

# 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

## 2012 年半年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十七日

## 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。

基金托管人中国建设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         | 国泰中小盘成长股票(LOF)（场内简称：国泰小盘） |
| 基金主代码        | 160211                    |
| 交易代码         | 160211                    |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2009年10月19日               |
| 基金管理人        | 国泰基金管理有限公司                |
| 基金托管人        | 中国建设银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额   | 857,284,978.55份           |
| 基金合同存续期      | 不定期                       |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                   |
| 上市日期         | 2010年1月7日                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                  |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。                                                                           |
| 投资策略   | 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济发展趋势的预测分析，评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。其中，股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象，采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩基准=35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司，属于高风险的证券投资基金品种。                                                 |

## 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                      | 中国建设银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李峰                              | 尹东                 |
|         | 联系电话 | 021-38561600 转                  | 010-67595003       |
|         | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com            | yindong.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | (021) 38569000,<br>400-888-8688 | 010-67595096       |
| 传真      |      | 021-38561800                    | 010-66275853       |

## 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<br>北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼       |

## 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       | -47,166,992.64                       |
| 本期利润          | -19,292,719.51                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0220                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.45%                               |
| 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  | -0.0204                              |
| 期末基金资产净值      | 716,710,844.23                       |
| 期末基金份额净值      | 0.836                                |

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

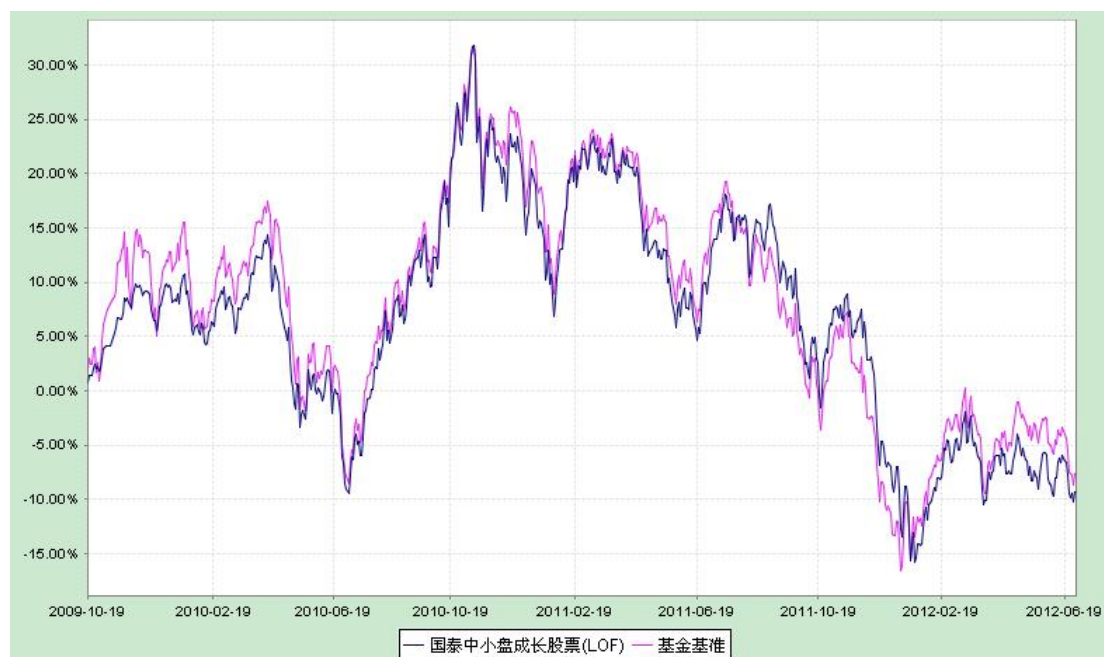
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -3.80%   | 1.00%       | -5.20%     | 0.95%         | 1.40%  | 0.05%  |
| 过去三个月      | 0.97%    | 1.00%       | 1.99%      | 0.96%         | -1.02% | 0.04%  |
| 过去六个月      | -2.45%   | 1.30%       | 4.99%      | 1.29%         | -7.44% | 0.01%  |
| 过去一年       | -17.72%  | 1.26%       | -18.11%    | 1.26%         | 0.39%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | -9.26%   | 1.24%       | -7.57%     | 1.30%         | -1.69% | -0.06% |

