
国泰金鹿保本增值混合证券投资基金
2010 年年度报告摘要
2010 年 12 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

报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

§ 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 2011 年 3 月 21 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。

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）于 2008 年 6 月 12 日生效，至 2010 年 6 月 17 日到期（鉴于 2010 年 6 月 12 日至 6 月 16 日为非工作日，故到期日顺延至 2010 年 6 月 17 日）。2010 年 6 月 18 日（含）至 2010 年 7 月 1 日（含）为本基金第二个保本期转至第三个保本期的过渡期。本基金第三个保本期为 2 年，自 2010 年 7 月 2 日起至 2012 年 7 月 2 日止（如该日为非工作日，则保本期到期日顺延至下一个工作日）。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人对《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》进行了修改，同时基金名称变更为“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金”，并于 2010 年 5 月 25 日刊登了变更后的基金合同等法律文件。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金鹿保本混合
基金主代码	020018
交易代码	020018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 12 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	2,324,222,841.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证本金安全的前提下，力争在本基金保本期结束时，实现基金财产的增值。
投资策略	本基金采用固定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）技术和基于期权的组合保险（OBPI，Option-Based Portfolio Insurance）技术相结合的投资策略。通过量化的资产类属配置达到本金安全。用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损，并通过投资可转债及股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	本基金以 2 年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李峰	唐州徽
	联系电话	021-38561600转	010-66594855
	电子邮箱	xinzipilu@gtfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		(021) 38569000, 400-888-8688	95566
传真		021-38561800	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-6,668,735.94	188,691,650.51	69,808,017.56
本期利润	-20,102,522.33	126,609,906.44	151,406,699.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0087	0.0513	0.0498
本期基金份额净值增长率	-1.39%	5.06%	5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3196	0.3780	0.3769
期末基金资产净值	2,347,802,625.32	2,162,732,760.03	2,968,944,147.83
期末基金份额净值	1.010	1.052	1.051

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
过去三个月	0.60%	0.22%	0.80%	0.00%	-0.20%	0.22%
过去六个月	1.02%	0.15%	1.50%	0.00%	-0.48%	0.15%
过去一年	-1.39%	0.18%	2.89%	0.00%	-4.28%	0.18%
自基金合同生效起至今	8.88%	0.14%	7.98%	0.00%	0.90%	0.14%

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

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008 年 6 月 12 日至 2010 年 12 月 31 日)

