



(上接 D147 版)

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票的成本(成交总额) and 卖出股票的收入(成交总额)

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

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

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。

本基金经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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9 基金资产持有人信息

9.1 期末基金资产持有人户数及持有人结构

份额单位:人民币元

Table with 5 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末未持有本基金。

Table with 3 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额区间的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份)

§10 开放式基金份额变动

单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2007年5月18日)基金份额总额, 基金份额

§11 重大事件提示

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:

2016年3月26日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过,聘任李永梅女士担任公司督察长。

2016年3月26日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过,巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理,且不再代为履行督察长职务。

2016年6月8日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过,张峰先生不再担任本基金管理人总经理,由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务。

2016年7月12日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过,聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理,公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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,本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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。报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬为100,000元,目前的审计机构提供审计服务的年限为9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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 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

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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 回购交易, 权证交易

11.7.3 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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 回购交易, 权证交易

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 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

注:基金租用席位的选择标准是:

- (1) 实力雄厚,信誉良好; (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营业绩稳定; (3) 经营行为规范,在最近一年内无重大违规行为; (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,由公司投资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。

11.7.4 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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 回购交易, 权证交易

(上接 D145 版)

金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

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。

8.4.3 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

Table with 2 columns: 买入股票的成本(成交总额), 卖出股票的收入(成交总额)

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

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

本基金在进行股指期货投资时,将通过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。

本基金经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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金资产持有人信息

9.1 期末基金资产持有人户数及持有人结构

份额单位:份

Table with 5 columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额区间的情况

Table with 3 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份)

§10 开放式基金份额变动

单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2002年5月8日)基金份额总额, 基金份额

§11 重大事件提示

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:

2016年3月26日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过,聘任李永梅女士担任公司督察长。

2016年3月26日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过,巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理,且不再代为履行督察长职务。

2016年6月8日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过,张峰先生不再担任本基金管理人总经理,由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务。

2016年7月12日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过,聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理,公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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,本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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。报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬为100,000元,目前的审计机构提供审计服务的年限为15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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 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

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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 回购交易, 权证交易

11.7.3 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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 回购交易, 权证交易

注:基金租用席位的选择标准是:

- (1) 实力雄厚,信誉良好; (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营业绩稳定; (3) 经营行为规范,在最近一年内无重大违规行为; (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,由公司投资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。

11.7.4 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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 回购交易, 权证交易