上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

2014 年半年度报告摘要

2014 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 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 2014 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	国泰上证 180 金融 ETF
基金主代码	510230
交易代码	510230
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 31 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	490,261,607.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 5 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、股票投资策略 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组 合进行优化，尽量降低跟踪误差。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、债券投资策略 基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。
业绩比较基准	上证 180 金融股指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	林海中	王永民
	联系电话	021-31081600转	010-66594896

负责人	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	-47,628,923.75
本期利润	-64,416,632.77
加权平均基金份额本期利润	-0.1245
本期基金份额净值增长率	-4.51%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2014 年 6 月 30 日)**
期末可供分配基金份额利润	-0.4928
期末基金资产净值	1,484,640,115.61
期末基金份额净值	3.028

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)本基金于 2011 年 5 月 6 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.28400990；

(4)对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	1.00%	0.86%	-0.08%	0.87%	1.08%	-0.01%

过去三个月	2.96%	1.03%	1.97%	1.03%	0.99%	0.00%
过去六个月	-4.51%	1.15%	-5.26%	1.15%	0.75%	0.00%
过去一年	0.73%	1.45%	-0.78%	1.46%	1.51%	-0.01%
过去三年	-5.73%	1.50%	-10.93%	1.51%	5.20%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.00%	1.46%	-16.67%	1.49%	2.67%	-0.03%

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

上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011 年 3 月 31 日至 2014 年 6 月 30 日）

注：本基金的合同生效日为 2011 年 3 月 31 日。本基金在三个月建仓期结束时，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 2014 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 46 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、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金。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		
艾小军	本基金的基金经理、国泰上证 180 金融 ETF 联接基金、国泰黄金 ETF 的基金经理	2014-01-13	-	13	硕士研究生。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理。
章赟	本基金的基金经理	2011-03-31	2014-06-24	8	博士。曾任职于平安资产管理公司。2008 年 5 月加盟国泰基金管理有限公司，任数量金融分析师，2010 年 3 月至 2011 年 5 月任国泰沪深 300 指数基金的基金经理助理；2011 年 3 月至 2014 年 6 月担任上证 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的基金经理；2011 年 5 月至 2014 年 5 月兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理；2012 年 3 月至 2014 年 2 月兼任中小板 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的基金经理，2013 年 2 月至 2014 年 6 月兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理；2013 年 8 月至 2014 年 6 月兼任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基

					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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年 A 股行情整体呈现震荡下行的态势。经济数据偏弱、信用风险扩散等宏观条件对股市收益预期产生了负面影响，而流动性持续紧张和 IPO 重启等因素又对股市资金面造成了很大的压力。随着经济增长下滑到政府“下限”，稳增长逐渐占据上风，政府相继推出了一系列扩投资、稳外贸、定向货币宽松、财税结构调整等微刺激政策，政策的累积效应逐步显现，经济阶段性企稳，投资者的情绪得到逐步改善，但房地产市场的调整仍在持续，经济总体上仍处于筑底阶段。

受经济结构转型以及利率市场化进程加快的影响，银行的资产质量担忧仍未缓解，总体上银行股表现乏力。在部分券商推出互联网开户零佣金的打压下，券商股表现疲软。2014 年上半年 180 金融指数下跌 5.26%，好于沪深 300 指数 7.08%的跌幅。

作为完全跟踪标的指数的被动型基金，本基金避免了不必要的主动操作，减少了交易冲击成本，并通过精细化管理确保基金组合与指数权重基本一致。本基金年化跟踪误差为 0.843%，符合基金合同年化跟踪误差不超过 2%的规定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2014 年上半年的净值增长率为-4.51%，同期业绩比较基准收益率为-5.26%。

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 2014 年下半年，一系列的“微刺激”稳增长政策将令经济增长在政府下限 7.5%左右企稳。定向降准和定向再贷款政策有助于中长期利率的下行，下半年流动性环境可能较为宽松，资金价格将随着货币政策持续放松下降。随着沪港通的推出、RQFII 扩容，市场风格有望转向高股息率、低估值的蓝筹股以及稀缺品种，投资者的情绪也将继续改善，A 股市场有望迎来反弹机会。

投资主题方面，国防军工、信息安全、新能源与汽车电子、房地产限购政策放松、优先股试点、

沪港通等政策支持的投资主题都可能成为市场热点。

上证 180 金融指数由上证 180 指数中银行、保险、证券、信托等行业构成，是高股息率、低估值的代表，基于长期投资、价值投资的理念，投资者可利用国泰上证 180 金融 ETF 基金这一优良的资产配置工具，分享中国金融行业长期稳健增长的成果。在弱势反弹行情下，以银行股为代表的金融股具备低估值所带来的配置价值以及货币政策松动带来的交易性机会，投资者可积极利用国泰上证 180 金融 ETF 把握阶段性投资机会。