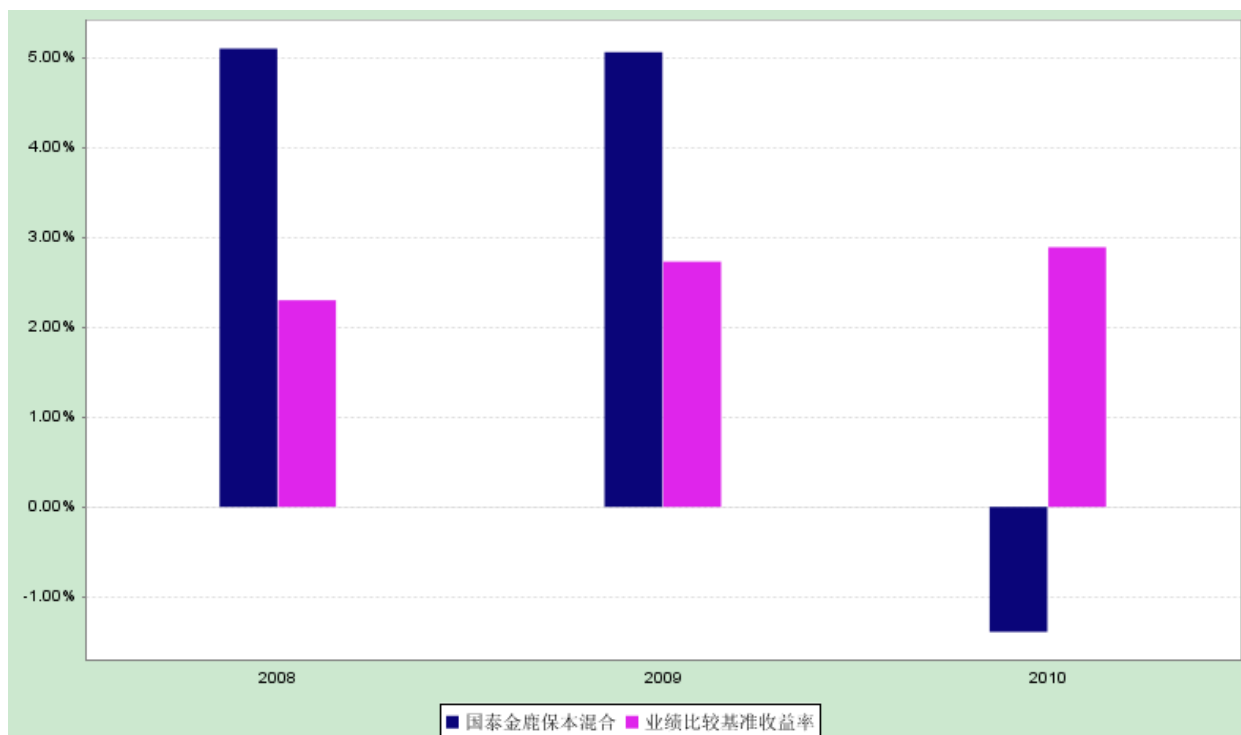


注：本基金的合同生效日为 2008 年 6 月 12 日。本基金在三个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：2008 年图示的指标计算期间为基金合同生效日 2008 年 6 月 12 日至 2008 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	0.520	105,654,968.41	-	105,654,968.41	-
2009年	0.500	133,739,996.41	-	133,739,996.41	-
2008年6月12日-2008年12月31日	-	-	-	-	-
合计	1.020	239,394,964.82	-	239,394,964.82	-

§ 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 2010 年 12 月 31 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（创新型封闭式基金），以及 14 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）。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		
吴晨	本基金的基金经理、国泰金龙债券的基金经理	2010-09-18	-	8	硕士研究生，CFA，FRM。2001 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004 年 9 月至 2005 年 10 月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005 年 10 月至 2008 年 3 月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008 年 4 月至 2009 年 3 月在长信基金管理有限公司从事债券研究；2009 年 4 月至 2010 年 3 月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010 年 4 月起担任国泰金龙债券的基金经理；2010 年 9 月起担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。

范迪钊	本基金的基金经理、国泰金牛创新股票的基金经理、国泰双利债券的基金经理	2010-06-07	-	10	学士。曾任职于上海银行、香港百德能控股公司上海代表处、华一银行、法国巴黎百富勤有限公司上海代表处，2005 年 3 月加盟国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、高级行业研究员、社保基金经理助理，2009 年 5 月至 2009 年 9 月任国泰金鹏蓝筹混合和国泰金鑫封闭的基金经理助理。2009 年 9 月起任国泰双利债券的基金经理，2009 年 12 月起兼任国泰金牛创新股票的基金经理，2010 年 6 月起兼任国泰金鹿保本混合的基金经理。
翁锡赞	本基金的基金经理、国泰货币的基金经理	2010-06-07	-	6	硕士研究生。曾任职于兴业基金公司、万家基金公司。2008 年 7 月加盟国泰基金管理有限公司，2008 年 8 月起担任国泰货币的基金经理，2010 年 6 月起兼任国泰金鹿保本混合的基金经理。
唐珂	本基金的基金经理、国泰金泰封闭的基金经理	2008-08-23	2010-05-26	7	硕士研究生，CFA。曾任职于江苏丹化集团、德国远东投资有限公司、中国网络、上海德茂投资。2003 年 2 月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级行业研究员、基金经理助理。2008 年 8 月至 2010 年 5 月任国泰金鹿保本混合(二期)的基金经理。2008 年 4 月至 2010 年 5 月任国泰金泰封闭的基金经理。
陈强	本基金的基金经理、国泰金龙债券的基金经理	2008-08-23	2010-06-07	13	硕士。曾任职于中行辽宁省分行、大连市商业银行、汉唐证券。2004 年 11 月加盟国泰基金管理有限公司，2004 年 11 月至 2006 年 10 月任国泰金象保本基金的基金经理助理，2005 年 6 月至 2006 年 10 月兼任国泰货币的基金经理助理，2006 年 11 月至 2007 年 11 月任国泰金象保本证券投资基金的基金经理。2008 年 8 月至 2010 年 6 月担任国泰金鹿保本混合(二期)的基金经理。2009 年 3 月起兼任国泰金

					龙债券的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------

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，本基金管理人向监管部门汇报了铜陵转债超额认购相关事项，未对基金份额持有人利益造成实质不利影响。本基金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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年国内外经济形势复杂多变，证券市场随之大幅波动。上半年我国宏观经济显著回稳，通胀预期开始升温，为管理通胀预期，央行货币政策由宽松转向中性。下半年，受经济增速放缓影响，政

策放松预期有所抬头。与之相对应的是市场预期的大幅变动，从年初的担心经济过热引发调控，到 2 季度的二次探底说，3 季度的政策真空预期，到 4 季度很快被加息所击溃。在如此多变的市场预期中，非周期性行业受到了投资者持续的追捧，虽然全年沪深 300 指数下跌了 12.5%，但行业分化明显，电子元器件、医药等行业的涨幅超过了 30%，而钢铁、房地产、金融等行业则下跌超过了 20%。债券市场上半年在经济悲观预期的主导下，受资金推动影响走出一波强劲上涨行情，下半年则随着资金面收紧而基本回吐了上半年的涨幅。

本基金上半年处于二期的收官阶段，债券部分期限匹配，保留了一定比例的权益资产，造成二季度净值下跌。三季度开始本基金进入第三期保本期，建仓阶段债券部分采取逐步建仓拉长久期的策略，但组合总体仍然维持短久期以确保基金净值的平稳增长。同时在严控风险的前提下有选择地适度参与新股以及新转债申购，提高组合收益。二级市场投资根据保本垫情况适度投资部分估值低、盈利明确的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2010 年度净值增长率为-1.39%，同期业绩比较基准增长率为 2.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 又将是复杂的一年。通胀水平能否得以控制，宏观经济能否顺利的去房产化，是当前投资者最为关注的焦点。我们认为，在通胀没有得到有效控制，房地产市场没能出现明显调整之前，股票市场的上行空间不会太大。但与此同时，大盘蓝筹股极低的估值，又使得市场的下行空间不会很大。因此我们预期在 2011 年的大部分时间内，市场震荡的概率很大。而当上述两个问题得到解决之后，市场会有很大的上涨空间。债券市场虽然受货币政策调整影响更为直接，但由于绝对收益水平已经具有一定吸引力，调整空间将较为有限，存在阶段性机会。

2011 年本基金将采取债券中性偏谨慎的策略，在坚持 CPPI 和 OBPI 的基础上积极、灵活地进行股票市场投资。积极寻找基本面及估值匹配度较好的投资标的。在 2011 年流动性受到控制，货币政策偏紧的环境下，我们看好积极的财政政策所支持鼓励的行业，比如高铁、海工、水利，核电等。同时，我们对于金融行业也持积极的态度，我们认为 2012 年 7 倍以下的市盈率估值已经反映了所有的悲观预期，一旦市场情绪发生变化，上行空间极大。我们还将在控制风险的前提下择优参与新股发行，努力在保证投资者本金安全的前提下实现资产增值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规规定，成立了估值委员会，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普华永道会计师事务所进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金已于 2010 年实施利润分配 105,654,968.41 元。

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”）在对国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（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，本报告期内，本托管人向监管部门汇报了铜陵转债超额认购相关事项，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 审计报告

本基金 2010 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：		
银行存款	79,987,412.24	237,274,371.90
结算备付金	2,724,424.03	576,242.05
存出保证金	250,000.00	408,014.66
交易性金融资产	2,356,168,324.94	1,907,414,220.67
其中：股票投资	329,470,971.54	155,908,860.09
基金投资	-	-
债券投资	2,026,697,353.40	1,751,505,360.58
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	103,400,000.00
应收证券清算款	-	6,514,085.68
应收利息	17,151,523.53	22,609,484.05
应收股利	-	-
应收申购款	8,880.39	7,576.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	7,569.32
资产总计	2,456,290,565.13	2,278,211,564.42

负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	70,000,000.00	-
应付证券清算款	29,412,286.75	102,806,433.50
应付赎回款	2,005,400.35	6,565,368.66
应付管理人报酬	2,243,663.33	2,048,511.41
应付托管费	407,938.76	372,456.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	536,166.29	334,750.35
应交税费	3,055,309.67	2,209,076.80
应付利息	5,924.25	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	821,250.41	1,142,207.07
负债合计	108,487,939.81	115,478,804.39
所有者权益:		
实收基金	1,604,873,481.57	1,385,694,817.71
未分配利润	742,929,143.75	777,037,942.32
所有者权益合计	2,347,802,625.32	2,162,732,760.03
负债和所有者权益总计	2,456,290,565.13	2,278,211,564.42

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.010 元，基金份额总额 2,324,222,841.83 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12 月31日
一、收入	14,123,954.96	165,047,629.60
1. 利息收入	40,278,340.09	75,299,778.27
其中：存款利息收入	2,493,132.23	1,706,562.71
债券利息收入	34,736,729.55	73,529,894.03
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,048,478.31	63,321.53
其他利息收入	-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）	-14,062,982.52	149,189,565.60
其中：股票投资收益	-22,591,854.50	109,207,293.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,129,394.45	38,093,818.86
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	877,452.34
股利收益	399,477.53	1,011,000.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-13,433,786.39	-62,081,744.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,342,383.78	2,640,029.80
减：二、费用	34,226,477.29	38,437,723.16
1. 管理人报酬	24,922,829.63	28,251,652.26
2. 托管费	4,531,423.53	5,136,664.04
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,816,671.74	4,480,814.05
5. 利息支出	1,597,427.83	216,830.70
其中：卖出回购金融资产支出	1,597,427.83	216,830.70
6. 其他费用	358,124.56	351,762.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-20,102,522.33	126,609,906.44
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-20,102,522.33	126,609,906.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	1,385,694,817.71	777,037,942.32	2,162,732,760.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,102,522.33	-20,102,522.33
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）	219,178,663.86	91,648,692.17	310,827,356.03
其中：1. 基金申购款	1,062,299,120.10	477,528,146.16	1,539,827,266.26

2. 基金赎回款	-843,120,456.24	-385,879,453.99	-1,228,999,910.23
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)	-	-105,654,968.41	-105,654,968.41
五、期末所有者权益(基金净值)	1,604,873,481.57	742,929,143.75	2,347,802,625.32
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	1,904,279,267.00	1,064,664,880.83	2,968,944,147.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	126,609,906.44	126,609,906.44
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)	-518,584,449.29	-280,496,848.54	-799,081,297.83
其中：1. 基金申购款	124,467,611.95	65,511,567.05	189,979,179.00
2. 基金赎回款	-643,052,061.24	-346,008,415.59	-989,060,476.83
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)	-	-133,739,996.41	-133,739,996.41
五、期末所有者权益(基金净值)	1,385,694,817.71	777,037,942.32	2,162,732,760.03

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东, 基金担保人
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金代销机构、基金管理人的原股东(2010年6月21日以前)
中信建投证券有限责任公司(“中信建投”)	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东(自2010年6月21日起)

注: 根据国泰基金管理有限公司于 2010 年 6 月 21 日发布的公告, 经公司股东会审议通过, 并报经中国证监会证监许可[2009]1163 号文批准, 公司股东中国建银投资有限责任公司、原股东万联证券有限责任公司将其所持有的国泰基金管理有限公司合计 30% 的股权转让给意大利忠利集团。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,922,829.63	28,251,652.26
其中: 支付销售机构的客户维护费	2,313,407.31	3,515,709.37

