

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金

2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 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	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
7.8 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	40
7.9 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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.4 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.....	43
§ 9 开放式基金份额变动.....	44
§ 10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
§ 11 备查文件目录.....	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金		
基金简称	国泰国证医药卫生行业指数分级		
场内简称	国泰医药		
基金主代码	160219		
交易代码	160219		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 8 月 29 日		
基金管理人	国泰基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	370,923,322.28 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013 年 9 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	国泰医药	医药 A	医药 B
下属分级基金的交易代码	160219	150130	150131
报告期末下属分级基金的份额总额	56,003,840.28 份	157,459,741.00 份	157,459,741.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将在拟替代成份股内选取替代成份股进行替代投资，并对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
业绩比较基准	国证医药卫生行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不

	<p>同的基金份额具有不同的风险收益特征。</p> <p>运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额。其中国泰医药份额为普通的股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；医药 A 份额的风险与预期收益较低；医药 B 份额采用了杠杆式的结构，风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。</p>
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	林海	李芳菲
	联系电话	021-31081600转	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95599
传真		021-31081800	010-63201816
注册地址		上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼	北京市东城区建国门内大街69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	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200082	100031
法定代表人		陈勇胜	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,385,041.93
本期利润	-2,730,388.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0075
本期加权平均净值利润率	-0.75%
本期基金份额净值增长率	-2.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	354,749.90
期末可供分配基金份额利润	0.0010
期末基金资产净值	367,017,587.23
期末基金份额净值	0.9895
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.12%

注：(1)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。

(2)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3)本基金合同生效日为 2013 年 8 月 29 日，截止至 2014 年 06 月 30 日不满一年。

(4)对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

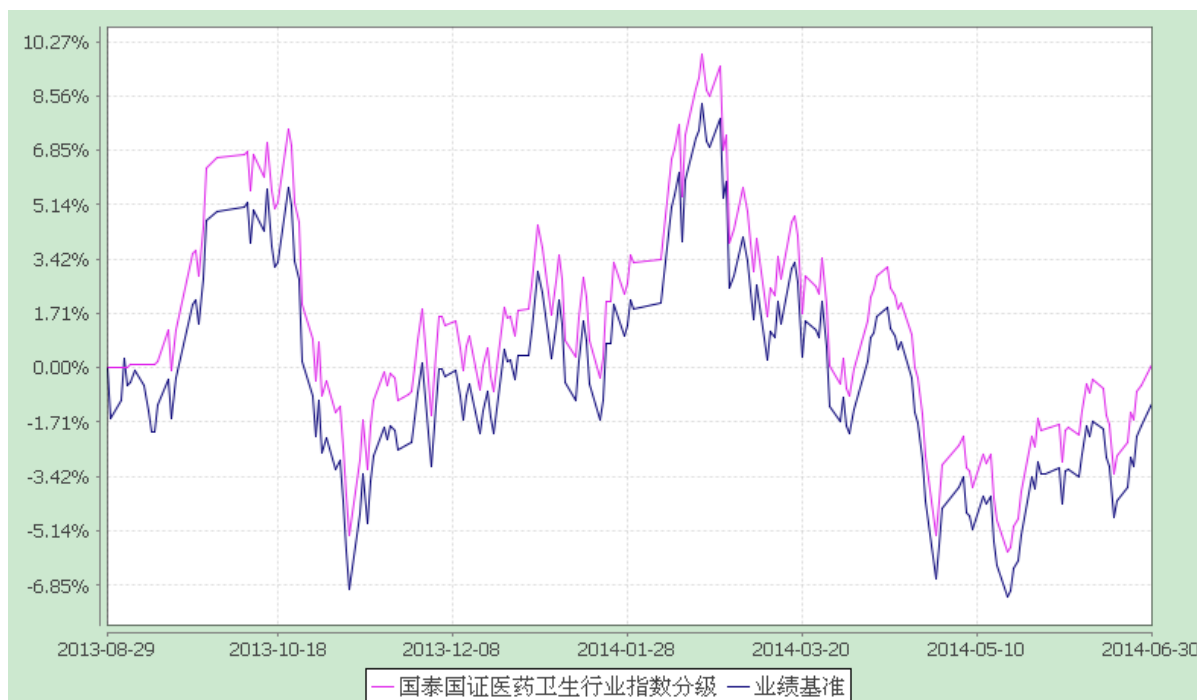
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.09%	0.98%	2.25%	0.75%	-0.16%	0.23%
过去三个月	0.62%	1.14%	0.54%	0.87%	0.08%	0.27%
过去六个月	-2.44%	1.35%	-2.28%	1.09%	-0.16%	0.26%
自基金合同生效起至今	0.12%	1.26%	-1.14%	1.11%	1.26%	0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2013 年 8 月 29 日至 2014 年 6 月 30 日)