#### 3.2.2 自基金转型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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

自基金转型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

(2009 年 10 月 19 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：本基金的转型日为 2009 年 10 月 19 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    |      | 从业年限 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|----------------------------------------------|------------|------|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                              | 任职日期       | 离任日期 |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 张玮  | 本基金的基金经理、国泰金鹰增长股票、国泰成长优选股票的基金经理、公司投资总监兼研究部总监 | 2009-10-19 | -    | 12   | 硕士研究生。2000 年 11 月至 2004 年 6 月就职于申银万国证券研究所,任行业研究员。2004 年 7 月至 2007 年 3 月就职于银河基金管理有限公司, 历任高级研究员、基金经理。2007 年 3 月加入国泰基金管理有限公司,任国泰金鹰增长基金的基金经理助理, 2008 年 5 月起担任国泰金鹰增长证券投资基金的基金经理, 2009 年 4 月至 2009 年 10 月兼任国泰金盛封闭的基金经理, 2009 年 10 月起兼任国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)的基金经理, 2012 年 3 月起兼任国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理。2010 年 7 月至 2011 年 6 月任研究部副总监, 2011 年 6 月起任研究部总监。2011 年 6 月至 2012 年 2 月兼任公司投资副总监, 2012 年 2 月起兼任公司投资总监。 |
| 周伟锋 | 本基金的基金经理助理、国泰金鹰增长股票的基金经理助理                   | 2012-01-01 | -    | 4    | 硕士研究生。曾任中国航天科技集团西安航天发动机厂技术员, 2008 年 7 月加盟国泰基金, 历任研究员, 高级研究员, 2012 年 1 月起任国泰金鹰增长证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)的基金经理助理。                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

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

今年上半年，股市的表现在政策预期的推动下市场有所反复，在一季度由于政策预期进行了一段超过 10%的反弹，在后期由于刺激力度不达预期，以及经济下滑导致的部分上市公司业绩低于预期，带来了市场持续的下跌，从而使得上半年上证指数最终仅上涨 1.18%。而与此同时，代表新兴产业的中小板综合指数与创业板指数则分别上涨了 4.24%与下跌了 0.39%，表现有所分化，行业之间分化加大的同时，个股的分化明显加大。

从行业表现来看，上半年表现较好的行业为房地产、有色金属、食品饮料、餐饮旅游、医药生物等行业，表现落后的行业主要是信息技术、钢铁、采掘等行业。

结合行业与公司经营情况以及市场表现，本基金在上半年主要增持了金融保险、医药生物、农业、汽车以及社会服务等行业，减持了机械设备、信息技术、石油化工等行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2012 年上半年净值增长率为-2.45%，同期业绩比较基准收益率为 4.99%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来的宏观经济增长受到了一定的压力，我们判断一方面是经济自身周期的波动使然，另一方面经济结构转型的趋势正在进行。这一点在股市这个经济活动的先行指标中从上半年开始明显反映。展望下半年，我们认为应当保持谨慎乐观的态度。传统产业特别是周期

性传统产业的估值在上半年受到一定的压制，而新兴产业、传统行业中的产业结构或者竞争格局转好的行业受到资本市场的关注。同时，这些细分行业与公司通过今年相对难得的业绩较高增长也获得了估值的溢价。

结合我们对宏观经济的判断以及本基金的投资特点，我们倾向于保持适当中性偏上的仓位，从行业配置上我们倾向于在非周期行业（泛消费行业+TMT）中挑选成长性较好的公司进行配置，同时适度配置周期行业（主要着重受益于政策利好和有长期竞争力的低估值蓝筹股）。在上述行业选择之外，关注产业结构与竞争格局升级，我们将重点关注处于行业集中度上升期的传统行业龙头企业，以及消费与战略新兴产业中的细分领域龙头企业。

在追求收益的同时，更加注重风险评估和风险控制，为持有人创造稳健良好的中长期业绩回报将是我们不变的目标。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

