

国泰金龙债券证券投资基金 2015 年半年度报告

公告日期：2015 年 8 月 28 日

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

项目	数值	
基金名称	国泰金龙债券证券投资基金	
基金简称	国泰金龙债券	
场内简称	-	
基金主代码	020002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003-12-05	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	471,312,525.44	
基金合同存续期	不定期	
下属 2 级基金的基金简称	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
下属 2 级基金的场内简称	-	-
下属 2 级基金的交易代码	020002	020012
报告期末下属 2 级基金的份 额总额	355590364.11	115722161.33

投资目标	在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。
投资策略	以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。在对拟公开发行股票的公司进行充分研究的基础上，择机参与拟公开发行股票的申购。因申购所持有的股票资产自可上市交易之日起在 180 个自然日内卖出；因可转债转股所持有的股票资产自可上市交易之日起在 180 个自然日内卖出。

业绩比较基准	本基金以中信全债指数收益率作为衡量基金业绩的比较基准。
风险收益特征	本基金属于收益稳定、风险较低的品种。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国泰基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
姓名	林海中	廖原
信息披露负责人	联系电话 021-31081600 转	021-61618888
电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话	(021) 31089000, 400-888-8688	95528
传真	021-31081800	021-63602540
注册地址	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼	上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码	200082	200120
法定代表人	唐建光	吉晓辉

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中心	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

金额单位：

期间数据和指标	报告期（2015-01-01 至 2015-06-30）		
	国泰金龙债券	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
本期已实现收益	-	58,115,484.97	5,612,163.68
本期利润	-	39,034,182.76	5,588,767.46
加权平均基金份额本期利润	-	0.0747	0.0638
本期加权平均净值利润率	-%	7.05%	6.06%

本期基金份额净值增长率	-%	6.59%	6.39%
<b>报告期末 (2015-06-30)</b>			
<b>期末数据和指标</b>	<b>国泰金龙债券</b>	<b>国泰金龙债券 A</b>	<b>国泰金龙债券 C</b>
期末可供分配利润	-	25,044,989.85	7,908,790.39
期末可供分配基金份额利润	-	0.0704	0.0683
期末基金资产净值	-	380,635,353.96	123,630,951.72
期末基金份额净值	-	1.070	1.068
<b>报告期末 (2015-06-30)</b>			
<b>累计期末指标</b>	<b>国泰金龙债券</b>	<b>国泰金龙债券 A</b>	<b>国泰金龙债券 C</b>
基金份额累计净值增长率	-%	97.30%	92.81%
期末还原后基金份额累计净值	-	-	-

注：(1)经中国证监会批准，国泰金龙债券基金于2008年6月3日刊登公告，自2008年6月5日起增加收取销售服务费的C类收费模式。

(2)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。

(3)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，计入费用实际收益水平要低于所列数字。

#### 本报告期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 A

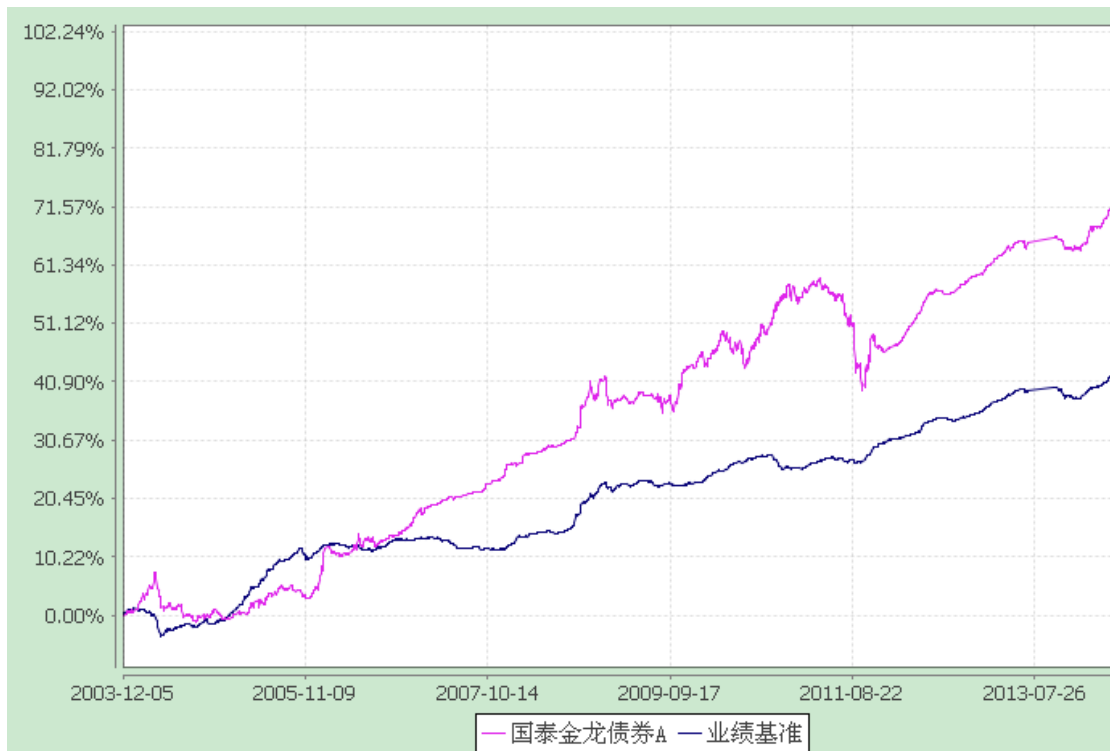
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.28%	0.10%	0.22%	0.04%	-0.50%	0.06%
过去三个月	2.98%	0.14%	1.20%	0.04%	1.78%	0.10%
过去六个月	6.59%	0.18%	1.82%	0.08%	4.77%	0.10%
过去一年	13.76%	0.19%	7.26%	0.16%	6.50%	0.03%
过去三年	26.12%	0.13%	14.65%	0.10%	11.47%	0.03%
自基金合同生效起至今	97.30%	0.22%	53.84%	0.09%	43.46%	0.13%

#### 本报告期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 C

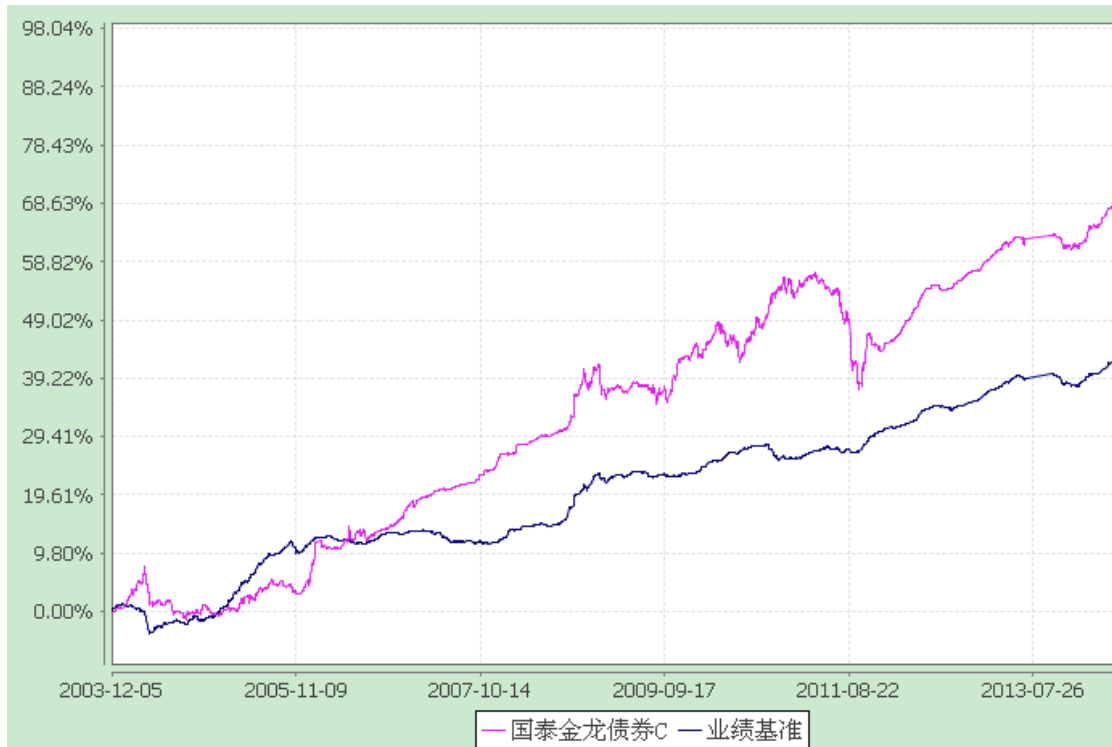
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

	准差②	收益率③	收益率标准差④			
过去一个月	-0.28%	0.11%	0.22%	0.04%	-0.50%	0.07%
过去三个月	2.89%	0.14%	1.20%	0.04%	1.69%	0.10%
过去六个月	6.39%	0.18%	1.82%	0.08%	4.57%	0.10%
过去一年	13.46%	0.19%	7.26%	0.16%	6.20%	0.03%
过去三年	24.85%	0.13%	14.65%	0.10%	10.20%	0.03%
自基金合同生效起至今	92.81%	0.22%	53.84%	0.09%	38.97%	0.13%

自基金合同生效以来基金累计份额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 A



自基金合同生效以来基金累计份额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 C



### 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 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 54 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、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基

姓名	职务	任本基金的基金经		证券从业年限	说明
		任期 任职日期	离任日 期		
吴晨	本基金的基金经 理、国泰信用互 利分级债券、国 泰双利债券的基 金经理，绝对收 益投资（事业） 部副总监	2010-04-29 -	13 年		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证券投资基金的基金经理；2010 年 9 月至 2011 年 11 月担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2011 年 12 月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理；2012 年 9 月至 2013 年 11 月兼任国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 10 月起兼任国泰双利债券证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月起任绝对收益投资（事业）部总监助理，2015 年 5 月起任绝对收益投资（事业）部副总监。

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。

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，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，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。

### **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 $\geq 30$ ），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。

### **公平交易制度和控制方法**

-

### **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**

### **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。

### **报告期内基金投资策略和运作分析**

上半年国内经济延续前期态势，增长乏力，制造业投资放缓，在房地产销量放缓的背景下，房地产投资的增速较难保持。消费方面，由于季节性和限制三公消费等因素，整体上也难有起色。同时 CPI 当



月同比连续低于 2%的水平，也给货币政策放松提供良好环境。在此背景下央行积极响应国务院降低社会融资成本的号召，上半年连续通过降息降准以及定向措施来向市场释放流动性，债券市场收益率走了个 v 型走势，一季度受基本面以及货币政策放松影响，10 年国开收益率下了 30 个 bp 左右，二季度以后由于市场对于地方政府债务置换的担忧，基本面疲弱以及货币政策持续宽松的情况并没有主导债券市场，市场收益率有明显回升，二季度末长期利率债的收益率水平基本回到今年年初水平。由于货币市场资金充裕，二季度开始短端收益率下行非常明显，期限利差大幅扩大，信用利差也有一定收窄。转债市场呈现明显的过山车走势，1、2 月有相当幅度的调整，4、5 月转债大幅上涨，而 6 月下半月随股票市场的大幅调整，相当多的转债跌幅接近 50%，有些已经跌破年初价格。

本基金在上半年维持相对中性的组合久期，适当进行了波段操作，同时对持仓品种进一步进行排查、梳理，进行结构调整，在 1 月中旬降低了转债仓位，4 月初时适当增加转债投资比例，在 6 月上旬开始逐步降低仓位。

### 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 在 2015 年上半年的净值增长率为 6.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

国泰金龙债券 C 在 2015 年上半年的净值增长率为 6.39%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

展望 2015 年下半年，经济震荡下行的整体格局难以逆转，预计二季度 GDP 同比增速降至 6.9%，工业增加值同比增速降至 5.8%左右，6 月 CPI 同比增速小幅升至 1.3%，持续低于 2%的水平。6 月信贷约为 9000 亿，社融增量约 1.3 万亿附近，社融余额增速降至 11%，M2 约为 10.6%-10.8%。但财政收入增速稳定、通胀尚无压力，留给了政府较为充足的调节空间，因此经济失速的风险较小。流动性方面，在 M2 及社融余额同比增速皆位于历史低位的情况下，货币政策难以重回紧缩，流动性预期的稳定将对债券市场仍然形成支撑。但是，随着政府刺激政策的不断出台，尤其是房地产政策的调整，使得市场对于经济走出低谷的预期将逐步抬升，央行放松的压力有所减小。但受到地方政府债务置换的压制，预计 2015 年下半年债券市场仍将以震荡为主。

2015 年下半年我们将保持相对中性的组合久期以及持仓结构，维持略低的杠杆水平，进行一定波段操作；在控制风险的情况下参与转债市场投资，积极降低组合波动率，继续寻求基金净值的平稳增长。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。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、风险管理、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。

截止本报告期末，金龙债券 A 基金期末可供分配利润为 25,044,989.85 元，可供分配的份额利润为 0.0704 元。本基金管理人根据本基金基金合同和相关法律法规的规定已于 2015 年 1 月 23 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 1.252 元；于 2015 年 1 月 26 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 1.1572 元。

截止本报告期末，金龙债券 C 基金期末可供分配利润为 7,908,790.39 元，可供分配的份额利润为

0.0683 元。本基金管理人根据本基金基金合同和相关法律法规的规定已于 2015 年 1 月 23 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 1.220 元；于 2015 年 1 月 26 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.9253 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。

无。

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰金龙债券证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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。

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰金龙债券证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为 84,078,088.36 元。

本报告期内，由国泰基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

#### 会计主体：国泰金龙债券证券投资基金

报告截止日：2015-06-30

单位：

资产	本期末 2015-06-30	上年度末 2014-12-31
<b>资产：</b>		
银行存款	515,448.12	19,863,380.67
结算备付金	32,308,758.73	76,529,169.11
存出保证金	111,159.93	39,929.11
交易性金融资产	750,494,334.30	1,373,558,313.98
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	750,494,334.30	1,373,558,313.98
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	85,596.45	26,158,371.54
应收利息	21,256,459.11	30,069,796.94
应收股利	-	-
应收申购款	3,482,996.55	349,753.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	808,254,753.19	1,526,568,714.50
	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2015-06-30</b>	<b>2014-12-31</b>
<b>负债：</b>		
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	301,500,000.00	632,799,999.40
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,046,079.67	45,243,115.86
应付管理人报酬	251,263.24	581,561.48
应付托管费	83,754.40	193,853.82
应付销售服务费	30,841.01	8,676.33
应付交易费用	1,912.50	7,041.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	74,596.69	124,335.89
负债合计	303,988,447.51	678,958,583.78
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	471,312,525.44	752,276,518.56
未分配利润	32,953,780.24	95,333,612.16
所有者权益合计	504,266,305.68	847,610,130.72
负债和所有者权益总计	808,254,753.19	1,526,568,714.50

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，下属 A 类基金的份额净值 1.070 元，下属 C 类基金的份额净值 1.068 元；基金份额总额 504,266,305.68 份，下属 A 类基金的份额总额 380,635,353.96 份，下属 C 类基金的份额总额 123,630,951.72 份。

**会计主体：国泰金龙债券证券投资基金**

**本报告期：2015-01-01 至 2015-06-30**

**单位：**

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
<b>一、收入</b>	51,895,592.10	92,858,369.14
1. 利息收入	27,581,336.84	59,939,780.67
其中：存款利息收入	512,485.83	703,998.31
债券利息收入	27,068,851.01	59,235,782.36
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	43,227,804.93	-201,090.60
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	43,227,804.93	-201,090.60
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）	-19,104,698.43	32,978,556.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	191,148.76	141,122.61
<b>减：二、费用</b>	7,272,641.88	17,068,502.21
1. 管理人报酬	1,935,193.24	4,183,381.93
2. 托管费	645,064.44	1,394,460.66
3. 销售服务费	133,644.21	115,736.50
4. 交易费用	9,572.02	22,622.49
5. 利息支出	4,458,536.40	11,252,501.16
其中：卖出回购金融资产支出	4,458,536.40	11,252,501.16
6. 其他费用	90,631.57	99,799.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	44,622,950.22	75,789,866.93
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	44,622,950.22	75,789,866.93

会计主体：国泰金龙债券证券投资基金  
本报告期：2015-01-01 至 2015-06-30

单位:

项目	本期		
	2015-01-01 至 2015-06-30		
	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）	752,276,518.56	95,333,612.16	847,610,130.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,622,950.22	44,622,950.22
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）	-280,963,993.1	-22,924,693.7	-303,888,686.9
其中：1. 基金申购款	2	8	0
2. 基金赎回款	378,089,940.05	17,528,630.24	395,618,570.29
	-659,053,933.1	-40,453,324.0	-699,507,257.1
	7	2	9
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）	-	-84,078,088.3	-84,078,088.36
		6	
五、期末所有者权益（基金净值）	471,312,525.44	32,953,780.24	504,266,305.68
项目	上年度可比期间		
	2014-01-01 至 2014-06-30		
	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）	1,001,581,794.20	1,571,246.72	1,003,153,040.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	75,789,866.93	75,789,866.93
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）	556,812,689.16	9,476,385.68	566,289,074.84
其中：1. 基金申购款	1,071,505,071.09	24,795,603.99	1,096,300,675.08
2. 基金赎回款	-514,692,381.9	-15,319,218.3	-530,011,600.2
	3	1	4
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）	1,558,394,483.36	86,837,499.33	1,645,231,982.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张峰 主管会计工作负责人：巴立康

会计机构负责人：王嘉浩

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

## 基金基本情况

国泰金龙系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 114 号《关于同意国泰金龙系列证券投资基金设立的批复》核准,由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《国泰金龙系列证券投资基金基金契约》(后更名为《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 12 月 5 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设两个子基金,分别为国泰金龙债券证券投资基金(以下简称“本基金”)和国泰金龙行业精选证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,570,221,715.39 元,其中包括本基金人民币 1,886,120,977.36 元和国泰金龙行业精选证券投资基金人民币 684,100,738.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 174 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》和《国泰金龙系列证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自 2008 年 6 月 5 日起,本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为 A 类;新增的从本类别基金资产中计提销售服务费(赎回时持有期在 30 天以内,另收取 0.1%的赎回费)的基金类别,称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为在国内依法公开发行的各种固定收益类金融工具(包括资产支持证券和可分离转债等新的固定收益产品)和参与拟公开发行股票的申购及可转债转股后所持有的股票,以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。投资债券类资产的总比例不低于基金资产的 80%,投资于股票资产的比例不高于基金资产的 20%,投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中信全债指数收益率。

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 2015 年 8 月 26 日批准报出。

### **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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《国泰金龙系列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。

### **遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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。

### **重要会计政策和会计估计**

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致,会计估计较最近一期年度报告有变更。

### **会计年度**

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

-

会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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。

## 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。

## 重要财务报表项目的说明

### 银行存款

单位：

项目	本期末	
	2015-06-30	
活期存款		515,448.12
定期存款		-
其中：存款期限1-3个月		-
其他存款		-
合计		515,448.12

### 交易性金融资产

单位：

项目	本期末		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
交易所市场	489,535,872.06	496,777,534.30	7,241,662.24
债券    银行间市场	251,066,347.42	253,716,800.00	2,650,452.58
合计	740,602,219.48	750,494,334.30	9,892,114.82



资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	740,602,219.48	750,494,334.30	9,892,114.82

### 衍生金融资产/负债

单位：

项目	本期末 2015-06-30			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 买入返售金融资产

#### 各项买入返售金融资产期末余额

单位：元

项目	本期末 2015-06-30	
	账面余额	其中：买断式逆回购

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：元

项目	本期末 2015-06-30						
	债券代 码	债券名 称	约定返售 日	估值单 价	数量（张 ）	估值总 额	其中：已出售或再质押
							总额

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 应收利息

单位：

项目	本期末 2015-06-30
应收活期存款利息	3,544.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,085.01
应收债券利息	21,239,583.26
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	201.46
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	45.00
合计	21,256,459.11

### 其他资产

单位:

项目	本期末 2015-06-30
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	-

注: 本基金本报告期末无其他资产余额。

### 应付交易费用

单位:

项目	本期末 2015-06-30
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,912.50
合计	1,912.50

### 其他负债

单位:

项目	本期末 2015-06-30
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,170.52
其他应付款	-
预提费用	69,426.17
合计	74,596.69

### 实收基金

单位:

项目	本期末 2015-06-30			
	国泰金龙债券 A		国泰金龙债券 C	
	基金份额 (份)	账面金额	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	724,867,556.38	724,867,556.38	27,408,962.18	27,408,962.18
本期申购	148,260,363.31	148,260,363.31	229,829,576.74	229,829,576.74
本期赎回 (以“-”号填列)	-517,537,555.58	-517,537,555.58	-141,516,377.59	-141,516,377.59
基金拆分/份额折	-	-	-	-

算前				
基金拆分/份额折				
算调整	-		-	
本期申购	-		-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-		-	-
本期末	355,590,364.11	355,590,364.11	115,722,161.33	115,722,161.33

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 未分配利润

单位：

项目	国泰金龙债券 A			国泰金龙债券 C		
	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	58,115,484.97	-19,081,302.21	39,034,182.76	5,612,163.68	-23,396.22	5,588,767.46
本期基金份额交易产生的变动数	-34,557,373.11	8,193,188.87	-26,364,184.24	6,604,082.83	-3,164,592.37	3,439,490.46
其中：基金申购款	11,643,379.04	-4,369,870.81	7,273,508.23	17,330,499.19	-7,075,377.18	10,255,122.01
基金赎回款	-46,200,752.15	12,563,059.68	-33,637,692.47	-10,726,416.36	3,910,784.81	-6,815,631.55
本期已分配利润	-79,570,584.07	-	-79,570,584.07	-4,507,504.29	-	-4,507,504.29
本期末	34,715,658.18	-9,670,668.33	25,044,989.85	11,053,166.19	-3,144,375.80	7,908,790.39

### 存款利息收入

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
活期存款利息收入	168,822.14
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	332,708.14
其他	10,955.55
合计	512,485.83

### 股票投资收益

#### 股票投资收益项目构成

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30

股票投资收益——买卖股票差价收入	-
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-

注：本报告期本基金未进行股票交易。

#### 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
卖出股票成交总额	-
减：卖出股票成本总额	-
买卖股票差价收入	-

#### 股票投资收益——赎回差价收入

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回股票成本总额	-
赎回差价收入	-

#### 股票投资收益——申购差价收入

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
申购基金份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购股票成本总额	-
申购差价收入	-

#### 基金投资收益

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
基金投资收益	-

#### 债券投资收益

##### 债券投资收益项目构成

单位:

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付 ) 差价收入	43,227,804.93	-
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	43,227,804.93	-201,090.60

#### 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	911,168,324.02	-
减:卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	840,353,716.03	-
减:应收利息总额	27,586,803.06	-
买卖债券差价收入	43,227,804.93	-

#### 债券投资收益——赎回差价收入

单位:

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
赎回基金份额对价总额	-	-
减:现金支付赎回款总额	-	-
减:赎回债券成本总额	-	-
减:赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

#### 债券投资收益——申购差价收入

单位:

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
申购基金份额对价总额	-	-
减:现金支付申购款总额	-	-
减:申购债券成本总额	-	-
减:申购债券应收利息总额	-	-

申购差价收入	-	-
--------	---	---

### 资产支持证券投资收益

单位：

项目	本期	
	2015-01-01 至 2015-06-30	
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 贵金属投资收益

#### 贵金属投资收益项目构成

单位：

项目	本期	
	2015-01-01 至 2015-06-30	
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

#### 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：

项目	本期	
	2015-01-01 至 2015-06-30	
卖出贵金属成交总额	-	-
减：卖出贵金属成本总额	-	-
买卖贵金属差价收入	-	-

#### 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：

项目	本期	
	2015-01-01 至 2015-06-30	
赎回贵金属份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回贵金属成本总额	-	-
赎回差价收入	-	-

#### 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
申购差价收入	-

### 衍生工具收益

#### 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 衍生工具收益——其他投资收益

项目	本期收益金额
	2015-01-01 至 2015-06-30

### 股利收益

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
股票投资产生的股利收益	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	-

注：本基金本报告期无股利收益。

### 公允价值变动收益

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
1. 交易性金融资产	-19,104,698.43
——股票投资	-
——债券投资	-19,104,698.43
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-19,104,698.43

### 其他收入

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
基金赎回费收入	181,658.06
转换费收入	9,490.70
合计	191,148.76

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

### 交易费用

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
交易所市场交易费用	919.52
银行间市场交易费用	8,652.50
合计	9,572.02

### 其他费用

单位：

项目	本期
	2015-01-01 至 2015-06-30
审计费用	44,630.98
信息披露费	24,795.19
银行汇划费用	3,005.40
债券账户服务费	18,200.00
合计	90,631.57

### 分部报告

-

#### 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）	受基金管理人的控股股东（中国建投）控制的公司

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。

### 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 通过关联方交易单元进行的交易

##### 股票交易

单位：元

关联方名称	本期 2015-01-01 至 2015-06-30		上年度可比期间 2014-01-01 至 2014-06-30	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

##### 债券交易

金额单位：

关联方名称	本期 2015-01-01 至 2015-06-30		上年度可比期间 2014-01-01 至 2014-06-30	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源	457,777,928.54	95.22%	-	-%

注：本基金上年度可比期间无通过关联方交易单元进行交易。

##### 债券回购交易

金额单位：

关联方名称	本期 2015-01-01 至 2015-06-30		上年度可比期间 2014-01-01 至 2014-06-30	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
申万宏源	41,410,100,000.00	100.00%	-	-%

注：本基金上年度可比期间无通过关联方交易单元进行交易。

##### 权证交易

单位：元

关联方名称	本期 2015-01-01 至 2015-06-30		上年度可比期间 2014-01-01 至 2014-06-30	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

#### 应支付关联方的佣金

单位：元

关联方名称	本期 2015-01-01 至 2015-06-30			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
	上年度可比期间			
关联方名称	2014-01-01 至 2014-06-30			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

### 关联方报酬

#### 基金管理费

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
当期发生的基金应支付的管理费	1,935,193.24	4,183,381.93
其中：支付销售机构的客户维护费	47,645.12	50,635.05

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 0.6% 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 0.6% / 当年天数。

#### 基金托管费

单位：

项目	本期	上年度可比期间
	2015-01-01 至 2015-06-30	2014-01-01 至 2014-06-30
当期发生的基金应支付的管理费	645,064.44	1,394,460.66

注：支付基金托管人浦发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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

#### 销售服务费

单位：

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015-01-01 至 2015-06-30		
	当期应支付的销售服务费		
	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C	合计
浦发银行	-	599.66	599.66
国泰基金管理有限公司	-	95,212.46	95,212.46
申万宏源	-	221.11	221.11
合计	-	96,033.23	96,033.23

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014-01-01 至 2014-06-30		
	当期应支付的销售服务费		
	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C	合计
浦发银行	-	744.95	744.95
国泰基金管理有限公司	-	73,404.43	73,404.43
申万宏源	-	1.68	1.68
合计	-	74,151.06	74,151.06

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

#### 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2015-01-01 至 2015-06-30					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
	上年度可比期间					
	2014-01-01 至 2014-06-30					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 各关联方投资本基金的情况

#### 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		上年度可比期间	
	2015-01-01 至 2015-06-30		2014-01-01 至 2014-06-30	
份额级别	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
基金合同生效日（2003-12-05）持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-

期末持有的基金份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：本报告期间及上年度可比期间基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

#### 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

项目	国泰金龙债券 A			
	本期末		上年度末	
	2015-06-30		2014-12-31	
	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
项目	国泰金龙债券 C			
	本期末		上年度末	
	2015-06-30		2014-12-31	
	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

#### 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：

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015-01-01 至 2015-06-30		2014-01-01 至 2014-06-30	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	515,448.12	168,822.14	5,998,658.71	218,625.44

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

#### 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期	
				2015-01-01 至 2015-06-30	基金在承销期内买入数量（单位：股/张）
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间	
				2014-01-01 至 2014-06-30	基金在承销期内买入数量（单位：股/张）
浦发银行	041464043	14 兵团建工 CP001	新债网下分销	300,000.0	30,000

0 ,000.0  
0

注：上年度本基金新债网下分销 14 兵团建工 CP001 系通过分销商平安证券买入。

### 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。

### 利润分配情况

### 期末（2015-06-30）本基金持有的流通受限证券

#### 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：元

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
受限证券类别：债券										
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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限股票。

#### 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：元

股票代 码	股票名 称	停牌日 期	停牌原 因	期末估 值单价	复牌日 期	复牌开 盘单价	数量（股 ）	期末成 本总额	期末估 值总额	备注
----------	----------	----------	----------	------------	----------	------------	-----------	------------	------------	----

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	--------	-------	--------

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。

金额单位：元

### 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，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 301,500,000.00 元，于 2015 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。

