（上接B161版）

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	4,455,438.53	23,954,055.80
1.利息收入	4,455,438.53	23,954,055.80
其中：存款利息收入	2,676,907.08	14,529,413.35
债券利息收入	-	7,822,483.92
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,778,531.45	1,602,158.53
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	-	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
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）	-	-
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	-	-
减：二、费用	644,935.07	3,545,624.09
1.管理人报酬	238,116.36	1,370,370.08
2.托管费	81,953.43	456,790.38
3.销售服务费	32,490.74	1,172,798.21
4.交易费用	-	-
5.利息支出	-	183,182.42
其中：卖出回购金融资产支出	-	183,182.42
6.其他费用	292,374.54	362,483.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	3,810,503.46	20,408,431.71
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	3,810,503.46	20,408,431.71

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰6个月短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月30日(基金合同失效前日）止期间

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12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）	55,980,180.98	-	55,980,180.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,810,503.46	3,810,503.46
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）	-11,922,937.47	-	-11,922,937.47
其中：1.基金申购款	123,980,824.92	-	123,980,824.92
2.基金赎回款	-135,903,762.39	-	-135,903,762.39
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）	-	-3,810,503.46	-3,810,503.46
五、期末所有者权益（基金净值）	44,057,243.51	-	44,057,243.51

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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）	1,739,661,215.46	-	1,739,661,215.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,408,431.71	20,408,431.71
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）	-1,683,681,034.48	-	-1,683,681,034.48
其中：1.基金申购款	165,823,488.31	-	165,823,488.31
2.基金赎回款	-1,849,504,522.79	-	-1,849,504,522.79
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）	-	-20,408,431.71	-20,408,431.71
五、期末所有者权益（基金净值）	55,980,180.98	-	55,980,180.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从7.2.1至7.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈勇胜，主管会计工作负责人：张琼，会计机构负责人：王嘉浩

7.2.4 报表附注

7.2.4.1基金基本情况

国泰6个月短期理财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[2012] 1044号《关于核准国泰6个月短期理财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6个月短期理财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基金，以定期开放方式运作，存续期限不定。本基金的每一封闭期为6个月，自基金合同生效之日起(包括基金合同生效日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日) 至每6个月的对应日止。若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,727,620,660.66元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第372号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰6个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》于2012年9月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,727,904,498.98份基金份额，其中认购资金利息折合283,838.32份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国泰6个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》和《国泰6个月短期理财债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据基金份额持有人在单个基金账户中保留的基金份额数量、或根据基金份额持有人持有基金份额的周期等两个方面，对持有人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用。本基金根据销售服务费用收取费率的不同，将基金份额分为不同的类别。按照0.30%的年费率计提销售服务费的基金份额类别，称为A类；按照0.01%的年费率计提销售服务费的基金份额类别，称为B类。本基金A类、B类两种收费模式并存，各类基金份额分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级，不同基金份额等级之间不得互相转换，但因认购、申购、赎回、基金转换等交易、或因基金份额持有数量和周期的不同而发生的基金份额自动升级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰6个月短期理财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现金、银行定期存款、协议存款、大额存单、债券回购、国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、地方政府债、企业债、公司债、次级债、资产支持证券等固定收益类金融工具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。在每个封闭期，本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金不可投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日的银行6个月定期存款利率(税后)。

根据本基金份额持有人大会 2014年12月1日决议通过的《关于国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于2014年12月2日发布《国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效及相关事项的公告》。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》、中国证监会《关于准予国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金变更注册的批复》和《国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效及相关事项的公告》 等的有关规定，《国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》自2014 年12 月31 日起失效，《国泰创利债券型证券投资基金基金合同》于同一日起生效，同时本基金更名为国泰创利债券型证券投资基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于2015年3月26日批准报出。

7.2.4.2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日及以后期间颁布的《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6个月短期理财债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.2.4.4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。

经中国证监会批准，基金管理人国泰基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为国泰创利债券型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.2.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年1月1日至2014年12月30日(基金合同失效前日)止期间的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12月30日(基金合同失效前日)的财务状况以及2014年1月1日至2014年12月30日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.2.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布 《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.2.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.5.3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。