# 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：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

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     | 26,709,256.94          | 67,373,455.31            |
| 结算备付金    | 1,185,116.65           | 204,657.01               |
| 存出保证金    | 750,000.00             | 890,741.00               |
| 交易性金融资产  | 653,323,900.04         | 715,831,871.91           |
| 其中：股票投资  | 626,939,052.19         | 665,722,797.89           |
| 基金投资     | -                      | -                        |
| 债券投资     | 26,384,847.85          | 50,109,074.02            |
| 资产支持证券投资 | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 34,100,277.05          | -                        |
| 应收证券清算款  | -                      | 3,814,051.22             |

|                 |                                |                                  |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 应收利息            | 364,265.75                     | 1,183,169.13                     |
| 应收股利            | 2,874,915.00                   | -                                |
| 应收申购款           | 65,591.92                      | 13,436.44                        |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 719,373,323.35                 | 789,311,382.02                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2012 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2011 年 12 月 31 日</b> |
| 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         | -                              | -                                |
| 应付赎回款           | 143,450.14                     | 156,362.68                       |
| 应付管理人报酬         | 897,462.24                     | 1,286,815.77                     |
| 应付托管费           | 149,577.05                     | 214,469.28                       |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 409,426.00                     | 475,968.08                       |
| 应交税费            | 287,030.48                     | 287,030.48                       |
| 应付利息            | -                              | -                                |
| 应付利润            | 279,108.68                     | 279,108.68                       |
| 递延所得税负债         | -                              | -                                |
| 其他负债            | 496,424.53                     | 372,759.81                       |
| 负债合计            | 2,662,479.12                   | 3,072,514.78                     |
| <b>所有者权益:</b>   |                                |                                  |
| 实收基金            | 718,006,071.78                 | 768,361,031.37                   |
| 未分配利润           | -1,295,227.55                  | 17,877,835.87                    |
| 所有者权益合计         | 716,710,844.23                 | 786,238,867.24                   |
| 负债和所有者权益总计      | 719,373,323.35                 | 789,311,382.02                   |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.836 元，基金份额总额 857,284,978.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

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 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 |
|-----|----------------------------|---------------------------------|
|-----|----------------------------|---------------------------------|

|                            | 年 6 月 30 日            | 年 6 月 30 日             |
|----------------------------|-----------------------|------------------------|
| <b>一、收入</b>                | <b>-11,544,758.44</b> | <b>-100,823,267.88</b> |
| 1.利息收入                     | 1,400,421.54          | 1,704,075.94           |
| 其中：存款利息收入                  | 228,719.68            | 396,556.21             |
| 债券利息收入                     | 1,035,747.19          | 1,032,247.19           |
| 资产支持证券利息收入                 | -                     | -                      |
| 买入返售金融资产收入                 | 135,954.67            | 275,272.54             |
| 其他利息收入                     | -                     | -                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | -40,895,684.44        | 46,328,298.74          |
| 其中：股票投资收益                  | -47,162,254.32        | 34,668,452.52          |
| 基金投资收益                     | -                     | -                      |
| 债券投资收益                     | 572,384.24            | -430,390.70            |
| 资产支持证券投资收益                 | -                     | -                      |
| 衍生工具收益                     | -                     | -                      |
| 股利收益                       | 5,694,185.64          | 12,090,236.92          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 27,874,273.13         | -149,301,465.88        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                     | -                      |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 76,231.33             | 445,823.32             |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>7,747,961.07</b>   | <b>14,818,189.31</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 5,542,862.37          | 11,092,139.02          |
| 2. 托管费                     | 923,810.37            | 1,848,689.87           |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                      |
| 4. 交易费用                    | 1,025,830.65          | 1,618,103.52           |
| 5. 利息支出                    | 8,375.78              | 2,112.52               |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 8,375.78              | 2,112.52               |
| 6. 其他费用                    | 247,081.90            | 257,144.38             |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-19,292,719.51</b> | <b>-115,641,457.19</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                      |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-19,292,719.51</b> | <b>-115,641,457.19</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

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）                        | 768,361,031.37                             | 17,877,835.87   | 786,238,867.24   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -19,292,719.51  | -19,292,719.51   |
| 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）      | -50,354,959.59                             | 119,656.09      | -50,235,303.50   |
| 其中：1.基金申购款                             | 10,613,915.10                              | 126,980.62      | 10,740,895.72    |
| 2.基金赎回款                                | -60,968,874.69                             | -7,324.53       | -60,976,199.22   |
| 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）                        | 718,006,071.78                             | -1,295,227.55   | 716,710,844.23   |
| 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）                        | 1,180,170,451.86                           | 363,054,098.81  | 1,543,224,550.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -115,641,457.19 | -115,641,457.19  |
| 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）      | 8,373,272.28                               | 5,036,703.38    | 13,409,975.66    |
| 其中：1.基金申购款                             | 277,178,055.45                             | 84,876,759.20   | 362,054,814.65   |
| 2.基金赎回款                                | -268,804,783.17                            | -79,840,055.82  | -348,644,838.99  |
| 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） | -                                          | -               | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,188,543,724.14                           | 252,449,345.00  | 1,440,993,069.14 |

