

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: 二〇一一年八月二十九日

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

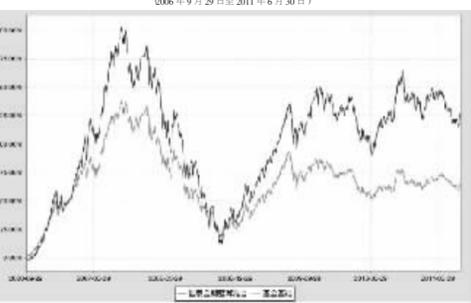
2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

Table with 2 columns: 1. 基金基本情况 (Fund Basic Information), 2. 基金简介 (Fund Introduction). Includes fund name, codes, and investment objectives.

Table with 2 columns: 3. 主要财务数据和财务指标 (Key Financial Data and Indicators), 4. 净值表现 (Performance). Includes quarterly and annual returns.

Table with 2 columns: 5. 基金管理人及基金托管人 (Fund Manager and Custodian), 6. 基金经理 (Fund Manager). Lists names and roles.



注:本基金的合同生效日为2006年9月29日。本基金在六个月建仓期时,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人基本情况
4.1.2 基金托管人基本情况

Table with 2 columns: 基金管理人及基金托管人 (Fund Manager and Custodian). Lists names and roles.

4.2 基金经理
4.2.1 基金经理简介
4.2.2 基金经理变更情况

4.3 基金管理人内部控制制度
4.3.1 内部控制制度的执行情况
4.3.2 基金管理人内部控制制度的完善性

金鹏”的过程中,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。

6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体: 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
报告截止日: 2011年6月30日

Table with 2 columns: 资产负债表 (Balance Sheet). Shows assets and liabilities as of 2011-06-30 and 2010-12-31.

Table with 2 columns: 利润表 (Income Statement). Shows income and expenses for the period.

6.2 利润分配
会计主体: 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
本报告期: 2011年1月1日至2011年6月30日

Table with 2 columns: 现金流量表 (Cash Flow Statement). Shows cash inflows and outflows.

6.3 所有者权益 (基金份额)变动表
会计主体: 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
本报告期: 2011年1月1日至2011年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益 (基金份额)变动表 (Statement of Changes in Equity). Shows changes in fund assets.

报告附注为财务报表的组成部分。本报告自6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

6.4 关联方关系
6.4.1 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方关系:

Table with 2 columns: 关联方关系 (Related Party Relationships). Lists related parties.

6.4.2 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方交易:

Table with 2 columns: 关联方交易 (Related Party Transactions). Shows transactions with related parties.

6.4.3 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方交易:

Table with 2 columns: 关联方交易 (Related Party Transactions). Shows transactions with related parties.

6.4.4 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方交易:

Table with 2 columns: 关联方交易 (Related Party Transactions). Shows transactions with related parties.

6.4.5 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方交易:

Table with 2 columns: 关联方交易 (Related Party Transactions). Shows transactions with related parties.

6.4.6 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方交易:

Table with 2 columns: 关联方交易 (Related Party Transactions). Shows transactions with related parties.

6.4.7 本报告期末及上年度末,本报告存在以下关联方交易:

Table with 2 columns: 关联方交易 (Related Party Transactions). Shows transactions with related parties.

Table with 2 columns: 当期发生的基金应支付的管理费 (Management Fees). Shows fee details for the period.

6.4.4.2 基金托管费
会计主体: 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
报告截止日: 2011年6月30日

Table with 2 columns: 当期发生的基金应支付的托管费 (Custodian Fees). Shows fee details for the period.

6.4.4.3 与关联方进行银行同业市场的债券(含回购)交易

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.6 报告期内除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.4.7 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 2 columns: 关联方名称 (Related Party Name). Shows interest income from related parties.

6.4.4.8 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.9 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.10 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.11 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.12 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.13 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.14 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.15 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.16 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.17 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.18 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.19 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.20 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.21 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.22 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.23 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.24 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.25 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.26 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.27 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.28 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.29 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.30 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.31 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.32 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.33 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.34 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.35 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.36 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.37 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.38 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.39 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.40 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.41 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.42 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.43 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.44 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.45 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.46 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.47 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.48 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.49 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.50 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.51 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

6.4.4.52 关联方名称 (Related Party Name). Shows other financial data.

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 本期累计卖出金额 (Total Amount Sold), 占期初基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

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

7.4.3 买入股票的成本及占比和卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票的成本(成交金额) (Cost of Purchases), 卖出股票的收入(成交金额) (Income from Sales).

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交均价乘以成交数量)计算,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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前三名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

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

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期间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没有报告日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 本报告期间基金投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定投资范围之外的情况。

7.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (Amount).

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.9.5 期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动情况

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 公允价值 (Fair Value), 公允价值变动(%) (Percentage Change).

8.1 期末基金持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户数(户) (Number of Holders), 户均持有的基金份额 (Average Shares per Holder), 机构投资者 (Institutional Investors), 个人投资者 (Individual Investors).

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 3 columns: 项目 (Item), 持有基金份额(份) (Number of Shares), 占基金总份额比例(%) (Percentage of Total Shares).

9 开放式基金规模变动

Table with 4 columns: 基金合同生效日 (Contract Effective Date), 基金份额总额(份) (Total Shares), 基金份额净值(元) (Net Asset Value), 基金份额总额(份) (Total Shares).

10.1 基金资产净值及基金份额持有人大会决议

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.3 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.4 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.5 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.6 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.7 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.9 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.10 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.11 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.12 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.13 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.14 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.15 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.16 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.17 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.18 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.19 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.20 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.21 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.22 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.23 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.24 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

10.25 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动