7.2.4.6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》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，包括买卖债券的差价收入，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。

7.2.4.7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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
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
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东

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。

7.2.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1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无通过关联方交易单元进行的交易。

7.2.4.8.2关联方报酬

7.2.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	238,116.36	1,370,370.08
其中：支付销售机构的客户维护费	62,620.48	1,018,681.67

注：在通常情况下，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0.27%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 ＊ 0.27% / 当年天数。在开放期内，本基金不计提管理费。

7.2.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	81,953.43	456,790.38

注：在通常情况下，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.09%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 ＊ 0.09% / 当年天数。在开放期内，本基金不计提托管费。

7.2.4.8.2.3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12月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰6个月短期理财债券A	国泰6个月短期理财债券B	合计
中国建设银行	19,926.02	3,464.38	23,390.40
国泰基金管理有限公司	835.24	4,467.32	5,302.56
合计	20,761.26	7,931.70	28,692.96

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰6个月短期理财债券A	国泰6个月短期理财债券B	合计
国泰基金管理有限公司	1,438.25	1,340.07	2,778.32
中国建设银行	1,081,185.43	8,394.00	1,089,579.43
合计	1,082,623.68	9,734.07	1,092,357.75

注：在通常情况下，支付基金销售机构的A类基金份额和B类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值0.30%和0.01%的年费率计提。其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值 X约定年费率 / 当年天数。在开放期内，本基金不计提销售服务费。

7.2.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1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。

7.2.4.8.4.2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。

7.2.4.8.5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12月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国建设银行	8,254,846.26	48,361.33	585,227.11	232,438.89

注：本基金的活期银行存款由基金托管人 中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.9期末（2014年12月30日(基金合同失效前日)）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1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/增发证券而流通受限的证券。

7.2.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

7.2.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.9.3.1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。

7.2.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.2.4.10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)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2014年12月30日(基金合同失效前日)，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(2013年12月31日：无)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月30日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

(d)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。

(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国泰创利债券型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2014年12月31日）

8.1.1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	140,488.00	0.28
	其中：债券	140,488.00	0.28
	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	20,930,143.90	42.35
	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	28,249,378.61	57.16
7	其他各项资产	97,773.56	0.20
8	合计	49,417,784.07	100.00

8.1.2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。

8.1.3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。

8.1.4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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	140,488.00	0.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	140,488.00	0.32

8.1.5 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	124716	14宁国债	1,360	140,488.00	0.32

8.1.6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。

8.1.7 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。

8.1.8 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。

8.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.9.1 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。

8.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

8.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.1.11 投资组合报告附注

8.1.11.1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。

8.1.11.2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。

8.1.11.3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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	97,773.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,773.56

8.1.11.4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可转换债券。

8.1.11.5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。

8.2原国泰6个月短期理财债券型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2014年10月1日-2014年12月30日）8.2.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,930,143.90	35.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	28,254,846.26	63.82
4	其他各项资产	84,976.56	0.19
5	合计	44,269,966.72	100.00

8.2.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

在本报告期内本理财基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的40%。

8.2.3 基金投资组合平均剩余期限

8.2.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

不适用。

8.2.3.2期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

8.2.4期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.2.5期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.2.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0000%

8.2.7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。

8.2.8 投资组合报告附注

8.2.8.1基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

本基金通过每日计算收益的方式，使基金份额净值保持在1.00元。

8.2.8.2本报告期内本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

8.2.8.3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。

8.2.8.4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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	84,701.64
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	274.92
7	其他	-
8	合计	84,976.56

§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
697	63,287.23	20,077,846.26	45.52%	24,033,354.05	54.48%

9.2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	530,924.46	1.20%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月31日)基金份额总额	44,111,200.31
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,111,200.31

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

国泰6个月短期理财债券型证券投资基金（以下简称"6 个月理财基金"，基金代码020029）以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2014 年10 月28 日起至2014 年11 月28 日17:00 止。参加本次大会投票表决的6 个月理财基金基金份额持有人及代理人所持基金份额共计101,639,125.47 份，占权益登记日6 个月理财基金总份额136,297,818.75 份的74.57%，达到法定开会条件，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰6个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定。