注：(1) 本基金的合同生效日为 2013 年 8 月 29 日，截止 2014 年 06 月 30 日不满一年；
 (2) 本基金的建仓期为 6 个月，本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 46 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 6 个月短期理财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金(由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金。另外,本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾成东	本基金的基金经理、国泰金马稳健混合、	2014-06-24	-	6	硕士研究生。2008 年 2 月加入国泰基金管理有限公司,历任量化、宏观、策略、煤炭及银行研究员,

	国泰保本混合的基金经理				2012年2月至2014年3月任研究部总监助理,2013年11月起任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理,2014年6月起任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰保本混合型证券投资基金的基金经理。
章贇	本基金的基金经理	2013-08-29	2014-06-24	8	博士。曾任职于平安资产管理公司。2008年5月加盟国泰基金管理有限公司,任数量金融分析师,2010年3月至2011年5月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理;2011年3月至2014年6月担任上证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的基金经理;2011年5月至2014年5月兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理;2012年3月至2014年2月兼任中小板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的基金经理,2013年2月至2014年6月兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理;2013年8月至2014年6月兼任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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 ≥ 20 ），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。

4.3.2 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年 A 股行情整体呈现震荡的态势。经济数据偏弱与政策托底的相互角力对股市的走向产生了明显影响，随着政策力度的逐渐加大，5 月份之后市场开始企稳回升。上半年，上证指数最低触及 1974.38 点，收于 2048.33 点，上半年下跌 3.20%。而国证医药指数则在上半年中小幅震荡，从开盘 5987.09 点，收于 5840.71 点。

本报告期内，我们根据对市场行情分析判断以及日常申赎情况，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平。作为行业分级基金，本基金为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具，分级份额在场内保持一定的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2014 年上半年的净值增长率为-2.44%，同期业绩比较基准收益率为-2.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年中国证券市场将会有较好的表现。一方面经过今年二季度的政府通过重大项目和托底经济已经显现出企稳迹象，对股票市场有利；另一方面，央行和银监会的持续维稳政策大幅降低了资金成本和债券市场的违约风险。

从投资机会来看，医药生物符合深化改革概念，国家政策环境向好，社会资本介入医疗的热情相当高，更有基因测序和医疗器械国产化等热门主题。随着国家相关政策的逐步释放，医药板块存在很好的投资机会。

国证医药行业指数包含了沪深两市 80 家主要上市公司，能够表征医药卫生行业的整体表现。建议投资者利用国泰国证医药卫生行业指数分级基金，积极把握医药行业阶段性的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制订了相关制度及流程。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的公司领导负责，成员包括基金核算、金融工程、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国泰基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，国泰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	35,870,648.11	26,424,266.83
结算备付金		479,872.17	166,194.65
存出保证金		83,217.02	250,576.05
交易性金融资产	6.4.7.2	335,887,900.70	408,143,258.99
其中：股票投资		335,887,900.70	408,143,258.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,258,581.98
应收利息	6.4.7.5	4,587.85	5,530.37
应收股利		-	-
应收申购款		29,921.47	41,829.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	30,247.11	-
资产总计		372,386,394.43	439,290,238.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,009,364.03	-
应付赎回款		509,008.86	6,916,291.30
应付管理人报酬		299,919.24	390,621.57
应付托管费		59,983.84	78,124.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	230,338.03	361,490.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	260,193.20	136,066.35
负债合计		5,368,807.20	7,882,594.32
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	366,662,837.33	420,456,593.67
未分配利润	6.4.7.10	354,749.90	10,951,050.23
所有者权益合计		367,017,587.23	431,407,643.90
负债和所有者权益总计		372,386,394.43	439,290,238.22

注：报告截止日 2014 年 06 月 30 日，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之基础份额净值 0.9895 元，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额净值 1.0343 元，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之积极收益类份额净值 0.9447 元；国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金份额总额 370,923,322.28 份，其中国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之基础份额 56,003,840.28 份，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 157,459,741.00 份，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之积极收益类份额 157,459,741.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		476,401.38
1.利息收入		98,736.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,269.33
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,466.67
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,303,813.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,728,987.40
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,574,826.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,115,430.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	189,282.31
减：二、费用		3,206,790.18
1. 管理人报酬		1,810,753.38
2. 托管费		362,150.67
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	690,784.35

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	343,101.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,730,388.80
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,730,388.80

注：本基金成立日为 2013 年 8 月 29 日，因此无上年度可比期间金额。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 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）	420,456,593.67	10,951,050.23	431,407,643.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,730,388.80	-2,730,388.80
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）	-53,793,756.34	-7,865,911.53	-61,659,667.87
其中：1. 基金申购款	91,277,849.42	-1,517,123.61	89,760,725.81
2. 基金赎回款	-145,071,605.76	-6,348,787.92	-151,420,393.68
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）	366,662,837.33	354,749.90	367,017,587.23

注：本基金成立日为 2013 年 8 月 29 日，因此无上年度可比期间金额。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：张琼，会计机构负责人：王嘉浩

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金(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”)证监基金字[2013]163 号《关于核准国泰国证医药卫生行业指数分级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《国泰国证医药卫生行业指数分级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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 500,590,629.33 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 559 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 500,660,152.14 份基金份额,其中认购资金利息折合 69,522.81 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》和《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金招募说明书》的规定,本基金的基金份额包括国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国泰医药份额”)、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“医药 A”)及国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“医药 B”)。国泰医药份额只接受场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。医药 A 与医药 B 只可上市交易,不可单独进行申购或赎回。投资者可选择将其在场内申购的国泰医药份额按 1:1 的比例分拆成医药 A 和医药 B,但不得申请将其场外申购的国泰医药份额进行分拆。投资者可将其持有的场外国泰医药份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成医药 A 和医药 B 后上市交易,也可按 1:1 的配比将其持有的医药 A 和医药 B 申请合并为场内的国泰医药份额。

在本基金医药 A 份额和医药 B 份额存续期内,本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对医药 A 份额和医药 B 份额分别进行净值计算,医药 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额,本基金扣除掉国泰医药份额对应的净资产部分后剩余的净资产将优先确保医药 A 份额的本金及医药 A 份额的约定收益;医药 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额,本基金扣除掉国泰医药份额对应的净资产部分后剩余的净资产在优先确保医药 A 份额的本金及约定收益后,将计为医药 B 份额的净资产。

基金份额净值按如下原则计算:医药 A 的基金份额净值,自基金合同生效日起至第 1 个基金份额折算日期间、或自上一个基金份额折算日(定期折算日或到点折算日)后的下一个日历日起至下一个基金份额折算日期间,以 1.000 元为基准,医药 A 的约定日简单收益率(约定基准收益率除以 365)

单利累计计算。本基金一份医药 A 份额与一份医药 B 份额构成一对份额组合，一对医药 A 份额与医药 B 份额的份额组合的净值之和等于两份国泰医药份额的净值。计算出医药 A 份额的份额净值后，根据医药 A 份额、医药 B 份额和国泰医药份额各自份额净值之间的关系，计算出医药 B 份额的基金份额净值。

本基金定期进行份额折算。在每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日，本基金根据基金合同的规定对医药 A 和国泰医药份额进行定期份额折算。折算前的医药 A 份额持有人，以医药 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.000 元部分，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变医药 A 份额持有人的资产净值，其持有的医药 A 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰医药份额。折算前的国泰医药份额的基金份额持有人，以每 2 份国泰医药份额，按 1 份医药 A 份额的份额分配，获得新增国泰医药份额。持有场外国泰医药份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国泰医药份额的分配；持有场内国泰医药份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国泰医药份额的分配。折算不改变国泰医药份额持有人的资产净值。折算不改变医药 B 份额持有人的资产净值，其持有的医药 B 份额的基金份额净值及份额数量不变。

除以上基金份额定期折算外，本基金还将在国泰医药份额的份额净值大于或等于 1.500 时以及医药 B 份额的份额净值小于或等于 0.250 时进行不定期折算。

本基金投资人初始场内认购的基金份额合计 3,260,218 份，于 2013 年 2 月 28 日按 1:1 的基金份额配比分拆为 1,630,106.00 份医药 A 与 1,630,106.00 份医药 B。经深圳证券交易所深证上[2013]72 号文审核同意，本基金医药 A 和医药 B 于 2013 年 3 月 7 日上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股((一级市场初次发行或增发))、债券、债券回购、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，((但须符合中国证监会相关规定))。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准： $\text{国证医药行业指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率}(\text{税后}) \times 5\%$ 。

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 2014 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《国泰国证医药卫生行业指数分级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。

6.4.3 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 2014 年 06 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 06 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。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	35,870,648.11
定期存款	-
其他存款	-
合计	35,870,648.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	344,337,335.06	335,887,900.70	-8,449,434.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	344,337,335.06	335,887,900.70	-8,449,434.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	4,358.89
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	194.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.81
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	33.75
合计	4,587.85

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	30,247.11
合计	30,247.11

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	230,338.03

银行间市场应付交易费用	-
合计	230,338.03

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,918.31
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	208,274.89
合计	260,193.20

6.4.7.9 实收基金

国泰医药

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	88,656,122.83	88,737,137.67
本期申购	792,825.53	792,827.27
本期赎回（以“-”号填列）	-7,211,829.33	-7,212,914.47
-基金拆分/份额折算前	82,237,119.03	82,317,050.47
基金拆分/份额折算调整	4,882,056.64	—
基金拆分/份额折算变动本期申购	210,828,764.27	209,768,184.15
基金拆分/份额折算变动本期赎回（以“-”号填列）	-241,944,099.66	-240,341,879.29
本期末	56,003,840.28	51,743,355.33

医药 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	165,859,728.00	165,859,728.00
基金拆分/份额折算变动本期赎回（以“-”号填列）	-390,620.00	-390,620.00
-基金拆分/份额折算前	165,469,108.00	165,469,108.00
基金拆分/份额折算变动本期申购	51,241,594.00	51,241,594.00
基金拆分/份额折算变动本期赎回	-59,250,961.00	-59,250,961.00

回（以“-”号填列）		
本期末	157,459,741.00	157,459,741.00
医药 B		

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	165,859,728.00	165,859,728.00
基金拆分/份额折算变动本期赎回（以“-”号填列）	-390,620.00	-390,620.00
-基金拆分/份额折算前	165,469,108.00	165,469,108.00
基金拆分/份额折算变动本期申购	51,241,594.00	51,241,594.00
基金拆分/份额折算变动本期赎回（以“-”号填列）	-59,250,961.00	-59,250,961.00
本期末	157,459,741.00	157,459,741.00

注：(1)根据《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金招募说明书》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，国泰基金管理有限公司以 2014 年 1 月 2 日为基金份额折算基准日，对在该日交易结束后登记在册的国证医药基金份额和医药 A 份额实施了定期份额折算。医药 A 份额折算前份额为 165,469,108.00 份，新增份额折算比例为 0.023631961，折算后份额为 165,469,108.00 份，折算后份额净值 1.000 元；场外国泰医药份额折算前份额为 64,977,762.03 份，新增份额折算比例为 0.011815981，折算后份额为 65,745,538.01 份，折算后份额净值 1.0325 元；场内国泰医药份额折算前份额为 17,259,357.00 份，新增份额折算比例为 0.011815981，折算后份额为 17,463,293.23 份，折算后份额净值 1.0325 元。

(2)截至 2014 年 06 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 314,919,482.00 份(其中医药 A 157,459,741.00 份，医药 B 157,459,741.00 份)。托管在深交所场内未上市的基金份额为 12,937,232.00 份，托管在场外未上市的基金份额为 43,066,604.73 份，均为国泰医药份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-436,442.13	11,387,492.36	10,951,050.23
本期利润	3,385,041.93	-6,115,430.73	-2,730,388.80
本期基金份额交易产生的变动数	24,998.07	-7,890,909.60	-7,865,911.53
其中：基金申购款	357,410.73	-1,874,534.34	-1,517,123.61
基金赎回款	-332,412.66	-6,016,375.26	-6,348,787.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,973,597.87	-2,618,847.97	354,749.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	91,424.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,235.56
其他	1,608.89
合计	94,269.33

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	253,337,826.84
减：卖出股票成本总额	248,608,839.44
买卖股票差价收入	4,728,987.40

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,574,826.40
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,574,826.40
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,115,430.73
——股票投资	-6,115,430.73
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-6,115,430.73

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	189,282.31
合计	189,282.31

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	690,784.35
银行间市场交易费用	-
合计	690,784.35

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	178,522.11

上市年费	29,752.89
银行汇划费用	574.00
指数使用费	100,000.00
债券账户服务费	4,500.00
合计	343,101.78

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000.00 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期和本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,810,753.38
其中：支付销售机构的客户维护费	110,585.50

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	362,150.67

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未通关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	35,870,648.11	91,424.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2014-06-12	资产重组	63.30	2014-09-19	-	78,519.00	3,196,818.12	4,970,252.70	-
600129	太极集团	2014-06-24	重大事项	8.56	2014-07-02	8.60	150,196.00	1,290,787.89	1,285,677.76	-

注：本基金截至 2014 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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“在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值”的投资目标。

本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业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由监察稽核部负责，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。监察稽核部由督察长分管，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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 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中国农业银行，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。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 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公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,870,648.11	-	-	-	35,870,648.11
结算备付金	479,872.17	-	-	-	479,872.17
存出保证金	83,217.02	-	-	-	83,217.02
交易性金融资产	-	-	-	335,887,900.70	335,887,900.70
应收利息	-	-	-	4,587.85	4,587.85
应收申购款	1,988.08	-	-	27,933.39	29,921.47
其他资产	-	-	-	30,247.11	30,247.11
资产总计	36,435,725.38	-	-	335,950,669.05	372,386,394.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,009,364.03	4,009,364.03
应付赎回款	-	-	-	509,008.86	509,008.86
应付管理人报酬	-	-	-	299,919.24	299,919.24
应付托管费	-	-	-	59,983.84	59,983.84
应付交易费用	-	-	-	230,338.03	230,338.03
其他负债	-	-	-	260,193.20	260,193.20
负债总计	-	-	-	5,368,807.20	5,368,807.20
利率敏感度缺口	36,435,725.38	-	-	330,581,861.85	367,017,587.23
上年度末 2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,424,266.83	-	-	-	26,424,266.83
结算备付金	166,194.65	-	-	-	166,194.65
存出保证金	250,576.05	-	-	-	250,576.05
交易性金融资产	-	-	-	408,143,258.99	408,143,258.99
应收证券清算款	-	-	-	4,258,581.98	4,258,581.98
应收利息	-	-	-	5,530.37	5,530.37
应收申购款	1,988.08	-	-	39,841.27	41,829.35
资产总计	26,843,025.61	-	-	412,447,212.61	439,290,238.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,916,291.30	6,916,291.30

应付管理人报酬	-	-	-	390,621.57	390,621.57
应付托管费	-	-	-	78,124.31	78,124.31
应付交易费用	-	-	-	361,490.79	361,490.79
其他负债	-	-	-	136,066.35	136,066.35
负债总计	-	-	-	7,882,594.32	7,882,594.32
利率敏感度缺口	26,843,025.61	-	-	404,564,618.29	431,407,643.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2014 年 12 月 31 日：同）

6.4.13.4.2 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。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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	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	335,887,900.70	91.52	408,143,258.99	94.61

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	335,887,900.70	91.52	408,143,258.99	94.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 06 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级的余额为 329,631,970.24 元，第二层级的余额为 6,255,930.46 元，无属于第三层级的余额。(2013 年 12 月 31 日：第一层级：397,048,323.79 元，第二层级 11,094,935.20 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	335,887,900.70	90.20
	其中：股票	335,887,900.70	90.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	36,350,520.28	9.76
7	其他各项资产	147,973.45	0.04
8	合计	372,386,394.43	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	281,954,974.51	76.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,948,770.95	1.35
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	9,078,572.56	2.47
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	295,982,318.02	80.65

