国泰金泰平衡混合型证券投资基金

2013 年半年度报告摘要

2013 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期： 二〇一三年八月二十四日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金泰平衡混合
基金主代码	519020
交易代码	519020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月24日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	841,801,136.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求相对稳定的回报。
投资策略	（一）大类资产配置 本基金的资产配置分为二个层次，首先应用投资时钟，分析当前所处的经济周期，以确定大类资产的配置比例；其次是在确定大类资产的配置比例后，应用Melva 资产评估系统进行日常的动态股票资产配置。 1、投资时钟的运用 本基金运用投资时钟，根据对经济增长和通货膨胀的分析，判断当前时段在经济周期中所处的具体位置，并以此确定所投资的大类资产种类及不同类别资产的投资优先级别。衰退阶段，经济增长停滞。超额的生产能力和下跌的大宗商品价格驱使通货膨胀率更低。企业赢利微弱并且实际的收益率下降，失业率处于高位。随着央行下调短期利率，试图刺激经济回复到长期增长趋势，收益率曲线急剧下行。此阶段债券是最佳的资产选择。复苏阶段，宽松的货币政策发挥效力，经济加速增长到长期增长趋势附近，因剩余产能充足，通胀水平仍在下降；因边际成本较低，公司毛利快速增长，盈利增长强劲。此阶段股票是最佳的资产选择。 过热阶段，经济增长率仍处于长期增长趋势之上，因资源与产

	能限制，通胀压力显现；公司收入增长仍然较快，但通胀与成本压力逐渐拖累其业绩表现。央行加息试图使经济增长率向长期增长趋势回落。随着收益率曲线上行和平坦，债券表现不佳。股票投资收益依赖于强劲的利润增长和价值重估两者的权衡。此阶段大宗商品是最好的资产选择。滞胀阶段，经济增长率降到长期增长趋势之下，但通胀却继续上升。生产不景气，产量下滑，企业为了保持盈利意图提高产品价格，导致工资-价格螺旋上涨。企业的盈利恶化，股票表现不佳，此阶段现金是最佳的选择。 2、Melva 资产评估系统的运用 本基金运用基金管理人的资产配置评估模型（Melva），通过宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关因素的分析判断，采用评分方法确定配置比例，以进行日常的动态股票资产配置。 （二）股票投资策略 本基金个股选择主要是从两个角度考虑，一个角度是选择盈利能力强、确定性高、估值安全的上市公司；另一个角度是根据事件驱动策略选择受益于事件因素或市场估值未能充分体现事件影响的上市公司。 （三）债券投资策略 本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略、可转债策略、回购交易套利策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，混合型基金的风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、相对较高预期收益的品种。

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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	林海中	赵会军
	联系电话	021-38561600 转	010-66105799
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		（021）38569000， 400-888-8688	95588
传真		021-38561800	010-66105798

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	http://www.gtfund.com
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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	8,458,924.58
本期利润	-8,179,501.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0083
本期基金份额净值增长率	-1.44%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013 年 6 月 30 日)**
期末可供分配基金份额利润	-0.1015
期末基金资产净值	828,665,710.74
期末基金份额净值	0.984

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）本基金合同生效日为 2012 年 12 月 24 日，截止至 2013 年 6 月 30 日不满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