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、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 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<br>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      | 5,542,862.37                   | 11,092,139.02                   |
| 其中：支付销售机构的客户<br>维护费 | 922,194.23                     | 629,664.83                      |

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<br>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 | 923,810.37 | 1,848,689.87 |
|----------------|------------|--------------|

注：支付基金托管人中国建设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

份额单位：份

| 项目                | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 期初持有的基金份额         | 56,611,737.00                  | 56,611,737.00                   |
| 期间申购/买入总份额        | -                              | -                               |
| 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         | 56,611,737.00                  | 56,611,737.00                   |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 6.60%                          | 3.99%                           |

注：关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

##### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

##### 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     |
| 中国建设银行 | 26,709,256.94              | 224,480.77 | 98,725,669.54                   | 373,582.26 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

金额单位：人民币元

| 6.4.5.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |          |               |               |   |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|---------------|---------------|---|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备 |
| 600489              | 中金黄金 | 2011-08-18 | 2012-08-13 | 非公开发行  | 24.97 | 21.52  | 800,000  | 19,976,000.00 | 17,216,000.00 |   |

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 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

无。

#### 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 609,821,900.04 元，属于第二层级的余额为 43,502,000.00 元，无属于第三层级的余额（2011 年 12 月 31 日：第一层级 593,865,930.42 元，第二层级 121,965,941.49 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              | 626,939,052.19 | 87.15            |
|    | 其中：股票             | 626,939,052.19 | 87.15            |
| 2  | 固定收益投资            | 26,384,847.85  | 3.67             |
|    | 其中：债券             | 26,384,847.85  | 3.67             |
|    | 资产支持证券            | -              | -                |
| 3  | 金融衍生品投资           | -              | -                |
| 4  | 买入返售金融资产          | 34,100,277.05  | 4.74             |
|    | 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      | 27,894,373.59  | 3.88             |
| 6  | 其他各项资产            | 4,054,772.67   | 0.56             |
| 7  | 合计                | 719,373,323.35 | 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<br>比例(%) |
|----|----------|----------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -              | -                |
| B  | 采掘业      | 25,097,600.00  | 3.50             |
| C  | 制造业      | 313,707,803.36 | 43.77            |

|     |                |                |       |
|-----|----------------|----------------|-------|
| C0  | 食品、饮料          | 31,896,825.28  | 4.45  |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | -              | -     |
| C2  | 木材、家具          | -              | -     |
| C3  | 造纸、印刷          | 43,469,177.18  | 6.07  |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 12,425,379.50  | 1.73  |
| C5  | 电子             | -              | -     |
| C6  | 金属、非金属         | 77,190,334.80  | 10.77 |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 87,642,060.31  | 12.23 |
| C8  | 医药、生物制品        | 61,084,026.29  | 8.52  |
| C99 | 其他制造业          | -              | -     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -              | -     |
| E   | 建筑业            | 52,248,540.59  | 7.29  |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -     |
| G   | 信息技术业          | 17,541,600.00  | 2.45  |
| H   | 批发和零售贸易        | 53,083,227.56  | 7.41  |
| I   | 金融、保险业         | 47,405,911.62  | 6.61  |
| J   | 房地产业           | 25,793,823.18  | 3.60  |
| K   | 社会服务业          | 21,962,545.88  | 3.06  |
| L   | 传播与文化产业        | 70,098,000.00  | 9.78  |
| M   | 综合类            | -              | -     |
|     | 合计             | 626,939,052.19 | 87.47 |

### 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<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 300058 | 蓝色光标 | 4,200,000 | 70,098,000.00 | 9.78                 |
| 2  | 600660 | 福耀玻璃 | 7,685,600 | 60,101,392.00 | 8.39                 |
| 3  | 300043 | 星辉车模 | 2,552,506 | 43,469,177.18 | 6.07                 |
| 4  | 600335 | 国机汽车 | 2,765,425 | 33,406,334.00 | 4.66                 |
| 5  | 002140 | 东华科技 | 1,697,728 | 32,681,264.00 | 4.56                 |
| 6  | 002567 | 唐人神  | 1,785,758 | 23,500,575.28 | 3.28                 |
| 7  | 002662 | 京威股份 | 1,060,139 | 22,676,373.21 | 3.16                 |
| 8  | 000338 | 潍柴动力 | 664,948   | 19,742,306.12 | 2.75                 |
| 9  | 600518 | 康美药业 | 1,245,858 | 19,211,130.36 | 2.68                 |
| 10 | 002430 | 杭氧股份 | 1,497,866 | 18,109,199.94 | 2.53                 |

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<br>(%) |
|----|--------|-------------------|---------------|--------------------|
| 1  | 002662 | 京威股份              | 23,053,281.77 | 2.93               |
| 2  | 002567 | 唐人神               | 22,066,296.32 | 2.81               |
| 3  | 000338 | 潍柴动力              | 21,970,400.97 | 2.79               |
| 4  | 000069 | 华侨城 A             | 18,395,882.16 | 2.34               |
| 5  | 600048 | 保利地产              | 14,800,125.89 | 1.88               |
| 6  | 000983 | 西山煤电              | 14,071,307.53 | 1.79               |
| 7  | 600030 | 中信证券              | 13,237,651.59 | 1.68               |
| 8  | 600572 | 康恩贝               | 11,675,743.61 | 1.49               |
| 9  | 600337 | 美克股份              | 11,316,368.38 | 1.44               |
| 10 | 002271 | 东方雨虹              | 11,301,478.01 | 1.44               |
| 11 | 601318 | 中国平安              | 11,083,351.14 | 1.41               |
| 12 | 600582 | 天地科技              | 10,509,825.15 | 1.34               |
| 13 | 600335 | 国机汽车              | 10,491,524.65 | 1.33               |
| 14 | 600031 | 三一重工              | 10,026,205.70 | 1.28               |
| 15 | 002430 | 杭氧股份              | 10,006,950.98 | 1.27               |
| 16 | 600383 | 金地集团              | 9,116,615.00  | 1.16               |
| 17 | 300289 | 利德曼               | 8,855,038.42  | 1.13               |
| 18 | 600518 | 康美药业              | 8,147,004.80  | 1.04               |
| 19 | 000001 | 深发展 A（后更名为“平安银行”） | 7,743,811.30  | 0.98               |
| 20 | 002457 | 青龙管业              | 7,623,030.38  | 0.97               |

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

### 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<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 002073 | 软控股份 | 33,386,765.47 | 4.25               |
| 2  | 002050 | 三花股份 | 32,055,669.59 | 4.08               |
| 3  | 300257 | 开山股份 | 25,782,863.56 | 3.28               |
| 4  | 300253 | 卫宁软件 | 21,022,152.31 | 2.67               |
| 5  | 600215 | 长春经开 | 19,407,326.56 | 2.47               |
| 6  | 601717 | 郑煤机  | 18,117,664.68 | 2.30               |
| 7  | 300146 | 汤臣倍健 | 15,499,552.70 | 1.97               |

|    |        |                   |               |      |
|----|--------|-------------------|---------------|------|
| 8  | 000656 | 金科股份              | 14,671,581.27 | 1.87 |
| 9  | 600660 | 福耀玻璃              | 14,164,362.40 | 1.80 |
| 10 | 300027 | 华谊兄弟              | 13,922,385.94 | 1.77 |
| 11 | 300058 | 蓝色光标              | 13,316,160.60 | 1.69 |
| 12 | 000983 | 西山煤电              | 12,334,945.33 | 1.57 |
| 13 | 300134 | 大富科技              | 10,124,926.25 | 1.29 |
| 14 | 600132 | 重庆啤酒              | 9,731,800.00  | 1.24 |
| 15 | 600582 | 天地科技              | 9,697,006.19  | 1.23 |
| 16 | 601216 | 内蒙君正              | 8,150,106.35  | 1.04 |
| 17 | 000001 | 深发展 A（后更名为“平安银行”） | 7,359,485.88  | 0.94 |
| 18 | 002638 | 勤上光电              | 6,715,527.16  | 0.85 |
| 19 | 600125 | 铁龙物流              | 6,110,860.66  | 0.78 |
| 20 | 002564 | 张化机               | 5,648,886.52  | 0.72 |

