

国泰淘金互联网债券型证券投资基金

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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

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。

基金托管人宁波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	国泰淘金互联网债券
基金主代码	000302
交易代码	000302
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 19 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	87,917,191.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳定增值。
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、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易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。 1、久期策略 本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极的预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。 2、收益率曲线策略 在组合的久期配置确定以后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。 3、类属配置策略 本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 4、利率品种策略 本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期

	限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,选择合适的期限结构的配置策略,在合理控制风险的前提下,综合考虑组合的流动性,决定投资品种。 5、信用债策略 本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债券的配置。 6、回购套利策略 回购套利策略也是本基金重要的投资策略之一,把信用债投资和回购交易结合起来,在信用风险和流动性风险可控的前提下,或者通过回购融资来博取超额收益,或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。 7、中小企业私募债投资策略 利用自下而上的公司、行业层面定性分析,结合 Z-Score、KMV 等数量分析模型,测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异,根据自上而下的宏观经济及行业特性分析,从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异,结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.0%
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	林海	贺碧波
	联系电话	021-31081600转	0574-89103198
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	hebibo@nbc.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95574
传真		021-31081800	0574-89103123

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	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	2,169,714.53

本期利润	2,576,295.09
加权平均基金份额本期利润	0.0290
本期基金份额净值增长率	3.78%
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	0.0322
期末基金资产净值	91,582,116.90
期末基金份额净值	1.042

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

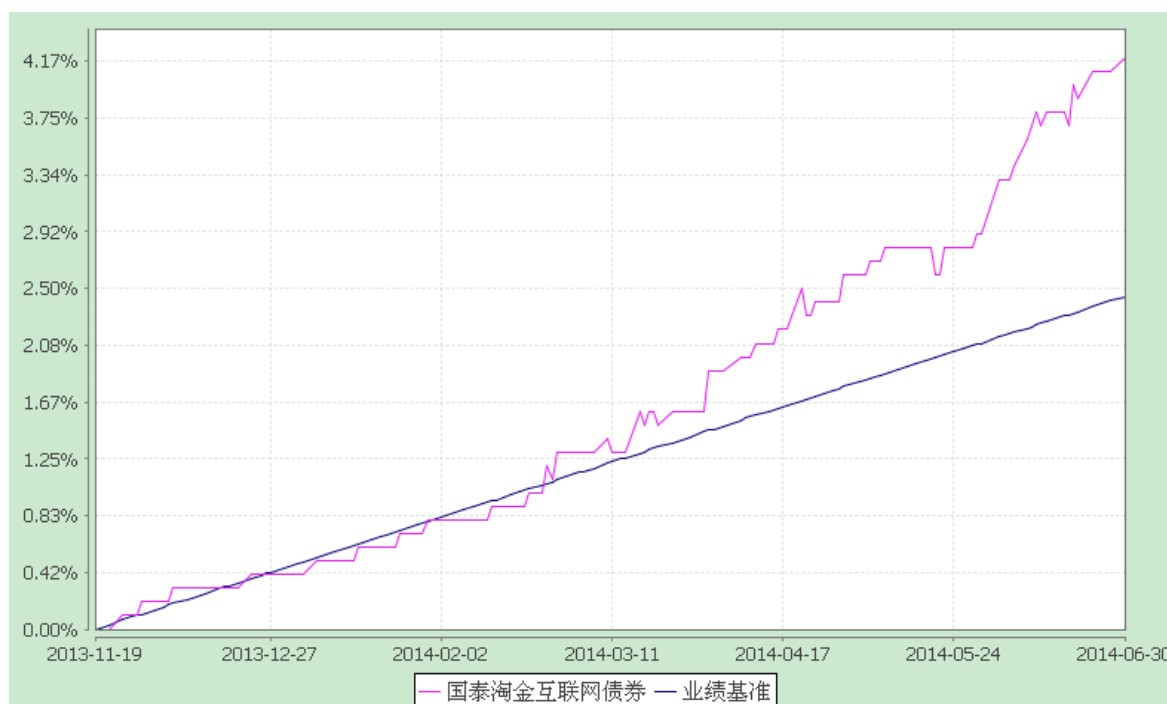
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.26%	0.13%	0.34%	0.01%	0.92%	0.12%
过去三个月	2.56%	0.11%	1.00%	0.01%	1.56%	0.10%
过去六个月	3.78%	0.09%	1.98%	0.01%	1.80%	0.08%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.08%	2.45%	0.01%	1.75%	0.07%

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

国泰淘金互联网债券型证券投资基金

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

（2013 年 11 月 19 日至 2014 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2013 年 11 月 19 日，截止至 2014 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年。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 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		
姜南林	本基金的基金经理、国泰现金管理货币、国泰货币市场、国泰 6 个月短期理财债券、国泰目标	2013-11-19	-	6	硕士研究生。2008 年 6 月至 2009 年 6 月在天相投资顾问有限公司担任宏观经济和债券分析师；2009 年 6 月至 2012 年 8 月在农银人寿保险股份有限公司(原嘉禾人寿保险股份有限公司)工作，先后担任宏观及债券研究员、固定收益投资

	收益保本混合、国泰金鹿保本混合、国泰保本的基金经理				经理；2012 年 8 月加入国泰基金管理有限公司，2012 年 12 月起担任国泰货币市场证券投资基金及国泰现金管理货币市场基金的基金经理，2013 年 3 月起兼任国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2013 年 9 月起兼任国泰保本混合型证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 11 月起任国泰淘金互联网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。

（一）本基金管理人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

当前宏观经济形势处于经济增速换挡期、结构调整阵痛期、前期刺激政策消化期相互叠加的阶段,2014 年上半年,在经历了一季度的经济短暂稳定后,二季度开始以保就业为核心的稳增长成为宏观经济管理的主要任务,货币政策操作以降低实体经济融资成本为主要目标,提高金融支持实体经济脆弱部门融资需求的功能。

2014 年上半年债券市场表现较为抢眼。2014 年春节后,货币政策基调逐步转向相对宽松,定向宽松政策工具创新不断,银行间回购利率逐步下行并保持低位,流动性预期恢复稳定,收益率曲线平行下移,尤其是进入 5 月份后中长期债券收益率加速下行,期限利差显著缩窄,其中银行间 10 年期国开金融债到期收益率上半年下行 86bps,其中 5 月份当月下行 41bps。

上半年,本基金严格按照基金契约要求,在基金规模逐步稳定之后,结合市场走势的判断,保持一定比例的杠杆,灵活调整久期,获得爬楼梯式的净值增长表现,为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2014 年上半年净值收益率为 3.78%,同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在新一届政府的执政理念下，经济增长更加重视质量、不过分追求经济增速，经济增长的动力主要依靠内需驱动，坚持结构调整和改革发展，即宏观经济正在进入一个持续时间较长的“新常态”。在此背景下，货币政策框架将跟随调整，更加注重使用价格型货币政策工具，按照调控“短端利率走廊、中期政策利率”的传导机制，实现金融支持实体经济脆弱部门的政策目标；财政政策方面积极推进财税体制改革。

在货币政策预期相对稳定的前提下，经济基本面的波动方向对债券收益率走势的影响权重相对上升。在前期稳增长措施下，经济领先指标有所回升，基本面转好预期以及前期收益率下行速度过快、幅度过大，预计下半年刚开始债券收益率有上行压力，但在政策部门力主降低实体经济融资成本的背景下，债券收益率上行幅度有限，从中期来看，融资成本的下降也会支撑债券收益率的下行。需要关注的风险因素包括：厄尔尼诺现象可能导致的输入型通胀；定向支持政策转为全面刺激政策致使经济快速回升，并带动核心通胀回升，叠加食品通胀周期，引致收益率曲线陡峭化上行，并使长久期债券收益率在较长时间内保持在高位。

投资操作方面，在跟踪经济增长、通胀、货币政策操作和资金价格的基础上，本基金投资组合以优质交易所可质押的城投债为底仓，杠杆灵活调整，杠杆资金以配置 AA 以上的国企短融为主，辅助波段操作利率债，在控制回撤幅度的前提下实现基金资产净值的稳定增长。

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（2014 年上半年），本托管人在对国泰淘金债券型证券投资基金的托管过程中，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期（2014 年上半年），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，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（2014 年上半年），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：国泰淘金互联网债券型证券投资基金

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	1,015,068.73	31,119,116.20
结算备付金	926,668.32	-
存出保证金	29,947.18	-
交易性金融资产	93,835,926.20	80,156,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	93,835,926.20	80,156,000.00
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	-	15,000,000.00
应收证券清算款	9,537,371.56	2,015,111.11
应收利息	1,849,441.75	2,052,662.99
应收股利	-	-
应收申购款	227,619.00	305,567,980.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	107,422,042.74	435,910,870.30
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	15,399,980.50	-
应付证券清算款	880.05	-
应付赎回款	33,423.11	2,812,589.26
应付管理人报酬	21,701.71	201,804.22
应付托管费	4,340.35	40,360.84
应付销售服务费	4,340.35	40,360.84
应付交易费用	850.00	2,981.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	374,409.77	90,539.30
负债合计	15,839,925.84	3,188,636.04
所有者权益：	-	-
实收基金	87,917,191.67	430,907,028.43
未分配利润	3,664,925.23	1,815,205.83
所有者权益合计	91,582,116.90	432,722,234.26
负债和所有者权益总计	107,422,042.74	435,910,870.30

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.042 元，基金份额总额 87,917,191.67 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰淘金互联网债券型证券投资基金

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
一、收入	3,410,842.68
1.利息收入	2,227,319.78
其中：存款利息收入	71,118.54
债券利息收入	1,654,604.52
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	501,596.72
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	776,349.23
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	776,349.23
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	406,580.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	593.11
减：二、费用	834,547.59
1. 管理人报酬	232,009.58
2. 托管费	46,402.01
3. 销售服务费	46,402.01
4. 交易费用	3,827.71
5. 利息支出	213,035.81
其中：卖出回购金融资产支出	213,035.81
6. 其他费用	292,870.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,576,295.09
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,576,295.09

注：由于本基金于 2013 年 11 月 19 日成立，无比较的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰淘金互联网债券型证券投资基金

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）	430,907,028.43	1,815,205.83	432,722,234.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,576,295.09	2,576,295.09
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）	-342,989,836.76	-726,575.69	-343,716,412.45
其中：1.基金申购款	133,419,835.16	3,838,487.84	137,258,323.00
2.基金赎回款	-476,409,671.92	-4,565,063.53	-480,974,735.45
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）	87,917,191.67	3,664,925.23	91,582,116.90

注：由于本基金于 2013 年 11 月 19 日成立，无比较的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

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

国泰淘金互联网债券型证券投资基金(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[2013]第 1050 号《关于核准国泰淘金互联网债券型证券投资基金募集的批复》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《国泰淘金互联网债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 1,011,519,752.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 740 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰淘金互联网债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 11 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,011,630,594.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 110,842.67 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰淘金互联网债券型证券投资基金基金合同》

的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类资产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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；基金投资于中小企业私募债的比例不高于基金资产净值的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款税后收益率+1.0%。

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》、《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为

投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 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、基金销售机构
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
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
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
宁波银行股份有限公司(“宁波银行”)	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。

6.4.8 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
当期发生的基金应支付的管理费	232,009.58
其中：支付销售机构的客户维护费	15,233.90

注：支付基金管理人国泰基金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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}$ 。

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
当期发生的基金应支付的托管费	46,402.01

注：支付基金托管人宁波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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.8.2.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国泰基金管理有限公司	31,672.36
宁波银行	9,898.85
合计	41,571.21

注：支付销售机构的销售服务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，按月支付给国泰基金，再由国泰基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为： $\text{日销售服务费} = \text{前一日基金份额基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

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银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行	1,015,068.73	35,497.85

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，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

本基金在本报告期内未有在承销期间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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金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

截至本报告期末 2014 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 15,399,980.50 元，于 2014 年 7 月 1 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。

6.4.10 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 2014 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属于第一层级的余额为 83,749,926.20 元，属于第二层级的余额为 10,086,000.00 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第二层级的余额为 80,063,694.24 元，无属于第一层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票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还是第三层级。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	93,835,926.20	87.35
	其中：债券	93,835,926.20	87.35
	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	1,941,737.05	1.81
7	其他各项资产	11,644,379.49	10.84
8	合计	107,422,042.74	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

7.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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	4,112,300.00	4.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	79,637,626.20	86.96
5	企业短期融资券	10,086,000.00	11.01
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	93,835,926.20	102.46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	124573	14 龙岩城	100,000	10,204,000.00	11.14
2	111058	09 黄城投	100,000	10,190,000.00	11.13
3	041459010	14 云南物流 CP001	100,000	10,086,000.00	11.01
4	122968	09 杭城投	70,000	7,023,800.00	7.67
5	122830	11 沈国资	50,500	5,171,200.00	5.65

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,947.18
2	应收证券清算款	9,537,371.56
3	应收股利	-
4	应收利息	1,849,441.75
5	应收申购款	227,619.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,644,379.49

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
6,159	14,274.59	57,990,888.00	65.96%	29,926,303.67	34.04%

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	202,867.33	0.23%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 11 月 19 日）基金份额总额	1,011,630,594.67
本报告期期初基金份额总额	430,907,028.43
本报告期基金总申购份额	133,419,835.16
减：本报告期基金总赎回份额	476,409,671.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	87,917,191.67

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 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。

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	
华创证券	2	-	-	-	-	-

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. 本基金本报告期租用证券公司交易单元较上年度未发生变化。

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
华创证券	116,464,191.67	100.00%	3,610,863,000.00	100.00%	-	-