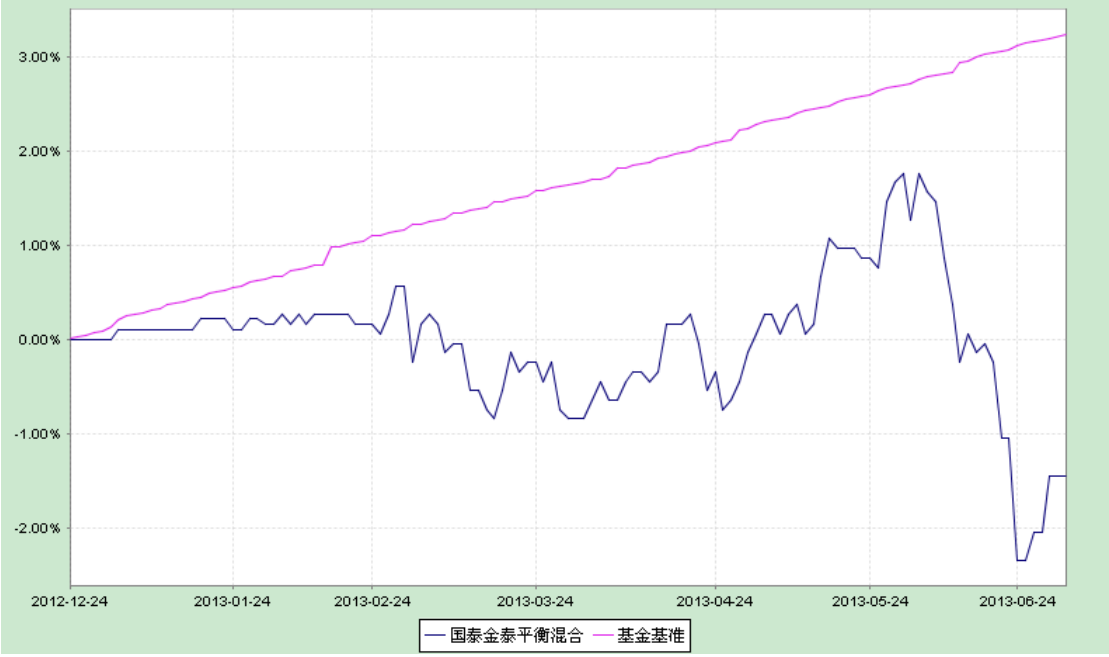
过去一个月	-2.67%	0.48%	0.51%	0.02%	-3.18%	0.46%
过去三个月	-0.61%	0.35%	1.56%	0.02%	-2.17%	0.33%
过去六个月	-1.44%	0.28%	3.10%	0.02%	-4.54%	0.26%
自基金合同生效起至今	-1.44%	0.27%	3.24%	0.02%	-4.68%	0.25%

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

国泰金泰平衡混合型证券投资基金

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

（2012 年 12 月 24 日至 2013 年 6 月 30 日）



注：（1）本基金的合同生效日为 2012 年 12 月 24 日，截至 2013 年 6 月 30 日，本基金运作时间不满一年；

（2）本基金在 6 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 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 35 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)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程洲	本基金的基金经理（原国泰金泰封闭的基金经理）、国泰金马稳健混合的基金经理。基金管理部总监助理。	2012-12-24	-	13	硕士研究生，CFA。曾任职于申银万国证券研究所。2004 年 4 月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级策略分析师、基金经理助理；2008 年 4 月起任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2009 年 12 月至 2012 年 12 月 23 日兼任金泰证券投资基金的基金经理，2010 年 2 月至 2011 年 12 月兼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 12 月 24 日起兼任国泰金泰平衡混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 2 月起任基金管理部总监助理。

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遵规守信情况的说明

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所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

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

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数≥20），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年 A 股市场出现了罕见的两极分化的走势，上证综指在宏观经济重回疲态和半年度的“钱荒”打击下快速跌破了去年的低点，半年累计跌幅 12.78%，而创业板指数

整体呈现了趋势性上涨的态势，半年涨幅高达 42.2%，整个上半年上证综指与创业板指数的表现差异约 55%。分行业看，传媒、电子、环保、医药、军工等所谓代表转型方向的行业涨幅靠前，而金融、地产、有色、煤炭等所谓代表旧经济的行业被市场抛弃。

本基金在春节后正式进入运作期，最初的建仓操作主要是在 2 月下旬“新国五条“政策出台后大幅度增持了房地产行业，但 3 月 1 日公布的严厉的税收细则超出了本基金和市场的预测，组合净值遭受了一定的损失。二季度随着规模的稳定，本基金逐步进入正常化操作阶段，6 月下旬在市场因“钱荒”恐慌性下跌时，本基金大幅度增加了股票仓位，增持的方向主要是金融和房地产行业，以及自下而上选择的一些盈利增长稳定且估值合理的消费股和机械股。从效果看，在资产配置上加仓的时点选择是正确的，但品种上效果不好，成长股的回升力度大大高于大盘蓝筹股。对于调控的担心、对于流动性收紧的担心、对于房价泡沫的担心持续压制了房地产股的表现，但本基金认为这些都应该已充分反映在目前房地产股极差的股价表现和极低的估值水平之中，相信业绩增长的确定性与低估值提供的安全边际决定了其未来会价值回归。

