

**国泰中小盘成长股票型证券投资基金  
(LOF) (原金盛证券投资基金转型)  
2009 年年度报告**

2009 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一〇年三月二十九日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年3月22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。

本基金系原封闭式基金金盛证券投资基金转型而来。金盛证券投资基金自2009年7月21日0时起至2009年8月20日17时止以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金管理人于2009年8月22日发布了《关于金盛证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并向中国证监会申请持有人大会决议生效。经中国证监会《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》（证监许可[2009]925号）核准，本基金管理人于2009年9月16日发布了《金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，并向深交所申请提前终止金盛证券投资基金的上市交易，获得深交所《关于同意金盛证券投资基金终止上市的批复》（深证复[2009]35号）同意。

从2009年10月19日起金盛证券投资基金终止上市，并自金盛证券投资基金终止上市之日起，基金名称更改为“国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)”，《金盛证券投资基金基金合同》修订为《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》，原《金盛证券投资基金基金合同》失效，《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日生效。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告中，原金盛证券投资基金报告期自2009年1月1日至2009年10月18日止，国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)报告期自2009年10月19日至2009年12月31日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 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.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF).....	7
3.1.1 基金净值表现.....	7
3.1.2 自本基金转型以来的利润分配情况.....	9
3.1.3 金盛证券投资基金.....	9
3.2 金盛证券投资基金.....	9
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2.2 基金净值表现.....	9
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§ 5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告.....	15
6.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF).....	15
6.2 金盛证券投资基金.....	16
§ 7 年度财务报表.....	18
7.1 金盛证券投资基金.....	18
7.1.1 资产负债表.....	18
7.1.2 利润表.....	19
7.1.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	20
7.1.4 报表附注.....	21
7.2 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF).....	38
7.2.1 资产负债表.....	38
7.2.2 利润表.....	40
7.2.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	40

7.2.4 报表附注 .....	41
§ 8 投资组合报告 .....	58
8.1 金盛证券投资基金 .....	58
8.1.1 期末基金资产组合情况 .....	58
8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
8.1.3 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 .....	59
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	60
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
8.1.6 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 .....	62
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	62
8.1.8 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 .....	63
8.1.9 投资组合报告附注 .....	63
8.2 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF) .....	63
8.2.1 期末基金资产组合情况 .....	63
8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	64
8.2.3 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 .....	64
8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	66
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
8.2.6 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 .....	67
8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	67
8.2.8 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 .....	67
8.2.9 投资组合报告附注 .....	68
§ 9 基金份额持有人信息 .....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
§ 10 开放式基金份额变动 .....	70
§ 11 重大事件揭示 .....	70
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
§ 13 备查文件目录 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

<b>国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)</b>	
基金名称	国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	国泰中小盘成长股票(LOF)
基金主代码	160211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月19日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,111,289,319.09份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010-01-07
<b>金盛证券投资基金</b>	
基金名称	金盛证券投资基金
基金简称	国泰金盛封闭
基金主代码	184703
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2000年4月26日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	500,000,000份
基金合同存续期	至2009年10月18日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2000-06-30

注：金盛证券投资基金终止上市日期为2009年10月19日。

### 2.2 基金产品说明

<b>国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)</b>	
投资目标	本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的大类资产配置主要通过宏观经济发展趋势的预测分析，评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。其中，股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象，采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。
业绩比较基准	本基金的业绩基准=35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债

	指数
风险收益特征	本基金是股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司，属于高风险的证券投资基金品种。
<b>金盛证券投资基金</b>	
投资目标	本基金是以涉及新兴产业的上市公司为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据利率的走势和通货膨胀预期决定本基金的债券投资比例；根据国家的产业政策以及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司的价值分析和其在行业中的竞争优势分析选择所要投资的股票。 本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的较大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。
风险收益特征	承担较高风险，获取较高的超额收益。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	尹东
	联系电话	021-38561600 转	010-67595003
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-888-8688	010-67595096
传真		021-38561800	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区峨山路91弄98号201A	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈勇胜	郭树清

### 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》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	广东省深圳市深南中路1093号中信大厦18楼

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

#### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	2009年10月19日-2009年12月31日
本期已实现收益	3,313,410.58
本期利润	108,394,876.71
加权平均基金份额本期利润	0.0386
本期加权平均净值利润率	3.82%
本期基金份额净值增长率	9.84%
3.1.1.2 期末数据和指标	2009年12月31日
期末可供分配利润	72,681,213.52
期末可供分配基金份额利润	0.0142
期末基金资产净值	5,172,690,478.54
期末基金份额净值	1.012
3.1.1.3 累计期末指标	2009年12月31日
基金份额累计净值增长率	9.84%

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2009年10月19日，截止至2009年12月31日不满一年。

### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 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	净值增长率 ①	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
自基金转型起至今	9.84%	0.53%	12.03%	1.47%	-2.19%	-0.94%

### 3.1.2.2 自基金转型以来基金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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2009年10月19日至2009年12月31日)

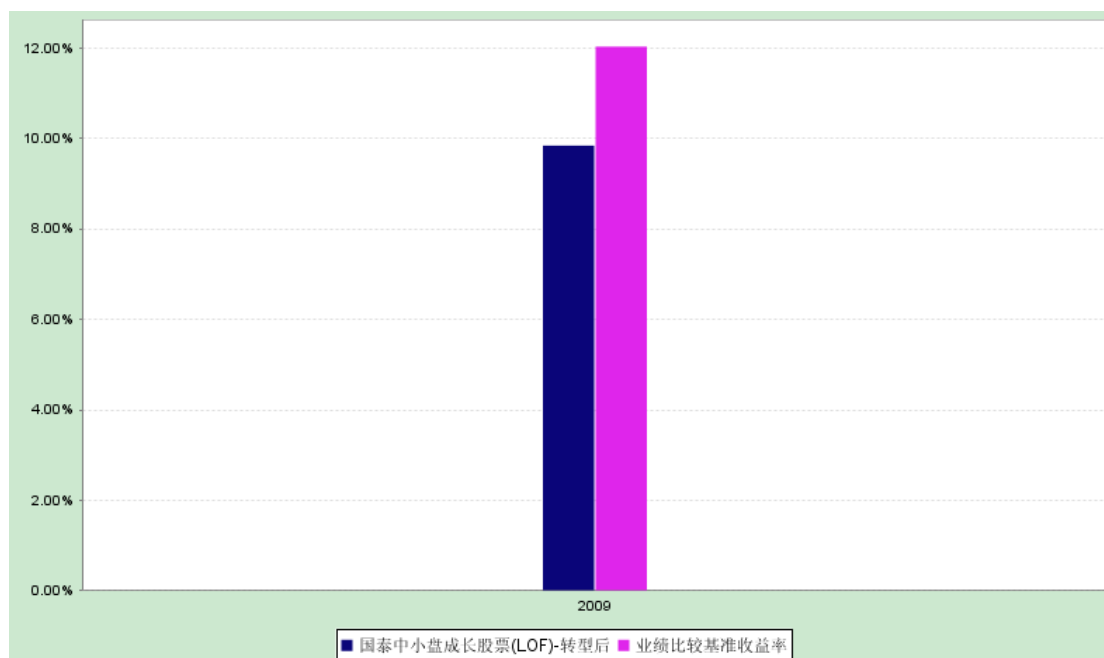


注：(1) 本基金的转型日为2009年10月19日，截止至2009年12月31日不满一年；  
(2) 本基金的建仓期为6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.1.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)  
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较图





注：2009年图示的指标计算期间为基金转型日2009年10月19日至2009年12月31日。

### 3.1.3 自本基金转型以来的利润分配情况

本基金自转型日(2009年10月19日)至2009年12月31日,未进行利润分配。

## 3.2 金盛证券投资基金

### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	2009年1月1日至 2009年10月18日	2008年	2007年
本期已实现收益	249,630,118.94	-374,412,414.06	1,364,439,882.38
本期利润	269,423,170.86	-537,400,628.73	1,126,088,735.72
加权平均基金份额本期利润	0.5388	-1.0748	2.2522
本期加权平均净值利润率	39.83%	-64.83%	71.83%
本期基金份额净值增长率	52.11%	-44.78%	123.11%
3.2.1.2 期末数据和指标	2009年10月18日	2008年末	2007年末
期末可供分配利润	7,805,115.54	-1,825,003.40	786,087,407.68
期末可供分配基金份额利润	0.0156	-0.0037	1.5722
期末基金资产净值	549,926,313.74	520,503,142.88	1,471,403,768.63
期末基金份额净值	1.0999	1.0410	2.9428
3.2.1.3 累计期末指标	2009年10月18日	2008年末	2007年末
基金份额累计净值增长率	374.51%	211.96%	465.25%

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。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 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