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的公司领导负责，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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持

有人利益的行为。

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）、投资组合报告等数据真实、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：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	4,329,379.40	15,002,147.42
结算备付金	4,687.56	224,206.19
存出保证金	797.79	18,413.94
交易性金融资产	1,481,367,453.37	1,051,062,860.69
其中：股票投资	1,481,367,453.37	1,051,062,860.69
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	61,892.52
应收利息	1,629.85	3,218.45
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	**1,485,703,947.97**	**1,066,372,739.21**
负债和所有者权益	**本期末 2014 年 6 月 30 日**	**上年度末 2013 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	809.50	505,566.40
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	612,724.13	512,264.79
应付托管费	122,544.82	102,452.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	85,738.08	99,414.94
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	242,015.83	398,247.40
负债合计	**1,063,832.36**	**1,617,946.49**
所有者权益：	-	-
实收基金	1,726,220,032.22	1,182,222,723.48
未分配利润	-241,579,916.61	-117,467,930.76
所有者权益合计	**1,484,640,115.61**	**1,064,754,792.72**
负债和所有者权益总计	**1,485,703,947.97**	**1,066,372,739.21**

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.028 元，基金份额总额 490,261,607.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	**-59,254,460.58**	**-179,110,371.84**
1.利息收入	33,991.98	39,625.22
其中：存款利息收入	33,721.42	36,671.64
债券利息收入	-	2,953.58
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	270.56	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-42,402,947.93	94,901,821.71
其中：股票投资收益	-59,356,153.23	72,175,457.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	648,885.52
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-

股利收益	16,953,205.30	22,077,478.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-16,787,709.02	-273,920,861.56
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-97,795.61	-130,957.21
减：二、费用	**5,162,172.19**	**3,940,272.80**
1．管理人报酬	3,857,976.32	2,884,526.90
2．托管费	771,595.31	576,905.37
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	170,032.15	184,270.33
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	362,568.41	294,570.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	**-64,416,632.77**	**-183,050,644.64**
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	**-64,416,632.77**	**-183,050,644.64**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,182,222,723.48	-117,467,930.76	1,064,754,792.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-64,416,632.77	-64,416,632.77
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）	543,997,308.74	-59,695,353.08	484,301,955.66
其中：1.基金申购款	1,880,223,708.86	-254,254,441.25	1,625,969,267.61
2.基金赎回款	-1,336,226,400.12	194,559,088.17	-1,141,667,311.95
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）	1,726,220,032.22	-241,579,916.61	1,484,640,115.61
项目	**上年度可比期间 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）	1,000,890,286.76	-37,252,981.18	963,637,305.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-183,050,644.64	-183,050,644.64
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）	176,050,909.27	48,239,056.62	224,289,965.89
其中：1.基金申购款	2,098,526,835.86	36,468,542.36	2,134,995,378.22
2.基金赎回款	-1,922,475,926.59	11,770,514.26	-1,910,705,412.33
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）	1,176,941,196.03	-172,064,569.20	1,004,876,626.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：张琼，会计机构负责人：王嘉浩

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]239 号《关于核准上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 566,033,941.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 566,044,541.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,600.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司确定 2011 年 5 月 6 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 金融股指数收盘值为 3,336.396 点，本基金的

基金资产净值为 536,366,537.07 元，折算前基金份额总额为 566,044,541.00 份，折算前基金份额净值为 0.948 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.28400990，折算后基金份额总额为 160,761,607.00 份，折算后基金份额净值为 3.336 元。本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2011 年 5 月 9 日完成了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 95 号文审核同意，本基金于 2011 年 5 月 23 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 180 金融股指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；主要投资范围为标的指数的成份股、备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金可少量投资于非标的指数成分股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为上证 180 金融股指数。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国泰上证 180 金融 ETF 联接基金”)。国泰上证 180 金融 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2014 年 8 月 26 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员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 2014 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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[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》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期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。

6.4.7.2 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

中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
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(“国泰上证 180 金融 ETF 联接 ”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 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	3,857,976.32	2,884,526.90
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 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	771,595.31	576,905.37

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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 X 0.1% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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
国泰上证 180 金融 ETF 联接	143,566,100.00	29.28%	181,696,300.00	54.11%

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	4,329,379.40	32,391.85	6,072,666.12	35,598.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2014 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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或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

于本报告期末，本基金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

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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)各层次金融工具公允价值

于 2014 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 1,481,367,453.37 元，无属于第二层级的余额及属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 1,040,688,499.88 元，第二层级 10,374,360.81 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)基金申购款