本次大会审议了《关于国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称"本次会议议案"），并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案进行表决，表决结果为：有效表决票所代表的基金份额为101,639,125.47 份，其中，101,639,125.47 份基金份额同意，0 份基金份额反对，0 份基金份额弃权。同意本次会议议案的基金份额占参加本次大会投票表决的持有人及代理人所持基金份额总数的100%，达到参加本次大会投票表决的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰6 个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。

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：

2014年9月24日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第六届董事会第十次会议审议通过，李志坚先生不再担任公司副总经理。

2014年12月13日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司总经理变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第十三次会议审议通过，金旭女士不再担任公司总经理。2014年12月11日起由公司董事长陈勇胜先生代任总经理。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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20,000元。

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。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-

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，由公司投研业务部门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
海通证券	141,839.46	100.00%	5,000,000.00	100.00%	-	-

（上接B162版）

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	601318	中国平安	27,159,198.60	23.47
2	600030	中信证券	19,771,513.00	17.09
3	000651	格力电器	16,922,671.32	14.63
4	000002	万科A	14,443,865.00	12.48
5	601601	中国太保	13,322,241.44	11.51
6	600309	万华化学	11,492,273.00	9.93
7	600036	招商银行	10,409,745.00	9.00
8	600643	爱建股份	9,778,019.00	8.45
9	000024	招商地产	9,105,416.77	7.87
10	600668	尖峰集团	8,290,792.79	7.17
11	000895	双汇发展	7,743,430.90	6.69
12	600527	江南高纤	7,621,531.45	6.59
13	000858	五粮液	7,514,738.00	6.49
14	002042	华孚色纺	7,503,785.00	6.49
15	600150	中国船舶	7,312,762.19	6.32
16	000333	美的集团	7,275,040.57	6.29
17	601166	兴业银行	7,269,904.00	6.28
18	600519	贵州茅台	7,268,560.34	6.28
19	600388	龙净环保	7,133,198.06	6.17
20	600999	招商证券	7,093,505.00	6.13
21	601992	金隅股份	6,958,780.41	6.01
22	600016	民生银行	6,828,068.00	5.90
23	002138	顺络电子	6,558,727.05	5.67
24	600068	葛洲坝	6,544,165.52	5.66
25	600176	中国玻纤	6,420,482.66	5.55
26	600048	保利地产	6,250,909.00	5.40
27	600108	亚盛集团	6,178,872.00	5.34
28	601988	中国银行	5,861,961.00	5.07
29	601688	华泰证券	5,216,586.20	4.51
30	600015	华夏银行	5,161,426.70	4.46
31	002005	德豪润达	5,131,187.35	4.43
32	600079	人福医药	4,986,555.40	4.31
33	600685	广船国际	4,862,393.38	4.20
34	600340	华夏幸福	4,653,539.54	4.02
35	601998	中信银行	4,632,658.00	4.00
36	600406	国电南瑞	4,525,265.20	3.91
37	600050	中国联通	4,466,882.91	3.86
38	600633	浙报传媒	4,396,685.18	3.80
39	600820	隧道股份	4,212,732.89	3.64
40	600409	三友化工	4,208,236.00	3.64
41	000671	阳光城	4,119,841.00	3.56
42	000598	兴蓉投资	4,074,627.00	3.52
43	601989	中国重工	4,072,444.00	3.52
44	600584	长电科技	3,995,438.40	3.45
45	000039	中集集团	3,989,778.59	3.45
46	000012	南玻A	3,950,281.70	3.41
47	600577	精达股份	3,895,011.08	3.37
48	600372	中航电子	3,765,227.00	3.25
49	600028	中国石化	3,728,615.33	3.22
50	600638	新黄浦	3,697,924.00	3.20
51	600271	航天信息	3,687,277.00	3.19
52	002250	联化科技	3,677,067.65	3.18
53	000157	中联重科	3,661,992.00	3.16
54	300162	雷曼光电	3,603,036.00	3.11
55	600315	上海家化	3,601,484.00	3.11
56	000516	开元投资	3,534,227.00	3.05
57	600196	复星医药	3,470,910.00	3.00
58	600329	中新药业	3,358,706.00	2.90
59	600660	福耀玻璃	3,326,856.00	2.88
60	601699	潞安环能	3,322,443.00	2.87
61	600879	航天电子	3,310,532.87	2.86
62	002573	国电清新	3,310,067.00	2.86
63	600138	中青旅	3,285,798.62	2.84
64	600000	浦发银行	3,260,762.00	2.82
65	600362	江西铜业	3,238,471.73	2.80
66	600583	海油工程	3,229,903.71	2.79
67	600060	海信电器	3,223,234.00	2.79
68	600657	信达地产	3,195,488.00	2.76
69	600056	中国医药	3,150,970.30	2.72
70	000568	泸州老窖	3,123,138.67	2.70
71	601718	际华集团	3,112,991.45	2.69
72	600158	中体产业	3,112,103.01	2.69
73	000069	华侨城A	3,110,254.17	2.69
74	002055	得润电子	3,075,502.00	2.66
75	600467	好当家	3,074,392.00	2.66
76	600582	天地科技	3,056,624.00	2.64
77	300224	正海磁材	3,054,457.58	2.64
78	600688	上海石化	3,025,705.34	2.62
79	600348	阳泉煤业	3,021,550.00	2.61
80	601668	中国建筑	3,012,765.00	2.60
81	600118	中国卫星	2,989,752.40	2.58
82	600037	歌华有线	2,934,796.00	2.54
83	603002	宏昌电子	2,934,254.00	2.54
84	601928	凤凰传媒	2,931,152.00	2.53
85	002310	东方园林	2,927,948.00	2.53
86	600109	国金证券	2,911,060.00	2.52
87	002570	贝因美	2,891,036.39	2.50
88	600054	黄山旅游	2,877,094.04	2.49
89	603000	人民网	2,867,962.29	2.48
90	002253	川大智胜	2,794,787.50	2.42
91	002313	日海通讯	2,794,500.00	2.42
92	002229	鸿博股份	2,753,903.88	2.38
93	000823	超声电子	2,734,088.32	2.36
94	600376	首开股份	2,728,288.00	2.36
95	600511	国药股份	2,703,524.00	2.34
96	000735	罗牛山	2,688,401.00	2.32
97	600521	华海药业	2,621,225.80	2.27
98	000513	丽珠集团	2,566,706.89	2.22
99	600330	天通股份	2,549,518.18	2.20
100	002013	中航机电	2,531,959.75	2.19
101	600739	辽宁成大	2,519,535.00	2.18
102	601788	光大证券	2,507,106.12	2.17
103	002344	海宁皮城	2,505,336.00	2.17
104	600031	三一重工	2,504,929.32	2.16
105	600240	华业地产	2,481,649.00	2.14
106	600570	恒生电子	2,480,192.90	2.14
107	600887	伊利股份	2,469,877.27	2.13
108	600809	山西汾酒	2,454,331.84	2.12
109	002024	苏宁云商	2,451,256.69	2.12
110	000830	鲁西化工	2,416,522.00	2.09
111	300262	巴安水务	2,410,587.50	2.08
112	600266	北京城建	2,400,195.00	2.07
113	300332	天壕节能	2,399,377.00	2.07
114	002672	东江环保	2,387,599.00	2.06
115	600783	鲁信创投	2,387,192.00	2.06
116	600655	豫园商城	2,386,074.25	2.06
117	002658	雪迪龙	2,375,698.10	2.05
118	002285	世联行	2,320,303.70	2.01