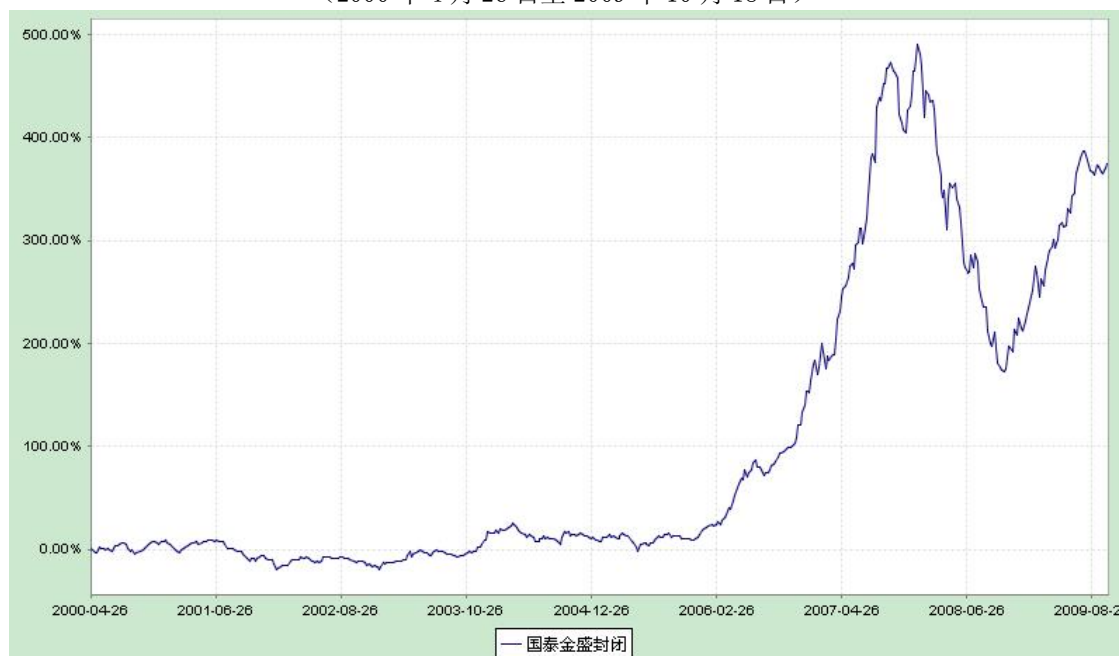
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.00%	0.63%	-	-	-	-
过去六个月	5.50%	1.39%	-	-	-	-
过去一年	52.11%	2.41%	-	-	-	-
过去三年	87.39%	3.59%	-	-	-	-
过去五年	325.72%	3.17%	-	-	-	-
自基金合同生效 至今	374.51%	2.67%	-	-	-	-

注：(1)、本基金自2009年10月19日起转型为开放式基金，2009年10月18日为本基金转型前最后一日，故将“过去三个月”、“过去六个月”、“过去一年”、“过去三年”、“过去五年”、“自基金合同生效起至今”等时间段相应地改为“2009年10月1日至2009年10月18日”、“2009年7月1日至2009年10月18日”、“2009年1月1日至2009年10月18日”、“2007年1月1日至2009年10月18日”、“2005年1月1日至2009年10月18日”、“自基金合同生效起至2009年10月18日”。

(2)、本基金无业绩比较基准。

#### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金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

金盛证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2000年4月26日至2009年10月18日)



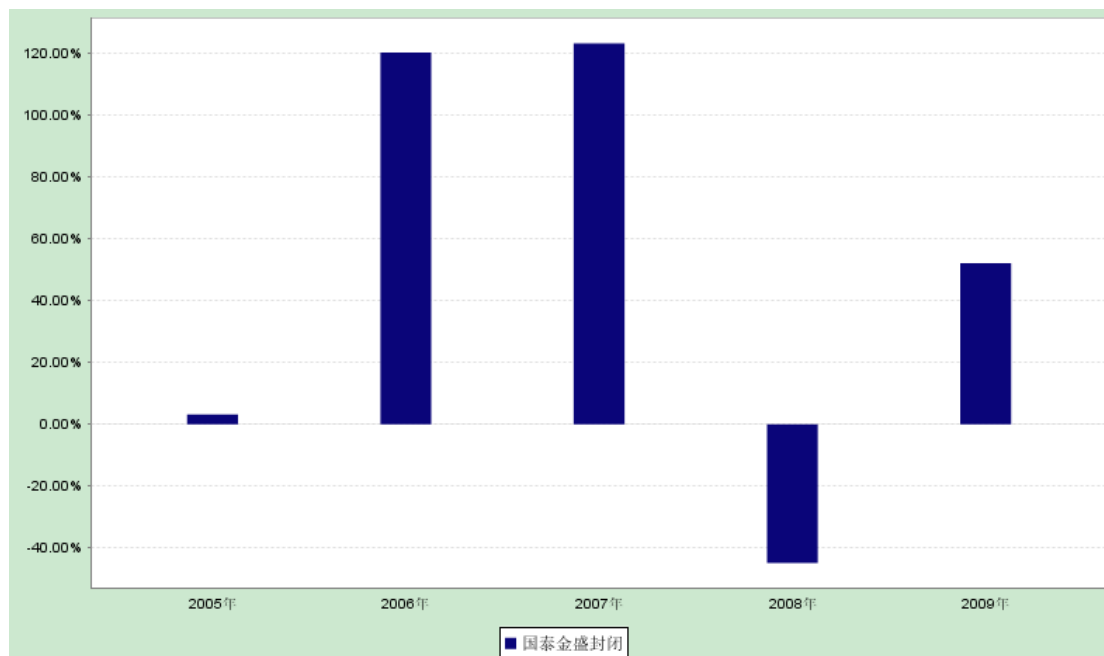
注：本基金由原珠江投资基金按照有关法律法规清理规范扩募而成，本基金的合同生效日为2000年4月26日。根据基金合同，本基金资产存在一定的调整期，调整期为自移交基准日起的

六个月，自调整期结束后，本基金各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的规定。

### 3.2.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 金盛证券投资基金

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较图



注：(1)、2009年图示的指标计算期间为2009年1月1日至2009年10月18日；  
(2)、本基金根据基金合同无业绩比较基准。

### 3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009年	4.800	240,000,000.00	-	240,000,000.00	-
2008年	8.270	413,499,997.02	-	413,499,997.02	-
2007年	15.200	760,000,000.00	-	760,000,000.00	-
合计	28.270	1,413,499,997.02	-	1,413,499,997.02	-

## § 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2009年12月31日，本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金：金泰

证券投资基金、金鑫证券投资基金，以及 12 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（二期）、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（由金盛证券投资基金转型而来）。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 18 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 4 月 1 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张玮	国泰金盛封闭的基金经理、国泰中小盘成长股票的基金经理、国泰金鹰增长股票的基金经理	2009-04-22	-	9	硕士研究生。2000 年 11 月至 2004 年 6 月就职于申银万国证券研究所，任行业研究员。2004 年 7 月至 2007 年 3 月就职于银河基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理。2007 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹰增长股票的基金经理助理，2008 年 5 月起担任国泰金鹰增长股票的基金经理，2009 年 4 月至 2009 年 10 月兼任国泰金盛封闭的基金经理，2009 年 10 月起任国泰中小盘成长股票的基金经理。
吴战峰	国泰金盛封闭的基金经理	2008-04-03	2009-08-27	14	硕士研究生。曾任职于深圳中大投资基金管理公司、平安证券公司、招商证券公司、国信证券公司、国投瑞银基金管理有限公司。2007 年 10 月加盟国泰基金管理有限公司，2008 年 4 月至 2009 年 8 月任国泰金盛封闭的基金经理。

- 1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。
- 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。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金合同生效日为2009年10月19日，截止本报告期末不满完整投资年度，不作比较。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009年A股率先从金融危机的阴影中走出，继2008年超过65%的大幅下跌之后，又出现高达80%强烈上涨，两年来的单边极端走势令投资人感叹不已。金融危机发生后，中国和世界其他国家政府果断采取的积极经济刺激政策，有效地遏制了下滑的经济态势，股市作为经济的晴雨表则提前作出了反映。A股市场在流动性推升估值、实体经济复苏提高业绩的双重因素作用下，取得其20年历史上第五大年度涨幅，同时位居全球股市涨幅榜第七。

出于对经济复苏形势的谨慎判断，2009年上半年本基金资产配置较为保守，股票仓位偏轻。下半年配合开展基金封转开、扩募等工作，股票仓位仍保持在较低水平。基于对大消费板块的看好，我们重点配置了汽车、家电、地产、医药、食品饮料等泛消费行业，同时持续配置与低碳经济有关的品种，并对有持续高增长潜力的优秀中小市值企业采取了长期持有的策略，取得了较好效果。2009年最后一个月，本基金转型扩募完成并进入建仓期，出于对投资风险的谨慎考虑，建仓节奏稳健，布局侧重中盘成长股。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金盛封闭 2009 年 1 月 1 日至 10 月 18 日期间的净值增长率为 52.11%；国泰中小盘成长股票（LOF）2009 年 10 月 19 日至 12 月 31 日期间的净值增长率为 9.84%，同期业绩比较基准为 12.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2010 年，我们认为刺激政策的退出将是大概率事件，经济将回归正常运转轨道。为实现保增长、调结构、管理通胀预期的目标，需加强政策调控的“针对性和灵活性”，而调控政策和经济复苏增长将成为影响 2010 年股市的两大重要因素。目前 A 股市场整体估值水平不算很贵，但继续大幅攀升也不很现实。在震荡市场中，将更多表现为结构性机会，因此自下而上精选个股的投资策略可能更为有效。

作为中小盘成长基金，在经济增长基础还较为脆弱的复苏阶段，我们对投资标的选择强调盈利增长的确定性和持续性，并兼顾合理估值。在建仓阶段，先布局 PEG 指标较低的中盘蓝筹成长股，同时耐心等待优质小盘成长股估值合理回归后的建仓机会。