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 | 325,084,601.47 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 344,184,590.99 |

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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 16,072,000.00 | 2.24         |
|    | 其中：政策性金融债 | 16,072,000.00 | 2.24         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 10,214,000.00 | 1.43         |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | 98,847.85     | 0.01         |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 26,384,847.85 | 3.68         |

#### 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  | 120305    | 12 进出 05     | 160,000 | 16,072,000.00 | 2.24         |
| 2  | 041261006 | 12 渝外贸 CP001 | 100,000 | 10,214,000.00 | 1.43         |
| 3  | 125887    | 中鼎转债         | 890     | 98,847.85     | 0.01         |

#### 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   | 750,000.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | 2,874,915.00 |
| 4  | 应收利息    | 364,265.75   |
| 5  | 应收申购款   | 65,591.92    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,054,772.67 |

##### 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  | 125887 | 中鼎转债 | 98,847.85 | 0.01         |

### 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 |
| 25,413   | 33,734.11 | 170,824,070.53 | 19.93% | 686,460,908.02 | 80.07% |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称        | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|--------------|---------------|----------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司   | 26,583,337.00 | 25.60%   |
| 2  | 江苏鑫惠创业投资有限公司 | 3,899,500.00  | 3.76%    |
| 3  | 广州市科技进步基金会   | 2,280,000.00  | 2.20%    |
| 4  | 姜桂敏          | 1,140,136.00  | 1.10%    |
| 5  | 厦门市一帆科技有限公司  | 1,000,060.00  | 0.96%    |
| 6  | 关展辉          | 1,000,000.00  | 0.96%    |
| 7  | 郭建华          | 913,137.00    | 0.88%    |
| 8  | 杜德森          | 736,046.00    | 0.71%    |
| 9  | 吴月珍          | 670,033.00    | 0.65%    |
| 10 | 杨斌           | 531,800.00    | 0.51%    |

注：上述份额均为场内份额，持有人均为场内持有人。

### 8.3 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 | 1,698,001.61 | 0.20%    |

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 50 万份至 100 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 至 10 万份（含）。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2009 年 10 月 19 日）基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 917,424,285.58 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 12,673,996.01  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 72,813,303.04  |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              |
| 本报告期末基金份额总额                     | 857,284,978.55 |

## 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 |      |
| 宏源证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | 本期新增 |
| 厦门证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -    |
| 银河证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -    |
| 渤海证券 | 1      | 154,558,502.46 | 23.09%       | 132,083.09 | 23.57%     | -    |
| 国金证券 | 1      | 4,606,774.92   | 0.69%        | 3,915.67   | 0.70%      | -    |
| 国泰君安 | 2      | 10,207,987.80  | 1.53%        | 8,651.18   | 1.54%      | -    |
| 海通证券 | 2      | 89,130,164.48  | 13.32%       | 74,052.42  | 13.21%     | -    |
| 民族证券 | 1      | 33,647,971.19  | 5.03%        | 28,600.31  | 5.10%      | 本期新增 |
| 申银万国 | 1      | 10,864,303.94  | 1.62%        | 9,234.53   | 1.65%      | -    |
| 兴业证券 | 2      | 318,202,475.52 | 47.54%       | 262,038.95 | 46.75%     | -    |
| 中航证券 | 1      | 48,051,012.15  | 7.18%        | 41,902.55  | 7.48%      | -    |

注：1、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。

2、本期退租东莞证券 1 个席位。

### 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<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额          | 占当期回<br>购成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期<br>权证成<br>交总额<br>的比例 |
| 宏源证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 厦门证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 银河证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 渤海证券 | 313,590.00 | 100.00%                  | 30,000,000.00 | 50.00%               | -    | -                        |
| 国金证券 | -          | -                        | 30,000,000.00 | 50.00%               | -    | -                        |
| 国泰君安 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 海通证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 民族证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 申银万国 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 兴业证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |
| 中航证券 | -          | -                        | -             | -                    | -    | -                        |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日，本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任中国建设银行股份有限公司董事长、执行董事。