.2 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

无。

##### 6.4.4.5 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<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011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  | 24,254,498.85              | 232,148.17 | 31,937,689.25                   | 233,402.94 |

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。

##### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.5 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止, 本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 20,000,000.00 元, 于 2012 年 7 月 12 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的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。

### 6.4.6 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) 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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值, 公允价值层级可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 389,565,983.05 元, 属于第二层级的余额为 20,062,000.00 元, 无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日: 第一层级 377,719,732.61 元, 第二层级 59,958,000.00 元, 无第三层级)。

##### (iii) 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, 本基金分别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不将相关股票的公允价值列入第一层级; 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级或第三层级。

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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              | 313,552,335.05 | 70.82         |
|    | 其中：股票             | 313,552,335.05 | 70.82         |
| 2  | 固定收益投资            | 96,075,648.00  | 21.70         |
|    | 其中：债券             | 96,075,648.00  | 21.70         |
|    | 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      | 25,414,549.94  | 5.74          |
| 6  | 其他各项资产            | 7,723,175.82   | 1.74          |
| 7  | 合计                | 442,765,708.81 | 100.00        |

### 7.2 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            | 81,263,172.73  | 19.38         |
| C   | 制造业            | 112,483,042.59 | 26.82         |
| C0  | 食品、饮料          | 40,908,027.57  | 9.75          |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 1,550,526.65   | 0.37          |
| 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         | 5,370,000.00   | 1.28          |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 52,949,913.81  | 12.62         |
| C8  | 医药、生物制品        | 11,704,574.56  | 2.79          |
| C99 | 其他制造业          | -              | -             |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 12,066,600.00  | 2.88          |
| E   | 建筑业            | -              | -             |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -             |

|   |         |                |       |
|---|---------|----------------|-------|
| G | 信息技术业   | -              | -     |
| H | 批发和零售贸易 | 25,868,505.10  | 6.17  |
| I | 金融、保险业  | 49,465,096.17  | 11.79 |
| J | 房地产业    | 32,400,018.46  | 7.73  |
| K | 社会服务业   | 5,900.00       | 0.00  |
| L | 传播与文化产业 | -              | -     |
| M | 综合类     | -              | -     |
|   | 合计      | 313,552,335.05 | 74.76 |

### 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  | 002557 | 洽洽食品              | 1,068,604 | 21,478,940.40 | 5.12         |
| 2  | 601699 | 潞安环能              | 900,033   | 18,666,684.42 | 4.45         |
| 3  | 000001 | 深发展 A（后更名为“平安银行”） | 1,210,040 | 18,344,206.40 | 4.37         |
| 4  | 000937 | 冀中能源              | 1,150,019 | 17,560,790.13 | 4.19         |
| 5  | 002251 | 步步高               | 565,070   | 13,787,708.00 | 3.29         |
| 6  | 000528 | 柳工                | 1,050,000 | 13,030,500.00 | 3.11         |
| 7  | 000983 | 西山煤电              | 800,000   | 12,480,000.00 | 2.98         |
| 8  | 600395 | 盘江股份              | 462,021   | 12,419,124.48 | 2.96         |
| 9  | 600056 | 中国医药              | 550,378   | 12,080,797.10 | 2.88         |
| 10 | 600292 | 九龙电力              | 910,000   | 12,066,600.00 | 2.88         |

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  | 000937 | 冀中能源              | 25,255,279.39 | 5.67           |
| 2  | 601699 | 潞安环能              | 23,099,177.88 | 5.19           |
| 3  | 000001 | 深发展 A(后更名为“平安银行”) | 20,746,723.20 | 4.66           |
| 4  | 000968 | 煤气化               | 16,232,903.52 | 3.64           |
| 5  | 002099 | 海翔药业              | 16,070,371.30 | 3.61           |
| 6  | 000426 | 兴业矿业              | 16,038,719.89 | 3.60           |
| 7  | 000528 | 柳工                | 15,247,075.52 | 3.42           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 8  | 600395 | 盘江股份  | 14,545,498.65 | 3.27 |
| 9  | 600582 | 天地科技  | 14,528,558.62 | 3.26 |
| 10 | 000635 | 英 力 特 | 14,407,436.01 | 3.23 |
| 11 | 600418 | 江淮汽车  | 14,369,089.05 | 3.23 |
| 12 | 000983 | 西山煤电  | 14,262,749.82 | 3.20 |
| 13 | 000869 | 张 裕 A | 13,965,947.65 | 3.13 |
| 14 | 002310 | 东方园林  | 13,897,684.91 | 3.12 |
| 15 | 000961 | 中南建设  | 13,839,402.99 | 3.11 |
| 16 | 002327 | 富安娜   | 13,514,032.55 | 3.03 |
| 17 | 002251 | 步 步 高 | 13,276,636.20 | 2.98 |
| 18 | 600999 | 招商证券  | 13,072,334.68 | 2.93 |
| 19 | 002285 | 世联地产  | 12,546,033.40 | 2.82 |
| 20 | 000728 | 国元证券  | 12,477,304.36 | 2.80 |
| 21 | 600056 | 中国医药  | 12,426,793.52 | 2.79 |
| 22 | 600292 | 九龙电力  | 11,949,586.70 | 2.68 |
| 23 | 600239 | 云南城投  | 11,938,333.33 | 2.68 |
| 24 | 600298 | 安琪酵母  | 11,818,297.44 | 2.65 |
| 25 | 000885 | 同力水泥  | 11,140,797.77 | 2.50 |
| 26 | 000776 | 广发证券  | 10,650,277.00 | 2.39 |
| 27 | 600809 | 山西汾酒  | 10,552,770.61 | 2.37 |
| 28 | 000858 | 五 粮 液 | 10,522,043.44 | 2.36 |
| 29 | 002557 | 洽洽食品  | 10,179,983.58 | 2.29 |
| 30 | 600266 | 北京城建  | 10,165,707.91 | 2.28 |
| 31 | 600527 | 江南高纤  | 9,601,874.71  | 2.16 |
| 32 | 000878 | 云南铜业  | 9,362,751.45  | 2.10 |
| 33 | 600489 | 中金黄金  | 9,016,493.56  | 2.02 |