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,964,238.68	10.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	2,941,344.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,905,582.68	10.87

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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：人民币元

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(%)
1	600276	恒瑞医药	585,413	19,412,295.08	5.29
2	600535	天士力	464,006	17,989,512.62	4.90
3	600518	康美药业	1,090,965	16,309,926.75	4.44
4	000538	云南白药	309,775	16,170,255.00	4.41
5	000423	东阿阿胶	405,689	13,517,557.48	3.68
6	600079	人福医药	324,603	9,689,399.55	2.64
7	600332	白云山	387,397	9,642,311.33	2.63
8	600594	益佰制药	217,234	8,934,834.42	2.43
9	600085	同仁堂	467,926	8,155,950.18	2.22
10	600252	中恒集团	656,147	7,696,604.31	2.10
11	600557	康缘药业	256,261	7,354,690.70	2.00
12	600587	新华医疗	98,447	7,339,223.85	2.00
13	300003	乐普医疗	314,243	6,567,678.70	1.79
14	002422	科伦药业	162,426	6,472,676.10	1.76
15	300026	红日药业	189,894	5,563,894.20	1.52
16	300273	和佳股份	173,830	5,336,581.00	1.45
17	000999	华润三九	279,136	5,133,311.04	1.40

18	300147	香雪制药	185,424	5,006,448.00	1.36
19	002252	上海莱士	78,519	4,970,252.70	1.35
20	600267	海正药业	332,919	4,937,188.77	1.35
21	002219	恒康医疗	218,774	4,808,652.52	1.31
22	002001	新和成	355,212	4,401,076.68	1.20
23	600572	康恩贝	314,733	4,365,346.71	1.19
24	600436	片仔癀	53,407	4,140,644.71	1.13
25	600216	浙江医药	441,021	4,035,342.15	1.10
26	600664	哈药股份	646,337	4,020,216.14	1.10
27	600422	昆明制药	186,463	3,917,587.63	1.07
28	600062	华润双鹤	223,802	3,847,156.38	1.05
29	002223	鱼跃医疗	158,161	3,835,404.25	1.05
30	002294	信立泰	127,058	3,814,281.16	1.04
31	600351	亚宝药业	405,663	3,732,099.60	1.02
32	300015	爱尔眼科	147,416	3,588,105.44	0.98
33	000513	丽珠集团	73,344	3,464,037.12	0.94
34	600521	华海药业	309,502	3,419,997.10	0.93
35	300039	上海凯宝	265,904	3,334,436.16	0.91
36	000788	北大医药	217,127	3,295,987.86	0.90
37	000566	海南海药	298,802	3,250,965.76	0.89
38	000739	普洛药业	479,645	3,055,338.65	0.83
39	600763	通策医疗	71,341	2,912,139.62	0.79
40	000915	山大华特	108,300	2,893,776.00	0.79
41	002317	众生药业	143,742	2,870,527.74	0.78
42	002399	海普瑞	151,500	2,830,020.00	0.77
43	600812	华北制药	571,718	2,807,135.38	0.76
44	002653	海思科	135,945	2,610,144.00	0.71
45	002432	九安医疗	119,561	2,589,691.26	0.71
46	300347	泰格医药	76,965	2,578,327.50	0.70
47	002262	恩华药业	114,472	2,542,423.12	0.69
48	600329	中新药业	161,861	2,507,226.89	0.68
49	600993	马应龙	153,173	2,406,347.83	0.66
50	002020	京新药业	122,523	2,205,414.00	0.60
51	600380	健康元	423,378	2,133,825.12	0.58
52	600750	江中药业	129,901	2,035,548.67	0.55
53	002393	力生制药	67,205	1,961,713.95	0.53
54	002275	桂林三金	107,231	1,627,766.58	0.44
55	600129	太极集团	150,196	1,285,677.76	0.35
56	002287	奇正藏药	32,144	657,344.80	0.18