我们 2010 年全年的投资主线，一是产业结构升级背景下的装备制造、信息技术、生产服务等行业；二是经济转型、消费升级背景下的汽车、家电、医药、食品饮料等行业；三是投资拉动背景下的工程机械、钢铁、建材、化工等中游行业。另外还将关注低碳经济、区域经济、通胀预期、并购重组等的主题性投资机会。同时，强化价值投资理念，更加注重寻找具有长期增长潜力企业的战略性买入机会，耐心地中长期持股，以分享随着时间而不断增长的企业价值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

2010 年本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规规定，成立了估值委员会，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普华永道会计师事务所进

行审核并出具报告,由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责,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、会计核算等证券投资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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

国泰金盛封闭基金已于2009年9月23日实施利润分配240,000,000.00元。国泰中小盘成长股票(LOF)基金,截止2009年12月31日可供分配利润为72,681,213.52元,可供分配的份额利润为0.0142元。截止本报告期末,本基金合同生效未满3个月,根据本基金合同的约定可不进行收益分配。

### §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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。本基金转型前基金金盛证券投资基金实施利润分配的金额为240,000,000元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### §6 审计报告

#### 6.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

普华永道中天审字(2010)第20222号

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:

我们审计了后附的国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“国泰中小盘成长基金”)的财务报表,包括2009年12月31日的资产负债表、2009年10月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

#### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定

编制财务报表是国泰中小盘成长基金的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

## 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了国泰中小盘成长基金2009年12月31日的财务状况以及2009年10月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师：薛竞

中国·上海市  
2010年3月24日

注册会计师：陈宇

## 6.2 金盛证券投资基金

普华永道中天审字(2010)第20209号

金盛证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金盛证券投资基金(以下简称“基金金盛”)的财务报表，包括2009年10月18日(基金合同失效前日)的资产负债表、2009年1月1日至2009年10月



18日(基金合同失效前日)止期间的的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是基金金盛的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了基金金盛2009年10月18日(基金合同失效前日)的财务状况以及2009年1月1日至2009年10月18日(基金合同失效前日)止期间的的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师：薛竞

中国·上海市

注册会计师：陈宇

2010年3月24日

## §7 年度财务报表

### 7.1 金盛证券投资基金

#### 7.1.1 资产负债表

会计主体：金盛证券投资基金

报告截止日：2009年10月18日

单位：人民币元

资产	附注号	本期 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.1.4.7.1	55,757,621.85	20,557,565.52
结算备付金		445,502.94	2,901,421.88
存出保证金		422,304.52	391,375.85
交易性金融资产	7.1.4.7.2	486,842,787.58	512,733,092.26
其中：股票投资		176,644,487.58	356,945,529.50
基金投资		-	-
债券投资		310,198,300.00	155,787,562.76
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.1.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,021,077.22	-
应收利息	7.1.4.7.5	4,544,830.37	4,548,563.71
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.1.4.7.6	-	-
资产总计		552,034,124.48	541,132,019.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期 2009年10月18日</b>	<b>上年度末 2008年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	9,000,000.00
应付证券清算款		-	9,519,707.36
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		401,997.49	362,523.84
应付托管费		66,999.59	60,420.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.1.4.7.7	455,716.23	793,882.81
应交税费		287,030.48	287,030.48
应付利息		-	36.00
应付利润		283,104.68	283,104.68

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.1.4.7.8	612,962.27	322,170.50
负债合计		2,107,810.74	20,628,876.34
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.1.4.7.9	500,000,000.00	500,000,000.00
未分配利润	7.1.4.7.10	49,926,313.74	20,503,142.88
所有者权益合计		549,926,313.74	520,503,142.88
负债和所有者权益总计		552,034,124.48	541,132,019.22

注：(1) 报告截止日 2009 年 10 月 18 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.0999 元，基金份额总额 500,000,000.00 份。

(2) 本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 10 月 18 日(基金合同失效前日)。

### 7.1.2 利润表

会计主体：金盛证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 10 月 18 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日-2009 年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008 年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>279,211,261.35</b>	<b>-509,591,156.47</b>
1. 利息收入		5,787,003.68	7,879,959.27
其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	390,989.61	525,133.88
债券利息收入		5,332,600.44	7,228,371.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		63,413.63	126,454.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		253,631,205.75	-354,504,888.65
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	253,625,888.54	-359,526,623.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-2,973,184.80	1,285,432.21
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.1.4.7.14	-	43,133.54
股利收益	7.1.4.7.15	2,978,502.01	3,693,169.43
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.1.4.7.16	19,793,051.92	-162,988,214.67
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.1.4.7.17	-	21,987.58
<b>减：二、费用</b>		<b>9,788,090.49</b>	<b>27,809,472.26</b>
1. 管理人报酬		5,433,485.05	9,915,070.77
2. 托管费		908,999.97	1,653,680.30

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.1.4.7.18	2,352,679.89	13,664,781.87
5. 利息支出		144.00	831,965.92
其中：卖出回购金融资产支出		144.00	831,965.92
6. 其他费用	7.1.4.7.19	1,092,781.58	1,743,973.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>269,423,170.86</b>	<b>-537,400,628.73</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>269,423,170.86</b>	<b>-537,400,628.73</b>

### 7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金盛证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年10月18日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18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）	500,000,000.00	20,503,142.88	520,503,142.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	269,423,170.86	269,423,170.86
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
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）	-	-240,000,000.00	-240,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	49,926,313.74	549,926,313.74
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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）	500,000,000.00	971,403,768.63	1,471,403,768.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-537,400,628.73	-537,400,628.73
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
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“-”	-	-413,499,997.02	-413,499,997.02

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	20,503,142.88	520,503,142.88

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

#### 7.1.4 报表附注

##### 7.1.4.1 基金基本情况

金盛证券投资基金(以下简称“本基金”)的前身是珠江投资基金(以下简称“珠江基金”)。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[2000]39号文及中国证监会证监基金字[2000]40号文批准,珠江投资基金进行了规范清理,并于2000年4月26日办理了基金资产移交手续,并正式更名为金盛证券投资基金。本基金由国泰君安证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司两家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《金盛证券投资基金基金契约》(后更名为《金盛证券投资基金基金合同》)发起,于1994年12月1日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期为10年,发行规模为233,640,000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。本基金经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2000]79号文审核同意,于2000年6月30日在深交所挂牌交易。

本基金于2000年9月8日将基金份额总额由原有的233,640,000份基金份额扩募至5亿份基金份额,存续期限延长5年至2009年11月30日,扩募部分基金份额于2000年9月21日上市交易。

根据本基金基金份额持有人大会2009年8月20日审议通过的《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》以及中国证监会证监许可[2009]925号《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》,本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于2009年9月16日发布《国泰基金管理有限公司关于金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》,向深交所申请提前终止本基金的上市交易,并获深交所深证复[2009]35号《关于同意金盛证券投资基金终止上市的批复》同意。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《金盛证券投资基金基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》和《国泰基金管理有限公司关于金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》等的有关规定,本基金于2009年10月16日进行终止上市权利登记,2009年10月19日终止上市,《金盛证券投资基金基金合同》自终止上市日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字[2000]40号文的有关规定,本基金的投资范围为良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中股票投资部分重点投资于沪深两市涉及新兴产业的上市公司。

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2010年3月24日批准报出。

#### 7.1.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金盛证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如报表附注7.1.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

经中国证监会批准并经深交所同意,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中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)并相应延长存续期至不定期,因此本财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009年1月1日至2009年10月18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2009年10月18日(基金合同失效前日)的财务状况以及2009年1月1日至2009年10月18日(基金合同失效前日)止期间的的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2009年1月1日至2009年10月18日(基金合同失效前日)。

##### 7.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍

生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### 7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

### 7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

### 7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。

#### 7.1.4.4.8 损益平准金

不适用。

#### 7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。



## (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a) 对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.1.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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:

(a) 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。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c)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派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(d)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。

#### 7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.1.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
活期存款	55,757,621.85	20,557,565.52
定期存款	-	-
其中:存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	55,757,621.85	20,557,565.52

##### 7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2009年10月18日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	134,239,586.58	176,644,487.58	42,404,901.00	
债券	交易所市场	41,536,252.80	41,518,300.00	-17,952.80
	银行间市场	268,945,750.00	268,680,000.00	-265,750.00
	合计	310,482,002.80	310,198,300.00	-283,702.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	444,721,589.38	486,842,787.58	42,121,198.20	
项目	上年度末 2008年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	335,163,539.78	356,945,529.50	21,781,989.72	
债券	交易所市场	20,447,056.20	20,460,562.76	13,506.56
	银行间市场	134,794,350.00	135,327,000.00	532,650.00
	合计	155,241,406.20	155,787,562.76	546,156.56
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	490,404,945.98	512,733,092.26	22,328,146.28
----	----------------	----------------	---------------

注：(1)于2009年10月18日(基金合同失效前日)，股票投资余额中无按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票(2008年12月31日：3,748,500.00元，采用该估值技术的股票投资于2008年度利润表中确认的公允价值变动损失为3,004,002.78元)。

(2)债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为798,400.00元(2008年度：公允价值变动收益793,350.00元)。

#### 7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	32,154.35	5,170.83
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	1,937.60	1,407.15
应收债券利息	4,510,600.66	4,541,917.51
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	137.76	68.22
合计	4,544,830.37	4,548,563.71

#### 7.1.4.7.6 其他资产

截至2009年10月18日止，其他资产余额为零(2008年12月31日：同)。

#### 7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	453,141.23	792,932.81
银行间市场应付交易费用	2,575.00	950.00
合计	455,716.23	793,882.81