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  | 002236 | 大华股份  | 34,974,838.89 | 7.85           |
| 2  | 002029 | 七 匹 狼 | 31,360,659.85 | 7.04           |
| 3  | 002397 | 梦洁家纺  | 29,207,046.99 | 6.56           |
| 4  | 600763 | 通策医疗  | 22,336,186.31 | 5.01           |
| 5  | 600315 | 上海家化  | 19,409,226.22 | 4.36           |
| 6  | 002415 | 海康威视  | 17,261,406.82 | 3.87           |
| 7  | 600312 | 平高电气  | 17,037,579.48 | 3.82           |
| 8  | 000961 | 中南建设  | 16,604,275.84 | 3.73           |
| 9  | 600535 | 天士力   | 16,256,725.33 | 3.65           |
| 10 | 600587 | 新华医疗  | 15,277,208.19 | 3.43           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 002327 | 富安娜  | 14,014,907.66 | 3.15 |
| 12 | 000885 | 同力水泥 | 13,906,564.84 | 3.12 |
| 13 | 300027 | 华谊兄弟 | 13,433,635.55 | 3.02 |
| 14 | 300058 | 蓝色光标 | 13,358,818.17 | 3.00 |
| 15 | 000869 | 张裕A  | 13,143,696.21 | 2.95 |
| 16 | 000656 | 金科股份 | 12,885,086.25 | 2.89 |
| 17 | 002310 | 东方园林 | 12,853,634.75 | 2.89 |
| 18 | 600036 | 招商银行 | 12,851,863.30 | 2.88 |
| 19 | 600809 | 山西汾酒 | 12,570,229.90 | 2.82 |
| 20 | 000639 | 西王食品 | 12,188,261.08 | 2.74 |
| 21 | 600335 | 国机汽车 | 11,891,333.35 | 2.67 |
| 22 | 600637 | 百视通  | 11,136,123.80 | 2.50 |
| 23 | 000635 | 英力特  | 10,535,990.40 | 2.37 |
| 24 | 600527 | 江南高纤 | 10,149,696.11 | 2.28 |
| 25 | 601336 | 新华保险 | 9,751,963.10  | 2.19 |
| 26 | 600489 | 中金黄金 | 9,171,528.40  | 2.06 |
| 27 | 300203 | 聚光科技 | 9,020,794.35  | 2.02 |

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

单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 544,828,722.31 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 539,902,834.29 |

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      | 74,913,496.00 | 17.86        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,062,000.00 | 4.78         |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,062,000.00 | 4.78         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | 1,100,152.00  | 0.26         |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 96,075,648.00 | 22.91        |

## 7.6 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  | 010601 | 06 国债(1) | 316,520 | 31,588,696.00 | 7.53         |
| 2  | 019202 | 12 国债 02 | 300,000 | 30,300,000.00 | 7.22         |
| 3  | 030201 | 03 国开 01 | 200,000 | 20,062,000.00 | 4.78         |
| 4  | 010308 | 03 国债(8) | 60,000  | 6,064,200.00  | 1.45         |
| 5  | 019006 | 10 国债 06 | 60,000  | 5,965,800.00  | 1.42         |

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

### 7.9.3 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   | 500,000.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | 5,852,912.63 |
| 3  | 应收股利    | 36,000.00    |
| 4  | 应收利息    | 1,063,078.97 |
| 5  | 应收申购款   | 271,184.22   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,723,175.82 |

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 113001 | 中行转债 | 971,200.00 | 0.23         |
| 2  | 110013 | 国投转债 | 128,952.00 | 0.03         |

#### 7.9.5 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的情况。

### 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 |
| 52,030   | 17,258.10 | 13,738,557.52 | 1.53%  | 884,200,534.38 | 98.47% |

#### 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 |
|-------------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 333,702.26 | 0.04%    |

注：1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

### 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                   | 892,598,837.71 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 169,664,836.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 164,324,582.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期末基金份额总额                    | 897,939,091.90 |

## 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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 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。

### 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 |    |
| 中信建投 | 1      | 98,923,846.33 | 9.14%        | 81,043.11 | 9.00%      | -  |

|      |   |                |        |            |        |      |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|------|
| 中投证券 | 1 | 78,773,872.44  | 7.28%  | 67,123.32  | 7.46%  | -    |
| 国泰君安 | 1 | 70,734,496.71  | 6.54%  | 60,621.63  | 6.74%  | -    |
| 海通证券 | 1 | 433,222,589.05 | 40.04% | 352,231.22 | 39.14% | -    |
| 上海证券 | 1 | 263,616,770.39 | 24.37% | 224,610.05 | 24.96% | -    |
| 中信证券 | 1 | 136,569,239.64 | 12.62% | 114,367.46 | 12.71% | 本期新增 |
| 华泰证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -    |
| 东吴证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | -    |

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。

#### 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 |
| 中信建投 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 中投证券 | 23,579,934.10 | 30.90%       | 20,000,000.00 | 17.39%       | -    | -            |
| 国泰君安 | 7,005,496.00  | 9.18%        | 45,000,000.00 | 39.13%       | -    | -            |
| 海通证券 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 上海证券 | 45,715,779.98 | 59.91%       | 50,000,000.00 | 43.48%       | -    | -            |
| 中信证券 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 华泰证券 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 东吴证券 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |