

2011 年度報告摘要

10	002223	鱼跃医疗	133,705,336.92	2.36
----	--------	------	----------------	------

15	600538	云南白药	110,092,785.20	2.00
16	600511	国药股份	114,115,050.56	2.01
17	600697	欧亚集团	111,463,832.13	1.96
18	601166	兴业银行	111,396,058.12	1.96
19	601857	中国石油	91,241,457.05	1.61
20	002179	中航光电	83,878,525.14	1.48

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	000895	双汇发展	475,964,551.40	8.39

2	600887	伊利股份	472,162,361.87	8.32
3	000538	云南白药	374,188,437.55	6.60
4	600276	恒瑞医药	352,859,057.03	6.22
5	600519	贵州茅台	306,540,025.64	5.40
6	000401	冀东水泥	278,616,635.79	4.91
7	600152	神华股份	227,622,898.42	4.10

7	000133	建发股份	237,022,363.42	4.19
8	002422	科伦药业	170,759,934.58	3.01
9	000063	中兴通讯	141,950,462.63	2.50
10	600362	江西铜业	129,314,345.07	2.28
11	600028	中国石化	128,207,347.63	2.26
12	601299	中国北车	127,664,848.65	2.25

13	002304	洋河股份	126,734,531.14	2.23
14	600068	葛洲坝	120,364,816.00	2.12
15	600511	国药股份	119,774,497.86	2.11
16	600795	国电电力	114,173,629.67	2.01
17	601766	中国南车	107,645,184.24	1.90
18	601166	兴业银行	106,855,450.09	1.88

19	600900	长江电力	106,709,055.19	1.88
20	000858	五粮液	100,127,975.81	1.76

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	4,811,063,812.78
卖出股票的收入(成交)总额	6,047,527,928.80

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	68,715,000.00	1.78
2	央行票据	49,530,000.00	1.28
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	198,700.00	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	34,491,011.60	0.89
8	其他	-	-

9	合计	152,934,711.60	3.96
---	----	----------------	------

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	1001032	10央行票据32	500,000	49,530,000.00	1.28

2	119904	11贴现国债04	500,000	48,785,000.00	1.26
3	110015	石化转债	343,160	34,491,011.60	0.89
4	019109	11国债09	100,000	100,008,000.00	0.26
5	100025	10付息国债25	100,000	9,922,000.00	0.26

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 本报告期内本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

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,476,944.45
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	2,399,549.87
5	应收申购款	2,232,104.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

8	其他		
9	合计		6,108,598.66

8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	34,491,011.60	0.89

8.9.5 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

	持有人结构
--	-------

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
197,426	32,984.92	2,268,119,283.23	34.83%	4,243,961,729.51	65.17%

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	2,226.77	0%

§ 10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年4月11日)基金份额总额	500,000,000.00
---------------------------	----------------

本报告期初基金份额总额	5,154,350,765.97
本报告期基金总申购份额	4,065,523,229.63
减:本报告期基金总赎回份额	2,707,792,982.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	6,512,081,012.74

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:
2011年4月2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

本公司高级管理人员变更的公告,经本基金管理人第五届董事会第六次会议审议通过,同意副总经理傅斌先生因个人原因离职。

2011年10月29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高级管理人员变更的公告》,经本基金管理人第五届董事会第九次会议审议通过,同意副总经理余荣权先生因个人原因离职。

报告期内基金托管人的基金托管部门的重大人事变动如下:

本基金托管人2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资管理服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会核准批准(证监许可[2011]115号)。解聘李树忠、李树忠为中国建设银行投资管理服务部副总经理职务。本基金管理人2011年1月31日发布任免通知,解聘李树忠为中国建设银行投资管理服务部副总经理职务。本基金托管人2011年10月24日发布任免通知,聘任张军红为中国建设银行投资管理服务部副总经理。

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 125 万元,占本基金净资产的 0.01%。

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		应支付给券商的佣金		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	
宏源证券	2	2,128,986,127.36	19.68%	1,772,415.57	19.58%	-
长江证券	1	1,147,807,545.69	10.61%	975,634.69	10.78%	-

招商证券	1	555,064,167.53	5.13%	450,991.78	4.98%	-
上海证券	1	650,234,439.60	6.01%	552,693.47	6.11%	-
东方证券	2	766,337,797.51	7.08%	628,173.51	6.94%	-
中银国际	1	792,685,786.03	7.33%	673,781.51	7.44%	-
民族证券	1	2,040,805,316.93	18.86%	1,734,677.89	19.16%	-
宏信证券	1	167,954,200.08	1.55%	142,676.26	1.58%	-

安信证券	1	107,824,399.08	1.33%	142,070.30	1.26%	-
华宝证券	1	1,538,928,260.58	14.22%	1,250,385.96	13.81%	-
国泰君安	2	162,910,523.07	1.51%	132,365.41	1.46%	-
广发证券	1	868,912,484.20	8.03%	738,569.00	8.16%	-

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。

本基金报告期内租用证券公司交易单元无变化。

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	质押式回购		买断式回购		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
宏源证券	-	-	5,050,000,000.00	56.42%	-	-
长江证券	19,910,000.00	14.26%	2,500,000,000.00	27.93%	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	200,000,000.00	2.23%	-	-
民族证券	50,183,357.00	35.94%	600,000,000.00	6.70%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	59,616,000.00	42.69%	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
广发证券	9,939,000.00	7.12%	600,000,000.00	6.70%	-

§ 1 2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2011年10月28日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“该行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

16 日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。