### 金融工具风险及管理

#### 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括债券投资和新股申购。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工

具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值”的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行浦发银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 按短期信用评级列示的债券投资

单位：元

短期信用评级	本期末	上年度末
	2015-06-30	2014-12-31
A-1	253,716,800.00	430,618,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	253,716,800.00	430,618,000.00

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、超短期融资券、中央银行票据或政策性金融债。

#### 按长期信用评级列示的债券投资

单位：元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2015-06-30	2014-12-31
AAA	6,571,383.10	74,465,281.60
AAA 以下	467,112,111.20	823,431,032.38

未评级	23,094,040.00	45,044,000.00
合计	496,777,534.30	942,940,313.98

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、超短期融资券、中央银行票据或政策性金融债。

### 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值或者基金资产净值的40%。

除卖出回购金融资产款余额301,500,000.00元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：元

本期末	合计
2015-06-30	
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-
上年度末	合计
2014-12-31	
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-

流动性净额

-

## 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

## 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 利率风险敞口

单位：元

本期末 2015-06-30	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	515,448	-	-	-	515,448
	.12				.12
结算备付金	32,308,758.73	-	-	-	32,308,758.73
存出保证金	111,159.93	-	-	-	111,159.93
交易性金融资产	276,810,840.00	467,111,069.70	6,572,424.60	-	750,494,334.30
应收证券清算款	-	-	-	85,596.45	85,596.45
应收利息	-	-	-	21,256.459.11	21,256.459.11
应收申购款	-	-	-	3,482,996.55	3,482,996.55
其他资产	-	-	-	-	0.00
资产总计	309,746,206.78	467,111,069.70	6,572,424.60	24,825,052.11	808,254,753.19
卖出回购金融资产款	301,500,000.00	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00



应付赎回款	-	-	-	2,046,079.67	2,046,079.67
应付管理人报酬	-	-	-	251,263.24	251,263.24
应付托管费	-	-	-	83,754.40	83,754.40
应付销售服务费	-	-	-	30,841.01	30,841.01
应付交易费用	-	-	-	1,912.50	1,912.50
应交税费	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	74,596.69	74,596.69
负债总计	301,500,000.00	-	-	2,488,447.51	303,988,447.51
利率敏感度缺口	8,246,206.78	467,111,069.70	6,572,424.60	22,336,604.60	504,266,305.68
<b>上年度末</b>					
<b>2014-12-31</b>				<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>
				<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>
					<b>合计</b>
资产					
银行存款	19,863,380.67	-	-	-	19,863,380.67
结算备付金	76,529,169.11	-	-	-	76,529,169.11
存出保证金	39,929.11	-	-	-	39,929.11
交易性金融资产	764,936,842.18	509,945,014.00	98,676,457.80	-	1,373,558,313.98
应收证券清算款	-	-	-	26,158,371.54	26,158,371.54
应收利息	-	-	-	30,069,796.94	30,069,796.94
应收申购款	10,000.00	-	-	339,753.15	349,753.15
资产总计	861,379,321.07	509,945,014.00	98,676,457.80	56,567,921.63	1,526,568,714.50
卖出回购金融资产	632,799,999.40	-	-	-	632,799,999.40

款					
应付赎回				45,243,	45,243,
款	-	-	-	115.86	115.86
应付管理				581,561	581,561
人报酬	-	-	-	.48	.48
应付托管				193,853	193,853
费	-	-	-	.82	.82
应付销售				8,676.3	8,676.3
服务费	-	-	-	3	3
应付交易				7,041.0	7,041.0
费用	-	-	-	0	0
应付赎回				34,335.	34,335.
费	-	-	-	89	89
其他负债				90,000.	90,000.
				00	00
负债总计	632,799			46,158,	678,958
	,999.40			584.38	,583.78
利率敏感	228,579	509,945	98,676,	10,409,	847,610
度缺口	,321.67	,014.00	457.80	337.25	,130.72

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 利率风险的敏感性分析

假设 除市场利率外其他市场变量不变			
对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）			
相关风险变量的变动	本期末	上年度末	
分析	2015-06-30	2014-12-31	
市场利率上升 25 个基点	-2,973,554.71	-7,636,624.53	
市场利率下降 25 个基点	3,000,068.83	7,721,130.98	

### 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

#### 外汇风险敞口

单位：元

项目	本期末			合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
	上年度末			
	2014-12-31			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

### 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）		
分析	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2015-06-30	2014-12-31

注：本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券类资产的总比例不低于基金资产的80%，投资于股票资产的比例不高于基金资产的20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 其他价格风险敞口

金额单位：元

项目	本期末		上年度末	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—				
股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—	-	-	-	-

基金投资				
交易性金融资产—				
债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—				
贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权				
证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2014 年 12 月 31 日：无），因此无其他价格风险敞口（2014 年 12 月 31 日：同）。

### 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2015-06-30	上年度末 2014-12-31

注：本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例低于 20%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