**7.1.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	-	-
预提费用	350,791.77	60,000.00
其他应付款	12,170.50	12,170.50
合计	612,962.27	322,170.50

**7.1.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年10月18日(基金合同失效前日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	500,000,000.00	500,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	500,000,000.00	500,000,000.00

注：根据《金盛证券投资基金扩募说明书》的有关规定，在本基金存续期间，基金发起人持有的基金份额不得低于基金总规模的0.5%。于2009年10月18日(基金合同失效前日)，基金发起人持有的非流通部分基金份额为22,459,392.00份(2008年12月31日：同)。

**7.1.4.7.10 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	-1,825,003.40	22,328,146.28	20,503,142.88
本期利润	249,630,118.94	19,793,051.92	269,423,170.86
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-240,000,000.00	-	-240,000,000.00
本期末	7,805,115.54	42,121,198.20	49,926,313.74

#### 7.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月 18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12 月31日
活期存款利息收入	376,262.74	465,895.20
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	13,293.47	56,921.82
其他	1,433.40	2,316.86
合计	390,989.61	525,133.88

#### 7.1.4.7.12 股票投资收益

##### 7.1.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10 月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日
卖出股票成交总额	920,003,429.09	2,453,715,985.91
减：卖出股票成本总额	666,377,540.55	2,813,242,609.74
买卖股票差价收入	253,625,888.54	-359,526,623.83

#### 7.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10 月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	801,852,572.00	667,849,792.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	779,467,317.19	654,726,824.74
减：应收利息总额	25,358,439.61	11,837,535.53
债券投资收益	-2,973,184.80	1,285,432.21

#### 7.1.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.1.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出权证成交金额	-	19,917,590.72
减：卖出权证成本总额	-	19,874,457.18
买卖权证差价收入	-	43,133.54

7.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,978,502.01	3,693,169.43
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,978,502.01	3,693,169.43

7.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
1. 交易性金融资产	19,793,051.92	-160,522,030.03
——股票投资	20,622,911.28	-157,507,963.25
——债券投资	-829,859.36	-3,014,066.78
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-2,466,184.64
——权证投资	-	-2,466,184.64
3. 其他	-	-
合计	19,793,051.92	-162,988,214.67

7.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	-	-
印花税手续费返还	-	21,987.58
合计	-	21,987.58

7.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	2,344,147.39	13,663,631.87
银行间市场交易费用	8,532.50	1,150.00
合计	2,352,679.89	13,664,781.87

7.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日-2009年10月18日	2008年1月1日至2008年12月31日
审计费用	47,834.58	60,000.00
信息披露费	255,122.61	360,000.00
红利手续费	716,400.00	1,234,297.49
上市年费	47,834.58	60,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	7,589.81	11,675.91
合计	1,092,781.58	1,743,973.40

**7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.1.4.8.1 或有事项**

无。

**7.1.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.1.4.9 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(“国泰基金”)	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金发起人
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东

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。

**7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.1.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2009年1月1日-2009年10月18日		2008年1月1日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	85,953,033.33	6.21%	1,544,781,822.63	33.06%

**7.1.4.10.1.2 权证交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日-2009年10月18日	2008年1月1日至2008年12月31日

	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	18,534,941.01	93.06%

#### 7.1.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年10月18日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	69,837.42	6.02%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	1,281,980.40	32.71%	245,958.59	31.02%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.1.4.10.2 关联方报酬

##### 7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	5,433,485.05
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的20%，超过部分不计提管理人报酬。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

##### 7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	908,999.97

注：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0.25%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 0.25% / 当年天数。

鉴于对2008年4月28日基金收益分配实施中有关公允价值变动问题存在不同理解，本基金管理人和托管人决定自2008年4月28日起至下一次收益分配权益登记日(2009年9月23日)止对基金资产净值中包含的存在不同理解的公允价值变动金额暂停计提基金管理费和基金托管费。



7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009年1月1日-2009年10月18日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	9,984,373.42	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-

7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	2009年1月1日-2009年10月18日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
基金合同生效日(2000年4月26日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	22,267,084.00	22,267,084.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	22,267,084.00	22,267,084.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.45%	4.45%

7.1.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	2009年10月18日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国泰君安	2,692,308.00	0.54%	2,692,308.00	0.54%

7.1.4.10.5 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	2009年1月1日-2009年10月18日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	55,757,621.85	376,262.74	20,557,565.52	465,895.20

注：本基金的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。

#### 7.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.1.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	09/09/22	09/09/23	4.800	240,000,000.00	-	240,000,000.00	
合计			4.800	240,000,000.00	-	240,000,000.00	

#### 7.1.4.12 期末（2009年10月18日）本基金持有的流通受限证券

无。

#### 7.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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，使本基金在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资本增值和投资收益的最大化。

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自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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.1.4.13.2 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建设银行,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。于2009年10月18日(基金合同失效前日),本基金未持有信用类债券(2008年12月31日:持有的信用类债券占基金资产净值的比例为0.01%)。

#### 7.1.4.13.3 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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注7.1.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.1.4.13.4 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。

##### 7.1.4.13.4.1 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。

#### 7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2009年10月18日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	55,757,621.85	-	-	-	55,757,621.85
结算备付金	445,502.94	-	-	-	445,502.94
存出保证金	140,741.00	-	-	281,563.52	422,304.52
交易性金融资产	268,680,000.00	21,300,300.00	20,218,000.00	176,644,487.58	486,842,787.58
应收证券清算款	-	-	-	4,021,077.22	4,021,077.22
应收利息	-	-	-	4,544,830.37	4,544,830.37
资产总计	325,023,865.79	21,300,300.00	20,218,000.00	185,491,958.69	552,034,124.48
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	401,997.49	401,997.49
应付托管费	-	-	-	66,999.59	66,999.59
应付交易费用	-	-	-	455,716.23	455,716.23
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利润	-	-	-	283,104.68	283,104.68
其他负债	-	-	-	612,962.27	612,962.27
负债总计	-	-	-	2,107,810.74	2,107,810.74
利率敏感度缺口	325,023,865.79	21,300,300.00	20,218,000.00	183,384,147.95	549,926,313.74
上年度末 2008年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	20,557,565.52	-	-	-	20,557,565.52
结算备付金	2,901,421.88	-	-	-	2,901,421.88
存出保证金	140,741.00	-	-	250,634.85	391,375.85
交易性金融资产	135,327,000.00	-	20,460,562.76	356,945,529.50	512,733,092.26
应收利息	-	-	-	4,548,563.71	4,548,563.71
资产总计	158,926,728.40	-	20,460,562.76	361,744,728.06	541,132,019.22
负债					
卖出回购金融资产款	9,000,000.00	-	-	-	9,000,000.00

应付证券清算款	-	-	-	9,519,707.36	9,519,707.36
应付管理人报酬	-	-	-	362,523.84	362,523.84
应付托管费	-	-	-	60,420.67	60,420.67
应付交易费用	-	-	-	793,882.81	793,882.81
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利息	-	-	-	36.00	36.00
应付利润	-	-	-	283,104.68	283,104.68
其他负债	-	-	-	322,170.50	322,170.50
负债总计	9,000,000.00	-	-	11,628,876.34	20,628,876.34
利率敏感度缺口	149,926,728.40	-	20,460,562.76	350,115,851.72	520,503,142.88

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币 万元）	
		本期末 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约22	增加约22
	市场利率上升25个基点	减少约22	减少约22

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.1.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。

此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2009年10月18日		上年度末 2008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	176,644,487.58	32.12	356,945,529.50	68.58
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	176,644,487.58	32.12	356,945,529.50	68.58

#### 7.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2009年10月18日	上年度末 2008年12月31日
	沪深300指数上升5%	增加约1,320	增加约1,562
	沪深300指数下降5%	减少约1,320	减少约1,562

7.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
无。

## 7.2 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

### 7.2.1 资产负债表

会计主体:国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2009年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年12月31日
<b>资产:</b>		
银行存款	7.2.4.7.1	2,021,471,976.97
结算备付金		12,049,770.84
存出保证金		422,304.52

## 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)(原金盛证券投资基金转型)2009年年度报告

交易性金融资产	7.2.4.7.2	2,326,540,730.30
其中：股票投资		2,235,271,730.30
基金投资		-
债券投资		91,269,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	2,405,800,000.00
应收证券清算款		134,275.35
应收利息	7.2.4.7.5	1,237,725.56
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.2.4.7.6	8,183.80
资产总计		6,767,664,967.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,584,740,044.71
应付赎回款		-
应付管理人报酬		6,506,160.58
应付托管费		1,084,360.11
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.2.4.7.7	1,671,617.74
应交税费		287,030.48
应付利息		-
应付利润		283,104.68
递延所得税负债		-
其他负债	7.2.4.7.8	402,170.50
负债合计		1,594,974,488.80
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.2.4.7.9	4,281,385,316.74
未分配利润	7.2.4.7.10	891,305,161.80
所有者权益合计		5,172,690,478.54
负债和所有者权益总计		6,767,664,967.34