7.3.2 期末积极投资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：人民币元

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(%)
1	300267	尔康制药	110,500	3,813,355.00	1.04
2	002437	誉衡药业	69,800	3,594,700.00	0.98
3	000919	金陵药业	213,000	2,964,960.00	0.81
4	300244	迪安诊断	67,200	2,941,344.00	0.80
5	300238	冠昊生物	56,100	2,853,246.00	0.78
6	002550	千红制药	135,100	2,614,185.00	0.71
7	002424	贵州百灵	103,384	2,549,449.44	0.69
8	002433	太安堂	243,400	2,507,020.00	0.68
9	300298	三诺生物	47,800	1,907,220.00	0.52
10	002603	以岭药业	64,300	1,891,706.00	0.52
11	300030	阳普医疗	137,400	1,710,630.00	0.47
12	000590	紫光古汉	104,276	1,484,890.24	0.40
13	300326	凯利泰	38,600	1,446,728.00	0.39
14	300110	华仁药业	183,900	1,381,089.00	0.38
15	600789	鲁抗医药	274,600	1,370,254.00	0.37
16	300206	理邦仪器	61,400	1,303,522.00	0.36
17	002099	海翔药业	184,000	1,275,120.00	0.35
18	002198	嘉应制药	139,400	1,235,084.00	0.34
19	300246	宝莱特	41,000	1,061,080.00	0.29

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

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	600276	恒瑞医药	7,594,341.38	1.76
2	600535	天士力	6,502,941.91	1.51
3	000538	云南白药	6,285,331.59	1.46
4	600518	康美药业	6,229,942.83	1.44
5	000423	东阿阿胶	4,961,289.70	1.15
6	300003	乐普医疗	4,485,034.13	1.04
7	002437	誉衡药业	3,708,539.28	0.86
8	600332	白云山	3,461,078.42	0.80
9	300267	尔康制药	3,443,571.12	0.80
10	600763	通策医疗	3,291,374.99	0.76
11	600196	复星医药	3,288,704.64	0.76
12	600594	益佰制药	3,157,390.05	0.73
13	600079	人福医药	3,143,670.92	0.73

14	300026	红日药业	3,115,973.82	0.72
15	002252	上海莱士	3,072,161.50	0.71
16	600085	同仁堂	2,889,525.84	0.67
17	300244	迪安诊断	2,886,319.96	0.67
18	000919	金陵药业	2,822,165.28	0.65
19	600252	中恒集团	2,805,882.42	0.65
20	300238	冠昊生物	2,702,001.14	0.63

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。

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

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	600196	复星医药	18,609,845.88	4.31
2	002038	双鹭药业	11,338,349.16	2.63
3	000623	吉林敖东	10,628,475.28	2.46
4	002022	科华生物	9,177,331.52	2.13
5	000661	长春高新	8,948,248.07	2.07
6	600867	通化东宝	8,030,229.82	1.86
7	600518	康美药业	7,482,801.04	1.73
8	600201	金宇集团	7,384,523.34	1.71
9	002007	华兰生物	7,317,097.37	1.70
10	600276	恒瑞医药	7,063,469.30	1.64
11	000538	云南白药	6,910,378.99	1.60
12	600535	天士力	6,472,019.08	1.50
13	600645	中源协和	6,079,262.61	1.41
14	000423	东阿阿胶	5,788,163.25	1.34
15	002030	达安基因	4,529,864.81	1.05
16	600332	白云山	4,318,409.80	1.00
17	002004	华邦颖泰	3,967,310.98	0.92
18	600161	天坛生物	3,940,973.84	0.91
19	600252	中恒集团	3,360,340.23	0.78
20	600085	同仁堂	3,337,566.02	0.77

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。

7.4.3 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	182,468,911.88
卖出股票的收入（成交）总额	253,337,826.84

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。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	83,217.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,587.85
5	应收申购款	29,921.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.11
8	其他	-
9	合计	147,973.45

7.12.2 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处于转股期的可转换债券。

7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.3.1 期末指数投资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。

7.12.3.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	持有份额	占总份额	

				额比例		比例
国泰医药	2,145	26,109.02	4,376,871.00	7.82%	51,626,969.28	92.18%
医药 A	378	416,560.16	123,070,443.00	78.16%	34,389,298.00	21.84%
医药 B	2,084	75,556.50	46,758,892.00	29.70%	110,700,849.00	70.30%
合计	4,607	80,512.99	174,206,206.00	46.97%	196,717,116.28	53.03%