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	600030	中信证券	25,966,549.17	22.44
2	601318	中国平安	22,960,803.25	19.84
3	600643	爱建股份	10,597,655.29	9.16
4	600309	万华化学	9,456,361.47	8.17
5	000024	招商地产	8,832,913.38	7.63
6	000002	万科A	8,537,889.05	7.38
7	000333	美的集团	8,516,997.30	7.36
8	600668	尖峰集团	8,384,728.60	7.25
9	600176	中国玻纤	8,105,462.08	7.01
10	600519	贵州茅台	7,909,501.34	6.84
11	000651	格力电器	7,785,999.53	6.73
12	600527	江南高纤	7,404,224.97	6.40
13	002042	华孚色纺	7,383,529.59	6.38
14	600999	招商证券	7,056,026.49	6.10
15	600150	中国船舶	6,811,970.11	5.89
16	600016	民生银行	6,769,962.26	5.85
17	000895	双汇发展	6,750,734.25	5.83
18	002138	顺络电子	6,744,410.75	5.83
19	600108	亚盛集团	6,738,231.08	5.82
20	601601	中国太保	6,326,438.63	5.47
21	601688	华泰证券	6,169,509.97	5.33
22	600685	广船国际	5,585,788.06	4.83
23	601788	光大证券	5,461,544.20	4.72
24	600015	华夏银行	5,380,869.33	4.65
25	601998	中信银行	5,042,887.72	4.36
26	600409	三友化工	4,866,382.60	4.21
27	600079	人福医药	4,771,827.60	4.12
28	002005	德豪润达	4,692,192.89	4.06
29	601992	金隅股份	4,661,879.40	4.03
30	600050	中国联通	4,656,237.78	4.02
31	601166	兴业银行	4,536,047.84	3.92
32	600577	精达股份	4,534,426.16	3.92
33	600820	隧道股份	4,422,886.03	3.82
34	000598	兴蓉投资	4,337,837.00	3.75
35	600633	浙报传媒	4,333,379.61	3.75
36	600406	国电南瑞	4,310,892.76	3.73
37	600584	长电科技	4,293,153.54	3.71
38	600028	中国石化	4,200,574.32	3.63
39	000858	五粮液	4,017,662.00	3.47
40	600271	航天信息	3,979,450.51	3.44
41	000671	阳光城	3,976,903.02	3.44
42	002250	联化科技	3,974,814.05	3.44
43	600340	华夏幸福	3,950,926.28	3.41
44	300224	正海磁材	3,931,868.45	3.40
45	000012	南玻A	3,907,294.70	3.38
46	600660	福耀玻璃	3,890,743.39	3.36
47	600196	复星医药	3,866,956.92	3.34
48	000039	中集集团	3,740,507.83	3.23
49	000157	中联重科	3,733,118.21	3.23
50	600638	新黄浦	3,688,147.05	3.19
51	600048	保利地产	3,631,635.72	3.14
52	600329	中新药业	3,614,098.91	3.12
53	600879	航天电子	3,521,838.10	3.04
54	600118	中国卫星	3,513,190.45	3.04
55	002055	得润电子	3,431,083.10	2.97
56	600037	歌华有线	3,419,362.40	2.96
57	600158	中体产业	3,401,631.96	2.94
58	600362	江西铜业	3,397,292.41	2.94
59	600138	中青旅	3,386,602.20	2.93
60	600315	上海家化	3,381,080.00	2.92
61	600056	中国医药	3,347,128.45	2.89
62	000516	开元投资	3,337,629.59	2.88
63	600266	北京城建	3,287,972.08	2.84
64	600739	辽宁成大	3,193,852.93	2.76
65	600372	中航电子	3,177,739.68	2.75
66	000069	华侨城A	3,175,155.05	2.74
67	600467	好当家	3,139,821.51	2.71
68	600109	国金证券	3,130,960.60	2.71
69	600000	浦发银行	3,097,304.82	2.68
70	600348	阳泉煤业	3,075,591.69	2.66
71	600068	葛洲坝	3,069,286.47	2.65
72	600655	豫园商城	3,068,443.16	2.65
73	600582	天地科技	3,062,051.02	2.65
74	600054	黄山旅游	3,005,906.02	2.60
75	600511	国药股份	3,003,146.65	2.60
76	002253	川大智胜	2,987,310.36	2.58
77	603002	宏昌电子	2,982,614.96	2.58
78	600521	华海药业	2,973,375.95	2.57
79	000568	泸州老窖	2,929,724.35	2.53
80	600688	上海石化	2,916,170.00	2.52
81	002229	鸿博股份	2,827,206.52	2.44
82	600240	华业地产	2,818,308.52	2.44
83	600060	海信电器	2,800,180.63	2.42
84	600376	首开股份	2,766,897.86	2.39
85	002310	东方园林	2,755,968.94	2.38
86	600036	招商银行	2,726,132.63	2.36
87	002313	日海通讯	2,710,778.00	2.34
88	000735	罗牛山	2,701,209.18	2.33
89	601928	凤凰传媒	2,698,994.98	2.33
90	600583	海油工程	2,675,742.75	2.31
91	601988	中国银行	2,639,716.50	2.28
92	300262	巴安水务	2,603,433.67	2.25
93	002013	中航机电	2,592,428.85	2.24
94	002658	雪迪龙	2,591,399.03	2.24
95	000823	超声电子	2,575,233.79	2.23
96	002023	海特高新	2,569,051.68	2.22
97	000830	鲁西化工	2,554,395.68	2.21
98	600330	天通股份	2,535,048.06	2.19
99	002285	世联行	2,524,528.45	2.18
100	002344	海宁皮城	2,504,895.83	2.16
101	002024	苏宁云商	2,502,900.00	2.16
102	600498	烽火通信	2,491,300.30	2.15
103	603000	人民网	2,486,882.00	2.15
104	002570	贝因美	2,447,042.95	2.11
105	000718	苏宁环球	2,433,331.00	2.10
106	600887	伊利股份	2,367,497.28	2.05
107	000513	丽珠集团	2,361,517.47	2.04
108	601238	广汽集团	2,316,794.47	2.00