注：(1)报告截止日2009年12月31日，基金份额净值1.012元，基金份额总额5,111,289,319.09份。

(2)本财务报表的实际编制期间为2009年10月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日。

### 7.2.2 利润表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2009年10月19日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	2009年10月19日-2009年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>120,674,425.48</b>
1. 利息收入		3,544,046.03
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	2,143,714.91
债券利息收入		667,341.08
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		732,990.04
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,038,108.01
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	12,365,074.01
基金投资收益		-
债券投资收益	7.2.4.7.13	-353,750.00
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.2.4.7.14	-
股利收益	7.2.4.7.15	26,784.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	105,081,466.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	10,805.31
<b>减：二、费用</b>		<b>12,279,548.77</b>
1. 管理人报酬		8,629,071.90
2. 托管费		1,438,178.68
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.2.4.7.18	2,042,633.19
5. 利息支出		1,552.88
其中：卖出回购金融资产支出		1,552.88
6. 其他费用	7.2.4.7.19	168,112.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>108,394,876.71</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>108,394,876.71</b>

### 7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2009年10月19日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	2009年10月19日-2009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）	500,000,000.00	49,926,313.74	549,926,313.74



二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	108,394,876.71	108,394,876.71
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)	3,781,385,316.74	732,983,971.35	4,514,369,288.09
其中:1.基金申购款	3,781,385,316.74	732,983,971.35	4,514,369,288.09
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-	-
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)	4,281,385,316.74	891,305,161.80	5,172,690,478.54

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.2.1至7.2.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:金旭,主管会计工作负责人:巴立康,会计机构负责人:王骏

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 基金基本情况

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)是根据原金盛证券投资基金(以下简称“基金金盛”)基金份额持有人大会2009年8月20日决议通过的《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》,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[2009]925号《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》,由原金盛证券投资基金转型而来。原基金金盛为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至2009年11月30日止。根据深交所深证复[2009]35号《关于同意金盛证券投资基金终止上市的批复》,原基金金盛于2009年10月16日进行终止上市权利登记。自2009年10月19日起,原基金金盛终止上市,原基金金盛更名为国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”),《金盛证券投资基金基金合同》失效的同时《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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。

原基金金盛于基金合同失效前经审计的基金资产净值为549,926,313.74元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《关于原金盛证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金于2009年11月23日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:1.193840063,并于2009年11月24日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自2009年10月22日至2009年11月18日期间内开放集中申购,共募集4,514,369,288.09元,其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息1,379,695.40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(2009)第252号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2009年11月24日基金份额折算后的基金份额净值1.000元折合为4,514,369,288.09份基金份额,其中包括集中申购资金利息折合的1,379,695.40份基金份额,并于2009年11月24日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)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,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。其中,股票资产投资比例占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券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占基金资产的5%-40%,其中,权证投资比例占基金资产净值的0-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有高成长性和良好基本面的中小盘成长股票。本基金的业绩比较基准为:天相中盘成长指数 X 35%+天相小盘成长指数 X 45%+中证全债指数 X 20%。

根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立6个月内达到基金合同规定的比例限制。截至2009年12月31日止,本基金尚处于建仓期。

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2010年3月24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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.2.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 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2009年10月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间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2009年12月31日的财务状况以及2009年10月19日(基金合同生效日)至2009年12月31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 重要会计政策和会计估计

##### 7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2009年10月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日。

##### 7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金

对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自

愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份

额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外,一般采用历史成本计量。

##### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

无。

#### 7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (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派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (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。

#### 7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
活期存款	2,021,471,976.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	2,021,471,976.97

##### 7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,087,964,863.17	2,235,271,730.30	147,306,867.13	
债券	交易所市场	41,536,252.80	41,434,000.00	-102,252.80
	银行间市场	49,836,950.00	49,835,000.00	-1,950.00
	合计	91,373,202.80	91,269,000.00	-104,202.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	2,179,338,065.97	2,326,540,730.30	147,202,664.33
----	------------------	------------------	----------------

注：债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本会计期间利润表中确认的公允价值变动收益为 263,800 元。

#### 7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	2,405,800,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	2,405,800,000.00	-

##### 7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
应收活期存款利息	349,639.29
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	4,639.25
应收债券利息	866,919.76
应收买入返售证券利息	16,473.14
应收申购款利息	-
其他	54.12
合计	1,237,725.56

#### 7.2.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
其他应收款	8,183.80
待摊费用	-
合计	8,183.80

#### 7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,671,342.74
银行间市场应付交易费用	275.00
合计	1,671,617.74

#### 7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	-
预提费用	140,000.00
其他应付款	12,170.50
合计	402,170.50

#### 7.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年10月19日(基金合同生效日) 至2009年12月31日止期间	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	500,000,000.00	500,000,000.00
2009年11月24日基金份额折算调整	96,920,031.00	-
2009年11月24日集中申购募集资金本金及利息	4,514,369,288.09	3,781,385,316.74
2009年11月24日基金拆分和集中申购完成后	5,111,289,319.09	4,281,385,316.74
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,111,289,319.09	4,281,385,316.74

注：(1)根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《关于原金盛证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司确定2009年11月23日为本基金的基金份额折算基准日。当日基金资产净值为596,920,031.94元，折算前基金份额总额为500,000,000.00份，折算前基金份额净值为1.194元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为1:1.193840063，折算后基金份额总额为596,920,031.00份，折算后基金份额净值为1.000元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于2009年11月24日进行了变更登记。

(2)本基金自2009年10月22日至2009年11月18日止期间进行集中申购，共募集有效净集中申购资金4,512,989,592.69元。根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的规定，本基金集中申购期内集中申购资金产生的利息收入1,379,695.40元在本基金成立后，折算为1,379,695.40份基金份额，划入基金份额持有人账户。



(3)于2009年12月31日,本基金尚未开放日常申购和赎回业务。

#### 7.2.4.7.10 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
基金合同生效日	7,805,115.54	42,121,198.20	49,926,313.74
本期利润	3,313,410.58	105,081,466.13	108,394,876.71
本期基金份额交易产生的变动数	61,562,687.40	671,421,283.95	732,983,971.35
其中:基金申购款	61,562,687.40	671,421,283.95	732,983,971.35
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,681,213.52	818,623,948.28	891,305,161.80

#### 7.2.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
活期存款利息收入	2,130,345.81
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	13,004.47
其他	364.63
合计	2,143,714.91

#### 7.2.4.7.12 股票投资收益

##### 7.2.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
卖出股票成交总额	50,192,127.94
减:卖出股票成本总额	37,827,053.93
买卖股票差价收入	12,365,074.01

#### 7.2.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
----	-------------------------------

卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交金额	273,010,000.00
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	268,945,750.00
减:应收利息总额	4,418,000.00
债券投资收益	-353,750.00

#### 7.2.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.2.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	26,784.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	26,784.00

#### 7.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
1. 交易性金融资产	105,081,466.13
——股票投资	104,901,966.13
——债券投资	179,500.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	105,081,466.13

#### 7.2.4.7.17 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
基金赎回费收入	-
印花税手续费返还	9,277.52
其他收入	1,527.79
合计	10,805.31

#### 7.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
交易所市场交易费用	2,042,358.19
银行间市场交易费用	275.00
合计	2,042,633.19

#### 7.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
审计费用	92,165.42
信息披露费	64,877.39
银行费用	8,803.89
开户费	100.00
上市年费	2,165.42
合计	168,112.12

#### 7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.2.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

(1) 经深交所深证上字[2009]第204号文审核同意，本基金825,721,408.00份基金份额于2010年1月7日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

(2) 根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的相关规定，本基金于2009年10月19日(基金合同生效日)至2010年1月6日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2010年1月7日起开始办理。

#### 7.2.4.9 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(“国泰基金”)	基金管理人、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、基金代销机构
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
中国电力财务有限公司(“中电财务”)	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金代销机构、基金管理人的股东

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。

#### 7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 7.2.4.10.2 关联方报酬

##### 7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,629,071.90
其中：支付销售机构的客户维护费	1,349,236.70

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 1.5%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 1.5% / 当年天数。

##### 7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,438,178.68

注：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 0.25%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 0.25% / 当年天数。

#### 7.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期 2009年10月19日-2009年12月31日
基金合同生效日(2009年10月19日)持有的基金份额	22,267,084.00
期初持有的基金份额	-
期间认购总份额	-
期间申购/买入总份额	30,028,400.00
期间因拆分增加的份额	4,316,253.00
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	56,611,737.00

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.11%
-----------------------	-------

注：基金管理人国泰基金在本会计期间申购本基金的交易委托中国建设银行办理，适用费率为1,000元。

#### 7.2.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总 份额的比例
中电财务	10,000,400.00	0.20%

#### 7.2.4.10.5 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 2009年10月19日-2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,021,471,976.97	2,130,345.81

注：本基金的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。

#### 7.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.2.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.2.4.12 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.2.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
600060	海信电器	2009-12-25	2010-12-24	非公 开发 行	18.38	18.56	3,000,000	55,140,000.00	55,680,000.00	-
600875	东方电气	2009-12-03	2010-12-01	非公 开发 行	42.07	42.36	250,000	10,517,500.00	10,590,000.00	-
300039	上海凯宝	2009-12-28	2009-04-08	网下	38.00	38.00	111,457	4,235,366.00	4,235,366.00	-

				申购						
002320	海峡股份	2009-12-09	2009-03-16	网下 申购	33.60	51.18	52,529	1,764,974.40	2,688,434.22	-
300038	梅泰诺	2009-12-28	2010-04-08	网下 申购	26.00	26.00	93,752	2,437,552.00	2,437,552.00	-
601139	深圳燃气	2009-12-15	2010-03-25	网下 申购	6.95	16.78	113,609	789,582.55	1,906,359.02	-
300035	中科电气	2009-12-18	2009-03-25	网下 申购	36.00	48.42	35,685	1,284,660.00	1,727,867.70	-
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-04-06	网下 申购	20.10	20.10	51,032	1,025,743.20	1,025,743.20	-
002331	皖通科技	2009-12-25	2010-04-06	网下 申购	27.00	27.00	26,748	722,196.00	722,196.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.2.4.12.2 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（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600739	辽宁成大	2009-12-25	公告 重大 事项	38.09	2010-1-11	41.90	179,901	6,569,368.61	6,852,429.09	