观察上半年的 A 股市场，转型经济与传统经济之间表现可谓是水火不相容，一个上天堂，一个下地狱！如何解释这一现象，不同人有不同的答案。我想中国经济转型是必然，但转型的过程是漫长的，转型之路是布满荆棘的，现在争先恐后地、不计成本地涌入手游、电影、互联网金融等主题之中是不是能够经得起时间的考验呢？新兴产业变化很快，现在最狂野的猜想都未必能猜到结局，谁能想到去年还红火无比的微博仿佛一夜间就全部变成了微信，那谁又能保证现在的宠儿明日还健在呢？现在跑步进入的这些投资行为更像是一笔风险投资，甚至是天使投资，其中可能孕育着未来的“沃尔玛”，但绝大部分投资的成功概率很低。反过来看，传统经济就真的一无是处吗？试问大家评论美国经济复苏的观察指标中最常见的是哪些？是划时代的谷歌眼镜吗、是 FACEBOOK 的火爆发行吗、还是引发国内一片激动的特斯拉电动车吗？这些都不是，是什么，是房地产和失业率！当然并不是说国内稳增长就搞房地产，只是提示不要因转型就要把传统踩入地狱，美国这样科技强国和消费大国都离不开房地产，更何况我们。我们相信，时间会证明投资要获得好的风险调整后的收益就是要坚持以现金流贴现为准绳的价值标准来选股投资。尚没有清晰的商业模式，只是在“中国梦”的大旗下猛冲猛打，总会有梦醒时分，90 年代网络泡沫时追求“点击率”和“市梦率”，冷静下来才发现当时是多么的可笑。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2013 年上半年的净值增长率为-1.44%，同期业绩比较基准收益率为 3.10%。

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 2013 年下半年，本基金认为，宏观经济下滑趋势已经较为明确，内生增长动力明显不足，若没有一些稳增长的政策，全年要实现 7.5%的经济增长目标难度较大。预计在“无政策”状态下股市依然会延续弱势调整格局，控制风险依然是投资策略的主基调。从投资方向看，看好业绩增长确定、估值较低、上半年表现不佳的大盘蓝筹股在下半年价值回归的机会，银行、地产、电力和交通运输等行业会有相对较好的表现。若在三季度后半段出台了一些稳增长政策，或是有改革释放政策红利的情况，那股市应该会有好的表现，周期股或改革受益行业会有一轮表现机会，但幅度也不宜太乐观。本基金以绝对收益为目标，有信心在下半年紧跟政策动向，通过一定幅度的资产配置调整并辅以股指期货的部分套期保值，以及个股选择来完成业绩目标。

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，本基金托管人在对国泰金泰平衡混合型证券投资基金的托管过程中，严格

遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，国泰金泰平衡混合型证券投资基金的管理人——国泰基金管理有限公司在国泰证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对国泰基金管理有限公司编制和披露的国泰金泰平衡混合型证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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：国泰金泰平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	60,624,220.88	164,667,970.76
结算备付金	2,288,075.68	22,283.16
存出保证金	198,503.83	1,071,714.88
交易性金融资产	708,173,265.07	1,271,958,419.00
其中：股票投资	171,297,938.07	-
基金投资	-	-
债券投资	536,875,327.00	1,271,958,419.00
资产支持证券投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	67,600,292.40	374,686,482.03
应收证券清算款	-	-
应收利息	10,416,917.96	27,035,850.48
应收股利	-	-
应收申购款	16,748.25	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	849,318,024.07	1,839,442,720.31
负债和所有者权益	**本期末 2013 年 6 月 30 日**	**上年度末 2012 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	16,450,053.15	-
应付赎回款	402,271.20	-
应付管理人报酬	990,081.56	2,322,542.74
应付托管费	165,013.62	387,483.13
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	385,810.44	17,870.12
应交税费	2,122,686.09	2,122,686.09
应付利息	-	-
应付利润	-	3,522,797.98
递延所得税负债	-	-
其他负债	136,397.27	600,000.00
负债合计	20,652,313.33	8,973,380.06
所有者权益：		
实收基金	914,071,935.93	2,000,000,000.00
未分配利润	-85,406,225.19	-169,530,659.75
所有者权益合计	828,665,710.74	1,830,469,340.25
负债和所有者权益总计	849,318,024.07	1,839,442,720.31

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.984 元，基金份额总额 841,801,136.86 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰金泰平衡混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	**4,727,804.70**
1.利息收入	18,041,306.77
其中：存款利息收入	1,311,953.85
债券利息收入	12,551,355.68
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,177,997.24
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,848,401.40
其中：股票投资收益	-887,664.59
基金投资收益	-
债券投资收益	1,048,239.90
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,687,826.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-16,638,425.62
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,476,522.15
减：二、费用	**12,907,305.74**
1．管理人报酬	9,978,512.65
2．托管费	1,663,085.41
3．销售服务费	-
4．交易费用	1,080,904.29
5．利息支出	3,611.13
其中：卖出回购金融资产支出	3,611.13
6．其他费用	181,192.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	**-8,179,501.04**
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-8,179,501.04