### 采用风险价值法管理风险

假设	-		
分析	风险价值（金额单位：元）	本期末 2015-06-30	上年度末 2014-12-31

### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 6,570,349.10 元，属于第二层次的余额为 743,923,985.20 元，无属于第三层次的余额（2014 年 12 月 31 日：第一层次 922,936,894.80 元，第二层次 450,621,419.18 元，无第三层次）。

(ii) 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，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的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月25日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

金额单位：元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	750,494,334.30	92.85
	其中：债券	750,494,334.30	92.85
	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	32,824,206.85	4.06
7	其他各项资产	24,936,212.04	3.09
8	合计	808,254,753.19	100.00

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值(元)	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、煤气及水的生产和供应业	-	-
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	-	-
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	综合类	-	-
	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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：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（%）
----	------	------	----------	----------------

#### 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：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（%）
----	------	------	----------	----------------

#### 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本（成交）总额	-
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本基金本报告期内没有进行股票交易。

金额单位：元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	23,094,040.00	4.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	466,412,145.20	92.49
5	企业短期融资券	253,716,800.00	50.31

6	中期票据		-	-
7	可转债		7,271,349.10	1.44
8	其他		-	-
9	合计		750,494,334.30	148.83

金额单位：元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122849	11 新余债	604,260	62,130,013.20	12.32
2	041452052	14 华信石油 CP001	600,000	60,816,000.00	12.06
3	122776	11 新光债	420,000	42,214,200.00	8.37
4	122844	11 筑城投	360,500	37,207,205.00	7.38
5	122833	11 赣城债	344,940	35,439,135.60	7.03

金额单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。



金额单位：元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	-------	-------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

金额单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
	公允价值变动总额合计（元）			-	
	股指期货投资本期收益（元）			-	
	股指期货投资本期公允价值变动（元）			-	

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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。

### 本期国债期货投资政策

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)				-	
国债期货投资本期收益(元)				-	
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	

### 本期国债期货投资评价

### 定期报告披露的投资的前十只证券的投资是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告披露的基金投资的前十只证券的投资是否超出基金合同规定的备选股票库。编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

### 期末其他各项资产构成

			单位：元
序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金	111,159.93	
2	应收证券清算款	85,596.45	
3	应收股利	-	
4	应收利息	21,256,459.11	
5	应收申购款	3,482,996.55	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	其他	-	
9	合计	24,936,212.04	

### 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

				金额单位：元
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。				



报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值（元）	占基金资产净值比 例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	--------------------	------------------	----------

注：本基金本报告期末未持有股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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，经托管人决定，邓从国同志自 2015 年 4 月 1 日起担任资产托管与养老金业务部总经理职务。

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。

报告期内，本基金投资策略无改变。

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。

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：元

券商 名称	交易 单元 数量	股票交易		基金交易		债券交易		债券回购交 易		权证交易		应支付该券 商的佣金		备注
		成交 金额	占当 期比 例	成交 金额	占当 期比 例	成交金 额	占当 期比 例	成交金 额	占 当 期 比 例	成交 金额	占当 期比 例	成交 金额	占当 期比 例	
申万 宏源	2	-	-%	-	-%	457,777.92	95.22%	41,410,100.00	100.00%	-	-%	-	-%	-

国泰					22,99	4.7							
君安	1	-	-%	-	-%	5,637	8%	-	-%	-	-%	-	-%
					.19								

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：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰金龙债券证券投资基金分红公告	《中国证券报》	2015-01-16
2	国泰基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员及其他从业人员子公司兼职情况公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2015-01-31
3	国泰基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2015-03-26
4	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-06-24

份额单位：份

份额级别	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
国泰金龙债券 A	4,007	88,742.29	303,991,642.53	85.49%	51,598,721.58	14.51%
国泰金龙债券 C	2,648	43,701.72	89,120,341.21	77.01%	26,601,820.12	22.99%
合计	6,655	70,820.82	393,111,983.74	83.41%	78,200,541.70	16.59%

项目	份额级别	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	国泰金龙债券 A	93.86	0.00%
	国泰金龙债券 C	186.78	0.00%
	合计	280.64	0.00%

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰金龙债券 A	0
	国泰金龙债券 C	0
	合计	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰金龙债券 A	0
	国泰金龙债券 C	0
	合计	0

单位：份

项目	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
基金合同生效日的基金份额总额	-	-
本报告期期初基金份额总额	724,867,556.38	27,408,962.18
本报告期基金总申购份额	148,260,363.31	229,829,576.74
减：本报告期基金总赎回份额	517,537,555.58	141,516,377.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	355,590,364.11	115,722,161.33

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-%	-	-%	-
基金管理人高级管理人员	-	-%	-	-%	-
基金经理等人员	-	-%	-	-%	-
基金管理人股	-	-%	-	-%	-

东					
其他	-	-%	-	-%	-
合计	-	-%	-	-%	-

-

- 1、关于同意国泰金龙系列证券投资基金募集的批复
- 2、国泰金龙系列证券投资基金基金合同
- 3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16-19 层。

可咨询本基金管理人：部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>