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 1.1% 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:

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.1% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,531,423.53	5,136,664.04

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 0.2% 的年费率计提, 逐日累计至每

月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	200,391,472.76	-	-	-	950,000,000.00	321,715.78
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	201,718,725.48	507,636,038.63	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12 月31日
	期初持有的基金份额	49,999,000.00
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	49,999,000.00	-
期末持有的基金份额	-	49,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	-	2.43%

注：基金管理人国泰基金管理有限公司在本年度赎回本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理，赎回时已到保本期到期日，无赎回费。

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.3.5 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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	79,987,412.24	2,455,921.41	237,274,371.90	1,668,579.22

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。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信建投	002405	四维图新	新股网上发行	500	12,800.00
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信建投	601888	中国国旅	新股网下发行	29,786	350,879.08

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金由中国建投作为担保人，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证担保的范围为：在本保本期到期时，基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上本保本期内本基金的累计分红金额，低于投资净额时的差额部分。基金份额持有人指在本基金上一个保本期转入本次保本期的过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人及从本基金上一个保本期默认转入本保本期的基金份额持有人。持有到期指在本基金上一个保本期转入本次保本期的过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人及从本基金上一个保本期默认转入本保本期的基金份额持有人在本保本期内一直持有其在本基金的过渡期限定期限内申购及默认转入本保本期的基金份额。本基金的担保费由本基金的基金管理人按基金资产净值 0.2% 的年费率从基金管理费收入中列支。

7.4.4 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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

7.4.4.1.1 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	备注
002529	海源机械	2010-12-17	2011-03-24	网下申购	18.00	21.49	1,600,000	28,800,000.00	34,384,000.00	-
300134	大富科技	2010-10-14	2011-01-26	网下申	49.50	66.00	233,644	11,565,378.00	15,420,504.00	-

				购						
002497	雅化集团	2010-10-29	2011-02-09	网下申购	30.50	42.30	266,889	8,140,114.50	11,289,404.70	-
300139	福星晓程	2010-11-03	2011-02-14	网下申购	62.50	72.80	124,763	7,797,687.50	9,082,746.40	-
002487	大金重工	2010-09-29	2011-01-17	网下申购	38.60	39.70	204,778	7,904,430.80	8,129,686.60	-
300133	华策影视	2010-10-14	2011-01-26	网下申购	68.00	116.00	48,599	3,304,732.00	5,637,484.00	-
002496	辉丰股份	2010-10-29	2011-02-09	网下申购	48.69	55.80	90,645	4,413,505.05	5,057,991.00	-
002501	利源铝业	2010-11-05	2011-02-17	网下申购	35.00	52.80	89,349	3,127,215.00	4,717,627.20	-
300136	信维通信	2010-10-27	2011-02-09	网下申购	31.75	67.80	68,421	2,172,366.75	4,638,943.80	-
300128	锦富新材	2010-09-27	2011-01-13	网下申购	35.00	47.19	77,567	2,714,845.00	3,660,386.73	-
300137	先河环保	2010-10-27	2011-02-09	网下申购	22.00	38.21	91,907	2,021,954.00	3,511,766.47	-
300125	易世达	2010-09-27	2011-01-13	网下申购	55.00	83.49	37,672	2,071,960.00	3,145,235.28	-
600998	九州通	2010-10-27	2011-02-09	网下申购	13.00	14.55	178,068	2,314,884.00	2,590,889.40	-
300127	银河磁体	2010-09-27	2011-01-13	网下申购	18.00	27.90	84,461	1,520,298.00	2,356,461.90	-
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	网下申购	5.99	5.99	307,886	1,844,237.14	1,844,237.14	-
601777	力帆股份	2010-11-17	2011-02-28	网下申购	14.50	14.06	121,776	1,765,752.00	1,712,170.56	-
002486	嘉麟杰	2010-09-29	2011-01-17	网下申购	10.90	14.90	112,537	1,226,653.30	1,676,801.30	-
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	网下申购	23.98	31.24	19,786	474,468.28	618,114.64	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 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 70,000,000.00 元，于 2011 年 1 月 7 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。