注：本基金截至 2009 年 12 月 31 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。

#### 7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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“长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金”的风险收益目标。

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自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。

#### 7.2.4.13.2 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建设银行，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。于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

#### 7.2.4.13.3 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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注7.2.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。截至2009年12月31日止,本基金尚处于建仓期,亦未开放日常申购及赎回,面临的流动性风险非重大。

本基金所持有的全部金融负债的合同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。

#### 7.2.4.13.4 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。

##### 7.2.4.13.4.1 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、债券投资等。

##### 7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2009年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	2,021,471,976.97	-	-	-	2,021,471,976.97
结算备付金	12,049,770.84	-	-	-	12,049,770.84
存出保证金	140,741.00	-	-	281,563.52	422,304.52
交易性金融资产	71,003,000.00	-	20,266,000.00	2,235,271,730.30	2,326,540,730.30
买入返售金融资	2,405,800,000.00	-	-	-	2,405,800,000.00



产					
应收证券清算款	-	-	-	134,275.35	134,275.35
应收利息	-	-	-	1,237,725.56	1,237,725.56
其他资产	-	-	-	8,183.80	8,183.80
资产总计	4,510,465,488.81	-	20,266,000.00	2,236,933,478.53	6,767,664,967.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,584,740,044.71	1,584,740,044.71
应付管理人报酬	-	-	-	6,506,160.58	6,506,160.58
应付托管费	-	-	-	1,084,360.11	1,084,360.11
应付交易费用	-	-	-	1,671,617.74	1,671,617.74
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利润	-	-	-	283,104.68	283,104.68
其他负债	-	-	-	402,170.50	402,170.50
负债总计	-	-	-	1,594,974,488.80	1,594,974,488.80
利率敏感度缺口	4,510,465,488.81	-	20,266,000.00	641,958,989.73	5,172,690,478.54

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2009年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.76%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.2.4.13.4.2 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。

#### 7.2.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例占基

金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券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占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	2,235,271,730.30	43.21
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,235,271,730.30	43.21

#### 7.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金转型后未满足 3 个月，尚处在建仓期，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。

**7.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**  
无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 金盛证券投资基金

#### 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	176,644,487.58	32.00
2	其中：股票	176,644,487.58	32.00
3	固定收益投资	310,198,300.00	56.19
4	其中：债券	310,198,300.00	56.19
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	56,203,124.79	10.18
10	其他各项资产	8,988,212.11	1.63
11	合计	552,034,124.48	100.00

### 8.1.2 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(%)
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	5,338,124.76	0.97
3	制造业	88,555,663.42	16.10
4	食品、饮料	13,988,400.00	2.54
5	纺织、服装、皮毛	-	-
6	木材、家具	-	-
7	造纸、印刷	-	-
8	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
9	电子	-	-
10	金属、非金属	31,580,251.56	5.74
11	机械、设备、仪表	38,069,414.02	6.92
12	医药、生物制品	4,917,597.84	0.89
13	其他制造业	-	-
14	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
15	建筑业	11,007,872.00	2.00
16	交通运输、仓储业	-	-
17	信息技术业	6,849,848.50	1.25
18	批发和零售贸易	13,580,593.32	2.47
19	金融、保险业	13,621,160.00	2.48
20	房地产业	19,135,570.80	3.48
21	社会服务业	18,555,654.78	3.37
22	传播与文化产业	-	-
23	综合类	-	-
24	合计	176,644,487.58	32.12

### 8.1.3 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

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	600660	福耀玻璃	1,732,602	19,145,252.10	3.48
2	002140	东华科技	622,882	18,555,654.78	3.37
3	002073	青岛软控	900,000	14,778,000.00	2.69
4	000338	潍柴动力	256,360	14,433,068.00	2.62
5	600704	中大股份	700,000	10,955,000.00	1.99

6	000656	ST 东源	669,002	9,854,399.46	1.79
7	600887	*ST 伊利	450,000	9,189,000.00	1.67
8	000024	招商地产	300,000	8,142,000.00	1.48
9	601318	中国平安	129,000	7,229,160.00	1.31
10	600325	华发股份	378,681	7,081,334.70	1.29
11	600406	国电南瑞	179,975	6,849,848.50	1.25
12	600036	招商银行	400,000	6,392,000.00	1.16
13	600970	中材国际	160,000	5,888,000.00	1.07
14	600028	中国石化	451,618	5,338,124.76	0.97
15	000541	佛山照明	602,600	5,296,854.00	0.96
16	600284	浦东建设	399,990	5,119,872.00	0.93
17	600519	贵州茅台	30,000	4,799,400.00	0.87
18	002294	信立泰	53,000	4,452,000.00	0.81
19	600048	保利地产	121,119	3,233,877.30	0.59
20	002028	思源电气	135,329	3,163,992.02	0.58
21	600153	建发股份	216,812	2,625,593.32	0.48
22	000825	太钢不锈	330,000	2,580,600.00	0.47
23	000506	ST 中润	83,748	678,358.80	0.12
24	002275	桂林三金	17,583	465,597.84	0.08
25	002085	万丰奥威	50,000	397,500.00	0.07

#### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.1.4.1 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	002073	青岛软控	21,063,251.18	4.05
2	000063	中兴通讯	14,261,161.71	2.74
3	000338	潍柴动力	12,783,535.18	2.46
4	002140	东华科技	12,618,863.88	2.42
5	600660	福耀玻璃	12,125,100.43	2.33
6	600028	中国石化	12,119,775.00	2.33
7	600036	招商银行	11,998,397.84	2.31
8	600704	中大股份	11,872,644.30	2.28
9	601318	中国平安	11,543,108.80	2.22
10	600519	贵州茅台	11,160,548.25	2.14
11	600325	华发股份	11,109,343.52	2.13
12	601857	中国石油	10,392,427.00	2.00
13	600009	上海机场	10,267,708.42	1.97

14	600050	中国联通	10,144,513.00	1.95
15	601628	中国人寿	10,035,370.28	1.93
16	000656	ST 东源	9,855,413.53	1.89
17	600970	中材国际	9,654,960.36	1.85
18	601006	大秦铁路	9,164,677.22	1.76
19	600837	海通证券	9,105,824.50	1.75
20	600535	天士力	9,063,369.55	1.74

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。

#### 8.1.4.2 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	600804	鹏博士	55,373,313.30	10.64
2	600000	浦发银行	46,743,399.00	8.98
3	600100	同方股份	45,028,199.61	8.65
4	600036	招商银行	24,749,207.37	4.75
5	600436	片仔癀	20,587,803.73	3.96
6	000623	吉林敖东	20,476,606.52	3.93
7	600138	中青旅	19,331,752.23	3.71
8	600256	广汇股份	18,518,828.90	3.56
9	000063	中兴通讯	17,775,344.70	3.42
10	601628	中国人寿	17,756,231.93	3.41
11	000983	西山煤电	15,872,651.26	3.05
12	002022	科华生物	15,326,892.27	2.94
13	000001	深发展A	15,310,873.64	2.94
14	600104	上海汽车	15,265,846.33	2.93
15	002140	东华科技	14,506,786.14	2.79
16	600519	贵州茅台	14,254,619.59	2.74
17	600050	中国联通	13,597,224.20	2.61
18	601169	北京银行	12,717,051.86	2.44
19	000024	招商地产	12,517,566.22	2.40
20	002073	青岛软控	12,194,637.37	2.34
21	002084	海鸥卫浴	12,070,710.19	2.32
22	600739	辽宁成大	11,934,530.52	2.29
23	600527	江南高纤	11,774,956.56	2.26
24	002063	远光软件	11,689,993.66	2.25
25	600009	上海机场	11,675,880.58	2.24
26	601186	中国铁建	11,640,519.39	2.24
27	600837	海通证券	11,582,553.58	2.23
28	601857	中国石油	11,232,975.23	2.16

29	600535	天士力	11,105,515.43	2.13
30	601318	中国平安	10,889,021.66	2.09
31	600028	中国石化	10,748,234.93	2.06
32	600231	凌钢股份	10,671,481.21	2.05
33	600717	天津港	10,496,534.89	2.02

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。

### 8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	465,453,587.35
卖出股票的收入（成交）总额	920,003,429.09

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。

### 8.1.5 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	41,518,300.00	7.55
2	央行票据	198,624,000.00	36.12
3	金融债券	70,056,000.00	12.74
	其中：政策性金融债	70,056,000.00	12.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	310,198,300.00	56.41

### 8.1.6 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	040216	04国开16	700,000	70,056,000.00	12.74
2	0901043	09央行票据43	500,000	49,835,000.00	9.06
3	0901047	09央行票据47	500,000	49,835,000.00	9.06
4	0901035	09央行票据35	400,000	39,868,000.00	7.25
5	0801119	08央票119	400,000	39,152,000.00	7.12

### 8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.1.8 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。

### 8.1.9 投资组合报告附注

8.1.9.1 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。

8.1.9.2 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。

#### 8.1.9.3 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	422,304.52
2	应收证券清算款	4,021,077.22
3	应收股利	-
4	应收利息	4,544,830.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,988,212.11

#### 8.1.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

#### 8.1.9.5 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。

## 8.2 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

### 8.2.1 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	2,235,271,730.30	33.03
	其中:股票	2,235,271,730.30	33.03
2	固定收益投资	91,269,000.00	1.35
	其中:债券	91,269,000.00	1.35
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,405,800,000.00	35.55
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,033,521,747.81	30.05
6	其他各项资产	1,802,489.23	0.03

7	合计	6,767,664,967.34	100.00
---	----	------------------	--------

### 8.2.2 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	20,762,344.24	0.40
B	采掘业	46,340,284.56	0.90
C	制造业	1,158,094,558.12	22.39
C0	食品、饮料	106,222,468.48	2.05
C1	纺织、服装、皮毛	6,157,521.84	0.12
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,294,498.73	1.17
C5	电子	140,343,362.72	2.71
C6	金属、非金属	310,289,228.76	6.00
C7	机械、设备、仪表	371,690,419.44	7.19
C8	医药、生物制品	163,097,058.15	3.15
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,906,359.02	0.04
E	建筑业	72,162,180.84	1.40
F	交通运输、仓储业	2,688,434.22	0.05
G	信息技术业	127,702,360.44	2.47
H	批发和零售贸易	212,635,846.34	4.11
I	金融、保险业	389,386,395.63	7.53
J	房地产业	169,990,406.69	3.29
K	社会服务业	33,602,560.20	0.65
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,235,271,730.30	43.21

### 8.2.3 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

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	600660	福耀玻璃	15,561,704	232,491,857.76	4.49
2	600036	招商银行	9,869,832	178,150,467.60	3.44
3	601318	中国平安	3,108,895	171,269,025.55	3.31
4	600704	中大股份	6,391,696	169,763,445.76	3.28
5	000527	美的电器	5,871,561	136,220,215.20	2.63
6	600060	海信电器	5,492,657	119,965,624.03	2.32



## 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)(原金盛证券投资基金转型)2009年年度报告

7	600887	*ST 伊利	3,972,686	105,196,725.28	2.03
8	600970	中材国际	1,810,622	67,300,819.74	1.30
9	600406	国电南瑞	1,368,563	67,004,844.48	1.30
10	600325	华发股份	3,573,363	66,964,822.62	1.29
11	000422	湖北宜化	2,466,300	52,655,505.00	1.02
12	000918	嘉凯城	3,230,692	51,852,606.60	1.00
13	002249	大洋电机	1,423,356	49,603,956.60	0.96
14	000338	潍柴动力	758,123	48,883,771.04	0.95
15	000028	一致药业	1,729,856	47,882,414.08	0.93
16	601808	中海油服	2,849,956	46,340,284.56	0.90
17	600535	天士力	1,938,977	43,433,084.80	0.84
18	002294	信立泰	474,627	42,113,653.71	0.81
19	000612	焦作万方	1,499,920	41,997,760.00	0.81
20	600570	恒生电子	1,922,156	40,384,497.56	0.78
21	600875	东方电气	889,514	39,425,686.26	0.76
22	002140	东华科技	803,889	33,602,560.20	0.65
23	000506	ST 中润	4,030,032	33,086,562.72	0.64
24	000157	中联重科	1,269,218	33,012,360.18	0.64
25	000656	ST 东源	2,066,545	32,651,411.00	0.63
26	600280	南京中商	1,054,307	24,955,446.69	0.48
27	600557	康缘药业	1,190,405	24,938,984.75	0.48
28	002050	三花股份	1,017,506	22,883,709.94	0.44
29	601009	南京银行	1,076,360	20,827,566.00	0.40
30	600251	冠农股份	816,772	20,762,344.24	0.40
31	000016	深康佳A	2,649,901	20,377,738.69	0.39
32	002073	青岛软控	900,000	20,205,000.00	0.39
33	601788	光大证券	749,974	19,139,336.48	0.37
34	002244	滨江集团	1,249,925	18,086,414.75	0.35
35	600446	金证股份	1,140,510	17,153,270.40	0.33
36	600511	国药股份	432,208	11,064,524.80	0.21
37	000893	东凌粮油	340,700	9,829,195.00	0.19
38	002092	中泰化学	349,931	7,638,993.73	0.15
39	600739	辽宁成大	179,901	6,852,429.09	0.13
40	000541	佛山照明	602,600	6,261,014.00	0.12
41	002293	罗莱家纺	149,964	6,157,521.84	0.12
42	600284	浦东建设	349,990	4,861,361.10	0.09
43	300039	上海凯宝	111,457	4,235,366.00	0.08
44	002028	思源电气	135,329	3,637,643.52	0.07
45	000825	太钢不锈	330,000	3,148,200.00	0.06
46	002320	海峡股份	52,529	2,688,434.22	0.05
47	300038	梅泰诺	93,752	2,437,552.00	0.05

48	601139	深圳燃气	113,609	1,906,359.02	0.04
49	300035	中科电气	35,685	1,727,867.70	0.03
50	002329	皇氏乳业	51,032	1,025,743.20	0.02
51	002331	皖通科技	26,748	722,196.00	0.01
52	002275	桂林三金	17,583	493,554.81	0.01

## 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600660	福耀玻璃	189,652,182.87	3.67
2	601318	中国平安	170,653,167.54	3.30
3	600036	招商银行	164,174,688.55	3.17
4	000527	美的电器	124,746,531.75	2.41
5	600704	中大股份	123,300,193.08	2.38
6	600060	海信电器	113,668,433.35	2.20
7	600887	*ST 伊利	94,594,306.91	1.83
8	600325	华发股份	74,617,162.72	1.44
9	000918	嘉凯城	62,783,082.63	1.21
10	600970	中材国际	60,803,635.14	1.18
11	600406	国电南瑞	55,884,599.57	1.08
12	000422	湖北宣化	49,999,860.19	0.97
13	002249	大洋电机	47,948,346.24	0.93
14	600535	天士力	45,368,484.67	0.88
15	601808	中海油服	45,154,573.93	0.87
16	000028	一致药业	44,251,548.80	0.86
17	600875	东方电气	38,888,942.03	0.75
18	002294	信立泰	37,512,121.20	0.73
19	000506	ST 中润	36,230,823.13	0.70
20	600570	恒生电子	35,342,673.63	0.68

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。

### 8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601601	中国太保	12,446,582.00	0.24
2	000024	招商地产	8,067,127.00	0.16
3	600060	海信电器	7,148,069.27	0.14
4	600028	中国石化	6,360,878.52	0.12
5	600519	贵州茅台	5,086,048.37	0.10

6	600153	建发股份	2,819,550.45	0.05
7	600048	保利地产	2,712,644.05	0.05
8	600173	卧龙地产	2,607,002.41	0.05
9	600325	华发股份	1,665,597.70	0.03
10	600284	浦东建设	688,000.00	0.01
11	002085	万丰奥威	456,193.17	0.01
12	000918	嘉凯城	134,435.00	0.00

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。

### 8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	1,991,552,330.52
卖出股票的收入(成交)总额	50,192,127.94

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。

### 8.2.5 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	41,434,000.00	0.80
2	央行票据	49,835,000.00	0.96
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	91,269,000.00	1.76

### 8.2.6 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	0901049	09 央行票据 49	500,000	49,835,000.00	0.96
2	010004	20 国债(4)	210,000	21,168,000.00	0.41
3	010203	02 国债(3)	200,000	20,266,000.00	0.39

### 8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.2.8 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。

### 8.2.9 投资组合报告附注

8.2.9.1 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。

8.2.9.2 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。

#### 8.2.9.3 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	422,304.52
2	应收证券清算款	134,275.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,237,725.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	8,183.80
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,802,489.23

#### 8.2.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

#### 8.2.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600060	海信电器	55,680,000.00	1.08	定向增发

## § 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

#### 9.1.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

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
57,199	89,359.77	1,129,471,041.96	22.10%	3,981,818,277.13	77.90%

### 9.1.2 金盛证券投资基金

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
9,581	52,186.62	396,516,182.00	79.30%	103,483,818.00	20.70%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

#### 9.2.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国寿投资控股有限公司	51,703,085.00	6.26%
2	中国人寿财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	51,432,202.00	6.23%
3	中国人寿保险股份有限公司	47,708,690.00	5.78%
4	中国人寿保险(集团)公司	47,356,394.00	5.74%
5	信诚人寿保险有限公司—分红一个 险分红	39,068,103.00	4.73%
6	阳光财产保险股份有限公司—自有 资金	29,785,452.00	3.61%
7	国泰基金管理有限公司	25,210,421.00	3.05%
8	阳光财产保险股份有限公司—投资 型保险产品	22,167,333.00	2.68%
9	阳光人寿保险股份有限公司—分红 保险产品	21,925,558.00	2.66%
10	上海城投资产经营有限公司	20,001,000.00	2.42%

注：上述份额均为场内份额，持有人均为场内持有人。

#### 9.2.2 金盛证券投资基金

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	49,799,686.00	9.96%
2	国寿投资控股有限公司	43,308,217.00	8.66%
3	中国人寿财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	43,081,317.00	8.62%
4	中国人寿保险(集团)公司	39,667,285.00	7.93%
5	信诚人寿保险有限公司—分红一个 险分红	32,724,738.00	6.54%
6	阳光财产保险股份有限公司—自有 资金	24,949,282.00	4.99%
7	国泰基金管理有限公司	22,267,084.00	4.45%

8	阳光财产保险股份有限公司—投资型保险产品	18,568,093.00	3.71%
9	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	18,365,574.00	3.67%
10	宝钢集团有限公司	13,976,700.00	2.80%

以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的基金持有人名册编制。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

#### 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

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	5,360,060.87	0.1%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日(2009年10月19日)基金份额总额	500,000,000.00
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	4,514,369,288.09
基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额	96,920,031.00
本报告期期末基金份额总额	5,111,289,319.09

注：截止本报告期末，本基金尚处于封闭期。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

国泰金盛封闭基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议投票表决时间自权益登记日次日即2009年7月21日0时起，至2009年8月20日17:00止。本次基金份额持有人大会（以下简称“本次大会”）审议了《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》，由参加大会的基金份额持有人以通讯方式对本次大会议案进行投票表决。在国泰金盛封闭的基金托管人中国建设银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人授权的两名监督员对本次大会表决进行了计票，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。

截至2009年8月20日17:00，参加本次大会投票表决的国泰金盛封闭基金份额

持有人所持份额共计 375,436,904 份,占权益登记日国泰金盛封闭总份额 5 亿份的 75.09%,达到法定开会条件,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《金盛证券投资基金基金合同》(原《珠江证券投资基金基金合同》)的有关规定。

表决结果为:375,399,704 份基金份额同意,25,200 份基金份额反对,12,000 份基金份额弃权。同意本次大会议案的基金份额占参加本次大会的持有人所持基金份额总数的 99.99%,达到参加本次大会的基金份额持有人所持基金份额总数的三分之二以上,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《金盛证券投资基金基金合同》(原《珠江证券投资基金基金合同》)的有关规定,《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》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:

1、2009 年 1 月 17 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关于聘任副总经理的公告》,经本基金管理人第四届董事会第九次会议审议通过,同意聘任初伟斌先生担任公司副总经理。初伟斌先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准(证监许可[2008]1481 号文)。

2、2009 年 7 月 16 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关于变更公司督察长的公告》,经本基金管理人第四届董事会第十五次会议审议通过,同意丁昌海先生辞去公司督察长职务,聘任李峰女士为公司督察长。李峰女士的督察长任职资格已获中国证监会核准(证监许可[2009]609 号文)。

报告期内,基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

## 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 140,000.00 元,目前的审计机构已提供审计服务的年限为 8 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

#### 11.7.1.1 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	
国泰君安证券股份有限公司	2	188,904,907.84	9.63%	153,485.54	9.31%	-
海通证券股份有限公司	2	573,371,427.61	29.23%	471,107.35	28.58%	-
申银万国证券股份有限公司	1	595,215,136.13	30.34%	510,456.49	30.96%	-
渤海证券股份有限公司	1	604,242,690.61	30.80%	513,605.47	31.15%	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	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。

#### 11.7.1.2 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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	40,100,000.00	0.27%	-	-



申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	14,731,100,000.00	99.73%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.7.2 金盛证券投资基金

#### 11.7.2.1 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	
国泰君安证券股份有限公司	2	85,953,033.33	6.21%	69,837.42	6.02%	-
海通证券股份有限公司	2	683,894,577.79	49.39%	570,590.95	49.15%	-
申银万国证券股份有限公司	1	3,994,730.00	0.29%	3,395.56	0.29%	-
兴业证券股份有限公司	2	61,428,196.10	4.44%	50,029.08	4.31%	-
中国银河证券股份有限公司	1	14,294,970.57	1.03%	12,150.88	1.05%	本年新增
渤海证券股份有限公司	1	535,181,113.35	38.65%	454,908.63	39.19%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，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。

11.7.2.2 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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	56,015,380.09	20.18%	150,000,000.00	14.20%	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	60,000,000.00	5.68%	-	-
中国银河证券股份有限公司	3,018,600.00	1.09%	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	218,513,626.97	78.73%	846,100,000.00	80.12%	-	-

11.8 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	刊登了《国泰基金管理有限公司深圳分公司成立公告》，根据中国证券监督管理委员会《关于核准国泰基金管理公司设立深圳分公司的批复》（证监许可[2009]31号），本基金管理人深圳分公司已在深圳市工商行政管理局办理完成工商注册登记，取得营业执照。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-02-18
2	刊登了《国泰基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》，增聘张玮先生担任国泰金盛封闭的基金经理，与吴战峰先生共同管理国泰金盛封闭。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-04-22

3	<p>刊登了《国泰基金管理有限公司恢复旗下基金持有的长江电力股票市价估值方法的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2009年5月18日起对国泰金盛封闭所持有的长江电力股票恢复按市价估值法进行估值。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-05-19</p>
4	<p>刊登了《国泰基金管理有限公司关于召开金盛证券投资基金基金份额持有人大会(以通讯方式)的公告》，本基金管理人自2009年7月21日0时起,至2009年8月20日17时止以通讯方式召开国泰金盛封闭的基金份额持有人大会,并就相关事宜进行了公告。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-07-13</p>
5	<p>刊登了《国泰基金管理有限公司关于召开金盛证券投资基金基金份额持有人大会(以通讯方式)的第一次提示性公告》，本基金管理人就召开国泰金盛封闭基金份额持有人大会的相关事宜进行了第一次提示。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-07-14</p>
6	<p>刊登了《国泰基金管理有限公司关于召开金盛证券投资基金基金份额持有人大会(以通讯方式)的第二次提示性公告》，本基金管理人就召开国泰金盛封闭基金份额持有人大会的相关事宜进行了第二次提示。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-07-15</p>
7	<p>刊登了《金盛证券投资基金持续停牌提示性公告》，金盛证券投资基金自2009年7月21日开始停牌,直至基金管理人获得中国证监会核准的基金份额持有人</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-07-20</p>

	大会决议公告后，向深圳证券交易所申请复牌。		
8	刊登了《国泰基金管理有限公司关于金盛证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，本基金管理人就国泰金盛封闭的基金份额持有人大会表决结果进行了公告，《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》获得通过。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-08-22
9	刊登了《国泰基金管理有限公司关于基金经理离任的公告》，吴战峰先生因个人原因不再担任国泰金盛封闭的基金经理，国泰金盛封闭由现任基金经理张玮先生管理。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-08-27
10	刊登了《国泰基金管理有限公司关于金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，本基金管理人就国泰金盛封闭基金份额持有人大会决议生效事宜进行了公告，中国证监会于2009年9月15日下发了《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》（证监许可[2009]925号），核准国泰金盛封闭基金份额持有人大会决议生效。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-09-16
11	刊登了《金盛证券投资基金2009年第一次收益分配公告》，本基金管理人以截至2009年9月15日国泰金盛封闭的期末可分配利润为准，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利4.80元。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-09-18

12	<p>刊登了《金盛证券投资基金终止上市公告》，国泰金盛封闭的终止上市日为2009年10月19日，自国泰金盛封闭终止上市之日起，基金名称更改为“国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)”，基金简称为“国泰中小盘成长股票(LOF)”，《金盛证券投资基金基金合同》修订为《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》，原《金盛证券投资基金基金合同》失效，《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日生效。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-10-13</p>
13	<p>刊登了《金盛证券投资基金终止上市的提示性公告》，本基金管理人就国泰金盛封闭终止上市的相关事宜进行了提示。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-10-16</p>
14	<p>刊登了《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)上网发售提示性公告》，本基金管理人就国泰中小盘成长股票(LOF)的上网发售事宜进行了公告。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-10-22</p>
15	<p>刊登了《国泰基金管理有限公司关于运用公司自有资金申购旗下开放式基金的公告》，本基金管理人于集中申购期内通过代销机构申购国泰中小盘成长股票(LOF)3000万元，并按照基金合同及招募说明书的有关规定支付申购费用。</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-11-16</p>
16	<p>刊登了《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)集中申购结果公告》，本基金管理人就国泰中小盘成长股票</p>	<p>《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》</p>	<p>2009-11-25</p>

	(LOF)集中申购结果进行了公告。		
17	刊登了《关于原金盛证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金管理人就国泰金盛封闭的份额折算结果相关事宜进行了公告。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-11-25
18	刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配东方电气(600875)非公开发行A股的公告》，就国泰中小盘股票(LOF)获配东方电气非公开发行A股事宜进行了公告。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-12-08
19	刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配海信电器(600060)非公开发行A股的公告》，就国泰中小盘股票(LOF)获配海信电器非公开发行A股事宜进行了公告。	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2009-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009年1月16日,本托管人公告中国建设银行股份有限公司聘请胡哲一先生担任本行副行长;
- 2、2009年5月14日,美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书;
- 3、2009年5月26日,中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书;
- 4、2009年5月26日,中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书;
- 5、2009年8月2日,本托管人公告,自2009年7月24日起陈佐夫先生就任中国建设银行股份有限公司执行董事。
- 6、2009年9月27日,本托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。
- 7、2009年10月11日,本托管人发布关于控股股东增持中国建设银行股份有限公司股份的公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、关于同意设立金盛证券投资基金的批复
- 2、金盛证券投资基金合同
- 3、金盛证券投资基金托管协议
- 4、金盛证券投资基金半年度报告、年度报告及收益分配报告
- 5、关于同意国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)募集的批复
- 6、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同
- 7、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)托管协议
- 8、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)代销协议
- 9、报告期内披露的各项公告
- 10、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

### 13.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

### 13.3 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)38569000，400-888-8688

客户投诉电话：(021)38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一〇年三月二十九日