注：本基金成立日为 2012 年 12 月 24 日，因此无上年度可比期间金额。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金泰平衡混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	2,000,000,000.00	-169,530,659.75	1,830,469,340.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,179,501.04	-8,179,501.04
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）	-1,085,928,064.07	92,303,935.60	-993,624,128.47
其中：1.基金申购款	194,968,392.97	-7,459,388.62	187,509,004.35
2.基金赎回款	-1,280,896,457.04	99,763,324.22	-1,181,133,132.82
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）	914,071,935.93	-85,406,225.19	828,665,710.74

注：本基金成立日为 2012 年 12 月 24 日，因此无上年度可比期间金额。

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：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：巴立康

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰金泰平衡混合型证券投资基金是根据原金泰证券投资基金(以下简称“基金金泰”)基金份额持有人大会 2012 年 11 月 1 日决议通过的《关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可字[2012] 1549 号《关于核准金泰证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准，由原基金金泰转型而来。原基金金泰存续期限至 2012 年 12 月 23 日止。自 2012 年 12

月 24 日起，原基金金泰更名为国泰金泰平衡混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《金泰证券投资基金基金合同》失效的同时《国泰金泰平衡混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限不定。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金金泰于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,830,412,540.58 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金泰平衡混合型证券投资基金基金合同基金合同》的有关规定，本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、银行存款(包括银行活期存款、银行定期存款、协议存款、大额存单等)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-50%；债券、银行存款等固定收益类资产、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 50%-100%；其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2013 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 国泰金泰平衡混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1） 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2） 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3） 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期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

本基金管理人于 2013 年 5 月 31 日发布《国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告》，本基金管理人获批设立子公司国泰元鑫资产管理有限公司，注册资本为 5000 万元人民币。本基金管理人持有 50%的股权，中投信托有限责任公司和上海津赞投资管理有限公司分别持有 30%和 20%的股权。国泰元鑫资产管理有限公司已在上海市工商行政管理局虹口分局完成工商注册登记，取得营业执照。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
中建投信托有限责任公司	基金管理人的控股股东的控股子公司
中国电力财务有限公司（“中电财务”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,978,512.65
其中：支付销售机构的客户维护费	325,622.06

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,663,085.41

注：支付基金托管人中国工商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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金合同生效日（2012 年 12 月 24 日）持有的基金份额	28,165,676.00
期初持有的基金份额	28,165,676.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-2,351,557.00
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	25,814,119.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.07%

注：（1）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。

（2）本基金成立日为 2012 年 12 月 24 日，因此无上年度可比期间金额。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中电财务	4,124,294.00	0.49%	4,500,000.00	0.23%
中建投信托有限责任公司	4,124,294.00	0.49%	-	-

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	60,624,220.88	1,270,823.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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)各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 201,670,265.07 元，属于第二层级的余额为 506,503,000.00 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级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	171,297,938.07	20.17
	其中：股票	171,297,938.07	20.17
2	固定收益投资	536,875,327.00	63.21
	其中：债券	536,875,327.00	63.21
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	67,600,292.40	7.96
	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	62,912,296.56	7.41
6	其他各项资产	10,632,170.04	1.25
7	合计	849,318,024.07	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	采矿业	-	-
C	制造业	79,606,460.65	9.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	69,639,637.42	8.40
L	租赁和商务服务业	22,051,840.00	2.66
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	171,297,938.07	20.67

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	000002	万　科A	2,500,000	24,625,000.00	2.97
2	601888	中国国旅	755,200	22,051,840.00	2.66
3	002250	联化科技	982,522	19,640,614.78	2.37
4	002152	广电运通	1,619,023	17,776,872.54	2.15
5	000656	金科股份	1,272,338	14,746,397.42	1.78
6	002244	滨江集团	1,661,100	13,953,240.00	1.68
7	600885	宏发股份	902,219	11,331,870.64	1.37
8	600376	首开股份	1,500,000	8,325,000.00	1.00
9	600067	冠城大通	1,000,000	7,990,000.00	0.96
10	002028	思源电气	467,433	7,352,721.09	0.89

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	002244	滨江集团	42,467,517.37	2.32
2	600999	招商证券	42,147,307.26	2.30
3	000002	万　科A	41,190,990.46	2.25
4	600153	建发股份	37,500,908.39	2.05
5	601888	中国国旅	33,032,065.65	1.80
6	600795	国电电力	29,377,897.60	1.60
7	000656	金科股份	23,435,394.12	1.28