7.4.5 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

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)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)。

于 2010 年 12 月 31 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 374,934,324.94 元，属于第二层级的余额为 1,981,234,000.00 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 217,097,220.67 元，第二层级 1,690,317,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	329,470,971.54	13.41
	其中：股票	329,470,971.54	13.41
2	固定收益投资	2,026,697,353.40	82.51
	其中：债券	2,026,697,353.40	82.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	82,711,836.27	3.37
6	其他各项资产	17,410,403.92	0.71
7	合计	2,456,290,565.13	100.00

8.2 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	1,844,237.14	0.08
B	采掘业	24,552,654.00	1.05
C	制造业	158,738,146.95	6.76
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	1,676,801.30	0.07
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	45,440,980.37	1.94
C5	电子	24,423,907.87	1.04
C6	金属、非金属	12,847,313.80	0.55
C7	机械、设备、仪表	74,349,143.61	3.17
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,784,000.00	0.76
F	交通运输、仓储业	30,122,577.44	1.28
G	信息技术业	22,020,504.00	0.94
H	批发和零售贸易	14,453,190.07	0.62
I	金融、保险业	26,800,000.00	1.14
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	3,145,235.28	0.13
L	传播与文化产业	5,637,484.00	0.24

M	综合类	24,372,942.66	1.04
	合计	329,470,971.54	14.03

8.3 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	002529	海源机械	1,600,000	34,384,000.00	1.46
2	601006	大秦铁路	3,851,992	30,122,577.44	1.28
3	601288	农业银行	10,000,000	26,800,000.00	1.14
4	600157	永泰能源	1,049,653	24,372,942.66	1.04
5	300134	大富科技	333,644	22,020,504.00	0.94
6	601668	中国建筑	5,200,000	17,784,000.00	0.76
7	600176	中国玻纤	599,800	15,234,920.00	0.65
8	600583	海油工程	1,704,600	13,807,260.00	0.59
9	600335	鼎盛天工	699,957	11,549,290.50	0.49
10	002497	雅化集团	266,889	11,289,404.70	0.48

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000157	中联重科	53,207,547.31	2.46
2	601006	大秦铁路	50,830,632.28	2.35
3	600031	三一重工	48,893,913.36	2.26
4	600016	民生银行	45,506,943.05	2.10
5	601818	光大银行	42,344,671.85	1.96
6	601288	农业银行	41,530,000.00	1.92
7	000002	万科 A	40,374,149.78	1.87
8	600585	海螺水泥	39,284,143.90	1.82
9	600153	建发股份	31,690,463.86	1.47
10	000401	冀东水泥	30,437,296.87	1.41
11	002529	海源机械	28,800,000.00	1.33
12	600157	永泰能源	27,289,945.71	1.26

13	601668	中国建筑	26,820,906.00	1.24
14	600036	招商银行	25,620,325.09	1.18
15	601628	中国人寿	25,226,065.68	1.17
16	000708	大冶特钢	24,651,610.67	1.14
17	601088	中国神华	23,226,122.48	1.07
18	600997	开滦股份	22,396,408.56	1.04
19	000778	新兴铸管	20,419,698.53	0.94
20	601186	中国铁建	19,228,540.25	0.89

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。

8.4.2 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	000527	美的电器	46,991,639.18	2.17
2	601818	光大银行	46,589,993.36	2.15
3	000157	中联重科	46,392,408.40	2.15
4	600031	三一重工	45,655,066.53	2.11
5	000708	大冶特钢	45,553,579.68	2.11
6	600016	民生银行	38,627,252.56	1.79
7	600280	南京中商	35,878,262.69	1.66
8	000002	万科 A	33,900,699.73	1.57
9	600585	海螺水泥	33,348,631.47	1.54
10	000401	冀东水泥	31,523,906.82	1.46
11	600153	建发股份	27,974,844.49	1.29
12	600036	招商银行	23,074,024.94	1.07
13	601088	中国神华	21,663,915.86	1.00
14	601628	中国人寿	21,220,785.80	0.98
15	600533	栖霞建设	20,614,319.80	0.95
16	600887	伊利股份	20,588,180.96	0.95
17	000778	新兴铸管	19,893,784.90	0.92
18	601186	中国铁建	18,856,191.36	0.87
19	002024	苏宁电器	18,669,198.24	0.86
20	601006	大秦铁路	18,260,668.83	0.84