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	657,625,264.15
卖出股票的收入（成交）总额	586,950,511.89

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	7,021,700.00	5.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	7,021,700.00	5.70

8.6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	019207	12国债07	42,000	4,202,100.00	3.41
2	019407	14国债07	28,000	2,819,600.00	2.29

8.7 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。

8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.8.1 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。

8.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

8.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除"中国平安"公告其子公司违规情况外），没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称"平安证券"）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》〔2014〕103号，决定对平安证券给予警告，没收海联讯保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2,867万元，并处以440万元罚款；同时对保荐人韩长风、霍永涛给予警告，并分别处以30万元罚款，撤销证券从业资格。

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

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

8.10.2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。

8.10.3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	101,002.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	158,453.61
5	应收申购款	823,879.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,083,335.85

§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

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
国泰聚信价值优势灵活配置混合A	1,101	50,525.49	0.00	0.00%	55,628,569.31	100.00%
国泰聚信价值优势灵活配置混合C	995	28,860.93	0.00	0.00%	28,716,620.95	100.00%
合计	2,096	40,241.03	0.00	0.00%	84,345,190.26	100.00%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	国泰聚信价值优势灵活配置混合A	0.00	0.00%
	国泰聚信价值优势灵活配置混合C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	国泰聚信价值优势灵活配置混合A	0
	国泰聚信价值优势灵活配置混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰聚信价值优势灵活配置混合A	0
	国泰聚信价值优势灵活配置混合C	0
	合计	0

§10开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰聚信价值优势灵活配置混合A	国泰聚信价值优势灵活配置混合C
基金合同生效日（2013年12月17日）基金份额总额	71,065,143.28	142,634,771.47
本报告期期初基金份额总额	72,434,979.90	42,600,152.76
本报告期基金总申购份额	19,182,451.88	18,661,910.95
减：本报告期基金总赎回份额	35,988,862.47	32,545,442.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,628,569.31	28,716,620.95

§11重大事件揭示

11.1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。

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：

2014年9月24日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第六届董事会第十次会议审议通过，李志坚先生不再担任公司副总经理。

2014年12月13日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司总经理变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第十三次会议审议通过，金旭女士不再担任公司总经理。2014年12月11日起由公司董事长陈勇胜先生代任总经理。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

本基金托管人于2014年5月5日在《上海证券报》发布公告，由寻卫国先生担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理，原总经理禄金山先生另有任用。

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63,394.8元，目前的审计机构提供审计服务的年限为1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。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	882,550,532.78	70.92%	626,963.57	70.92%	-
川财证券	2	361,826,103.26	29.08%	257,040.53	29.08%	-

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。

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
国金证券	8,693,726.21	100.00%	370,000,000.00	28.75%	-	-
川财证券	-	-	917,000,000.00	71.25%	-	-