8.2 期末上市基金前十名持有人

医药A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	30,037,307.00	19.08%
2	新华人寿保险股份有限公司	24,577,751.00	15.61%
3	宝钢集团有限公司钢铁业企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	11,663,267.00	7.41%
4	中国人寿保险（集团）公司企业年金计划—中国农业银行股份有限公司	10,910,768.00	6.93%
5	江苏省国信资产管理集团有限公司企业年金计划—招商银行股份有限公司	4,566,100.00	2.90%
6	中国石油化工集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	4,188,600.00	2.66%
7	郑州铁路局企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	3,516,679.00	2.23%
8	呼和浩特铁路局企业年金计划—中国银行股份有限公司	3,319,600.00	2.11%
9	邹瀚枢	2,978,108.00	1.89%
10	丁为民	2,679,800.00	1.70%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

医药B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	汇丰人寿保险有限公司— 积极进取投资账户	10,289,732.00	6.53%
2	中国对外经济贸易信托有 限公司—华夏未来领时 对冲 1 号集合资	8,557,682.00	5.43%
3	东莞证券—招行—旗峰 1 号策略精选集合资产管理 计划	6,052,669.00	3.84%
4	上海安信农业保险股份有 限公司	5,965,600.00	3.79%
5	叶淑贤	4,919,885.00	3.12%
6	国泰人寿保险有限责任公 司—投连	4,115,469.00	2.61%
7	汇丰人寿保险有限公司— 平衡增长投资账户	3,115,320.00	1.98%
8	邹瀚枢	2,978,108.00	1.89%
9	王文宝	2,437,131.00	1.55%
10	李怡名	2,166,670.00	1.38%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

8.3 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	国泰医药	39,440.19	0.07%
	医药 A	0.00	0.00%
	医药 B	0.00	0.00%
	合计	39,440.19	0.01%

8.4 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	国泰医药	0
	医药 A	0
	医药 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	国泰医药	0
	医药 A	0
	医药 B	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰医药	医药 A	医药 B
基金合同生效日（2013 年 8 月 29 日）基金份额总额	500,660,152.14	-	-
本报告期期初基金份额总额	88,656,122.83	165,859,728.00	165,859,728.00
本报告期基金总申购份额	92,338,427.80	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	146,672,740.99	-	-
本报告期基金拆分变动份额	21,682,030.64	-8,399,987.00	-8,399,987.00
本报告期末基金份额总额	56,003,840.28	157,459,741.00	157,459,741.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中投证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	138,136,870.59	31.70%	125,759.68	32.34%	-
银河证券	1	126,377,125.83	29.00%	115,052.90	29.59%	-
申银万国	1	54,239,416.94	12.45%	49,379.82	12.70%	-
东兴证券	1	29,239,016.04	6.71%	20,771.48	5.34%	-
中投证券	1	25,403,718.63	5.83%	23,127.62	5.95%	-
广发证券	1	16,273,210.21	3.73%	14,815.08	3.81%	-
海通证券	1	12,951,129.02	2.97%	11,790.55	3.03%	-
国信证券	2	10,410,873.56	2.39%	9,478.31	2.44%	-
川财证券	2	10,356,716.72	2.38%	7,357.42	1.89%	-
国金证券	1	7,720,478.54	1.77%	7,028.79	1.81%	-
中信建投	2	3,311,719.70	0.76%	3,014.99	0.78%	-
华泰联合证券	1	1,386,462.94	0.32%	1,262.23	0.32%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 财力雄厚，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。

10.7.2 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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
中投证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	14,500,000.00	100.00%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间医药 A 份额停牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-03
2	关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-06
3	关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之医药 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-06
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》、《证券日报》	2014-02-19
5	国泰基金管理有限公司总部迁址公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-02-24
6	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》	2014-02-27

7	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-03-15
8	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》	2014-06-06
9	国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-06-25

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于同意国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金募集的批复
- 2、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金合同
- 3、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

11.2 存放地点

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。

11.3 查阅方式

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>

国泰基金管理有限公司

二〇一四年八月二十九日