8	600067	冠城大通	22,784,221.40	1.24
9	002250	联化科技	20,581,737.95	1.12
10	002152	广电运通	20,001,301.07	1.09
11	600104	上汽集团	16,440,848.06	0.90
12	600036	招商银行	16,190,169.99	0.88
13	601766	中国南车	15,470,776.40	0.85
14	600376	首开股份	14,243,065.68	0.78
15	000024	招商地产	13,729,154.76	0.75
16	002004	华邦颖泰	11,811,948.15	0.65
17	600885	宏发股份	11,429,134.87	0.62
18	600900	长江电力	10,741,196.06	0.59
19	601877	正泰电器	10,230,651.08	0.56
20	002028	思源电气	7,620,340.45	0.42

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	600999	招商证券	38,167,740.04	2.09
2	600153	建发股份	37,478,180.77	2.05
3	600795	国电电力	30,554,543.59	1.67
4	002244	滨江集团	26,506,162.03	1.45
5	600036	招商银行	16,346,358.16	0.89
6	600067	冠城大通	15,367,542.23	0.84
7	600104	上汽集团	14,302,538.14	0.78
8	000024	招商地产	14,205,598.58	0.78
9	000002	万　科Ａ	13,776,763.96	0.75
10	600900	长江电力	11,833,481.40	0.65
11	601888	中国国旅	10,852,006.69	0.59
12	601877	正泰电器	10,678,459.69	0.58
13	002004	华邦颖泰	7,364,847.76	0.40
14	601766	中国南车	7,280,429.60	0.40
15	000656	金科股份	5,552,267.98	0.30
16	002385	大北农	4,958,504.57	0.27
17	000776	广发证券	4,590,000.00	0.25
18	002311	海大集团	4,254,597.94	0.23
19	600376	首开股份	3,469,296.63	0.19
20	000961	中南建设	3,290,598.35	0.18

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	476,921,516.14
卖出股票的收入（成交）总额	287,580,111.22

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	672,327.00	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,809,000.00	6.01
	其中：政策性金融债	49,809,000.00	6.01
4	企业债券	356,473,000.00	43.02
5	企业短期融资券	129,921,000.00	15.68
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	536,875,327.00	64.79

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	1380008	13 安顺国资债	700,000	71,974,000.00	8.69
2	1280326	12 秦开债	600,000	62,628,000.00	7.56
3	1380119	13 平潭国投债	500,000	50,600,000.00	6.11
4	1280342	12 兴安林业债	300,000	31,131,000.00	3.76
5	1380122	13 余创债	300,000	30,318,000.00	3.66

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	198,503.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,416,917.96
5	应收申购款	16,748.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,632,170.04

7.10.4 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。

7.10.5 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
38,986	21,592.40	479,891,831.62	57.01%	361,909,305.24	42.99%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	506,305.90	0.06%

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 0；

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 10 万至 50 万份（含）。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 12 月 24 日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期基金总申购份额	188,315,695.06
减：本报告期基金总赎回份额	1,179,534,225.20
本报告期基金拆分变动份额	-166,980,333.00
本报告期期末基金份额总额	841,801,136.86

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

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2013 年 3 月 6 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》刊登了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十四次会议审议通过，同意梁之平先生因工作需要离职。

2013 年 6 月 25 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过，同意李志坚先生出任公司副总经理。

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	
民族证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	117,583,561.77	15.38%	107,047.72	15.44%	-
西南证券	1	67,549,262.38	8.84%	61,495.87	8.87%	-
申银万国	2	174,169,877.81	22.78%	155,787.91	22.47%	-
上海证券	1	107,109,020.45	14.01%	97,511.54	14.07%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	154,229,965.48	20.17%	140,410.08	20.25%	-
国泰君安	2	28,483,741.24	3.73%	25,931.69	3.74%	-
华泰证券	1	97,344,171.85	12.73%	88,622.30	12.78%	-
海通证券	1	18,032,026.38	2.36%	16,416.64	2.37%	-
爱建信托	2	-	-	-	-	退租
安信证券	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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		购成交总额的比例		权证成交总额的比例
民族证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	1,549,300,000.00	35.00%	-	-
西南证券	-	-	20,000,000.00	0.45%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
上海证券	6,838,636.00	100.00%	882,600,000.00	20.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	1,475,200,000.00	33.32%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	500,000,000.00	11.00%	-	-
爱建信托	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-