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。

8.4.3 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	1,083,553,198.32
卖出股票的收入（成交）总额	887,729,650.13

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。

8.5 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	239,632,000.00	10.21
2	央行票据	485,470,000.00	20.68
3	金融债券	458,307,000.00	19.52
	其中：政策性金融债	458,307,000.00	19.52
4	企业债券	3,900,969.50	0.17
5	企业短期融资券	837,617,000.00	35.68
6	可转债	1,770,383.90	0.08
7	其他	-	-
8	合计	2,026,697,353.40	86.32

8.6 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	1001070	10 央行票据 70	3,000,000	291,390,000.00	12.41
2	019021	10 国债 21	2,000,000	199,840,000.00	8.51
3	1001077	10 央行票据 77	2,000,000	194,080,000.00	8.27
4	090301	09 进出 01	1,800,000	179,334,000.00	7.64
5	1081419	10 苏交通 CP03	1,000,000	99,870,000.00	4.25
	080403	08 农发 03	1,000,000	99,870,000.00	4.25

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,151,523.53
5	应收申购款	8,880.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,410,403.92

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002529	海源机械	34,384,000.00	1.46	新股网下申购
2	300134	大富科技	15,420,504.00	0.66	新股网下申购
3	002497	雅化集团	11,289,404.70	0.48	新股网下申购

§9 基金份额持有人信息

9.1 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

24,875	93,436.09	76,267,062.02	3.28%	2,247,955,779.81	96.72%
--------	-----------	---------------	-------	------------------	--------

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	866,256.93	0.04%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年6月12日)基金份额总额	3,186,908,566.53
本报告期期初基金份额总额	2,055,565,169.60
本报告期基金总申购份额	1,575,778,215.15
减：本报告期基金总赎回份额	1,236,853,893.36
本报告期基金拆分变动份额	-70,266,649.56
本报告期期末基金份额总额	2,324,222,841.83

注：本报告期内，本基金由第二个保本期转入第三个保本期，其中，过渡期最后一个工作日即 2010 年 7 月 1 日为本基金份额折算日。本基金对在折算日登记在册的基金份额持有人所持有的基金份额（包括过渡期申购的基金份额和第二个保本期结束后默认转入第三个保本期的基金份额），以折算日的基金估值为基础，在基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整。经本公司计算，并经本基金托管人中国银行股份有限公司复核，2010 年 7 月 1 日本基金折算前的基金份额净值为 0.976 元，依据前述折算规则确定的折算比例为 0.976184297。折算后本基金的总份额由 2,950,433,522.32 份调整为 2,880,166,872.76 份，基金份额净值调整为 1.000 元。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 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：

2010 年 4 月 30 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关于聘任副总经理的公告》，经本基金管理人第四届董事会第 23 次会议审议通过，同意聘任梁之平先生担任公司副总经理。梁之平先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准（证监许可[2010]472 号文）。

2010 年 9 月 15 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关于聘任副总经理的公告》，经本基金管理人董事会审议通过，决定聘任余荣权先生担任公司副总经理。余荣权先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准（证监许可[2010]1198 号文）。

报告期内，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 100,000.00 元，目前的审计机构已提供审计服务的年限为 5 年。

11.6 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、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣	

			股票成交总额的比例		金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	1,805,290,364.56	100.00%	1,512,409.93	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。

11.7.2 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
国泰君安证券股份有限公司	280,727,989.13	100.00%	5,570,900,000.00	100.00%	-	-