于 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 1,625,969,267.61 元，其中包括以股票支付的申购款 1,601,506,446.27 元和以现金支付的申购款 24,462,821.34 元。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,481,367,453.37	99.71
	其中：股票	1,481,367,453.37	99.71
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,334,066.96	0.29
7	其他各项资产	2,427.64	0.00
8	合计	1,485,703,947.97	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

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	-	-
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	1,481,367,453.37	99.78
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	1,481,367,453.37	99.78

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	601318	中国平安	4,591,445	180,627,446.30	12.17
2	600016	民生银行	26,250,902	163,018,101.42	10.98
3	600036	招商银行	15,824,596	162,043,863.04	10.91
4	601166	兴业银行	11,006,587	110,396,067.61	7.44
5	600000	浦发银行	10,727,600	97,084,780.00	6.54
6	600030	中信证券	7,545,492	86,471,338.32	5.82
7	600837	海通证券	7,762,906	71,030,589.90	4.78
8	601398	工商银行	19,108,320	64,777,204.80	4.36
9	601288	农业银行	24,888,018	62,717,805.36	4.22
10	601328	交通银行	15,040,840	58,358,459.20	3.93

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	19,335,042.94	1.82
2	601901	方正证券	15,376,449.90	1.44
3	600705	中航投资	11,475,361.21	1.08
4	601818	光大银行	8,629,772.00	0.81
5	600109	国金证券	6,159,404.67	0.58
6	601398	工商银行	2,955,729.00	0.28
7	601318	中国平安	2,769,861.37	0.26
8	600016	民生银行	2,540,558.00	0.24
9	600036	招商银行	2,284,992.35	0.21
10	601166	兴业银行	1,866,616.98	0.18
11	601288	农业银行	1,526,728.00	0.14
12	600000	浦发银行	1,516,416.00	0.14
13	601099	太平洋	1,316,161.00	0.12
14	601169	北京银行	1,304,030.00	0.12
15	600837	海通证券	1,067,372.05	0.10
16	601328	交通银行	1,045,610.00	0.10
17	601601	中国太保	869,446.63	0.08
18	600015	华夏银行	607,750.42	0.06
19	601939	建设银行	562,376.95	0.05
20	601998	中信银行	477,031.39	0.04

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	601318	中国平安	5,855,775.42	0.55
2	600036	招商银行	4,861,840.35	0.46
3	600016	民生银行	4,799,545.83	0.45
4	601166	兴业银行	3,902,342.92	0.37
5	600000	浦发银行	3,113,039.51	0.29
6	600837	海通证券	2,299,980.00	0.22
7	601288	农业银行	2,040,790.00	0.19
8	601328	交通银行	1,908,968.00	0.18

9	600015	华夏银行	1,554,402.15	0.15
10	601169	北京银行	1,363,276.21	0.13
11	601939	建设银行	1,028,373.14	0.10
12	601601	中国太保	976,688.91	0.09
13	600369	西南证券	915,030.84	0.09
14	601377	兴业证券	782,170.58	0.07
15	601688	华泰证券	775,030.00	0.07
16	601009	南京银行	750,176.61	0.07
17	601901	方正证券	727,471.17	0.07
18	601998	中信银行	449,030.00	0.04
19	601336	新华保险	359,454.57	0.03
20	601398	工商银行	302,503.34	0.03

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	85,469,765.04
卖出股票的收入（成交）总额	39,664,027.38

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“中国平安”公告其子公司情况违规情况外）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。

根据 2013 年 10 月 15 日中国平安发布的相关公告，该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48 号）。中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐业务许可 3 个月。

本基金管理人此前投资中国平安股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就中国平安子公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为平安证券存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额

1	存出保证金	797.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,629.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,427.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		国泰上证 180 金融联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,969	248,990.15	313,326,198.00	63.91%	33,369,309.00	6.81%	143,566,100.00	29.28%

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	中央汇金投资有限责任公司	251,000,209.00	51.20%
2	中国银行股份有限公司	143,566,100.00	29.28%

	一国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
3	中国太平洋财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品－013C	13,064,097.00	2.66%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－个人分红	11,684,415.00	2.38%
5	幸福人寿保险股份有限公司－分红	6,000,000.00	1.22%
6	中国平安保险（集团）股份有限公司	4,510,931.00	0.92%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	4,259,860.00	0.87%
8	中信证券股份有限公司	2,945,132.00	0.60%
9	厦门国际信托有限公司－恒天紫鑫一号证券投资集合资金信托	2,894,000.00	0.59%
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－团体分红	2,500,000.00	0.51%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 31 日）基金份额总额	566,044,541.00
本报告期期初基金份额总额	335,761,607.00
本报告期基金总申购份额	534,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	379,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	490,261,607.00

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。

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	1	125,133,792.42	100.00%	113,921.89	100.00%	-

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
中投证券	-	-	2,000,000.00	100.00%	-	-