



信息披露 Disclosure

B170

2011年3月26日 星期六

国泰区位优势股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月二十六日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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,并对其内容进行审查和核对。 基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月21日复核了本报告中财务资料、净值表现、利润分配方案、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预示其未来表现,投资者有风险,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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 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。

本报告期自2010年1月1日起至2010年12月31日。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	国泰区位优势股票
基金代码	000015
交易代码	000015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年5月27日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,554,242,478.65 万份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金主要投资于具有区位优势且受益于国内经济复苏优势行业和/或政策、特质的上市公司股票,并可在必要时进行权证投资。在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的大类资产配置主要通过资产配置趋势分析模型进行,并中长期一段时期内股票资产向成长和稳健型资产配置,主动调整股票、固定收益和现金资产,其中,股票资产主要以以经济复苏为主线,采取自下而上、自上而下精选个股策略。
业绩比较基准	业绩基准: 沪深300 指数收益率+20%+上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,属于高风险、高收益的投资品种。

2.3 基金管理人		基金托管人	
名称	项目	基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
负责人		王卫	姜国军
联系电话		021-38560600	010-66994855
电子邮箱		csinfo@gtfund.com	gtsp@bank-of-china.com
客户服务热线		021 38560000, 400-888-8888	95566
传真		021-38561800	010-66994942

2.4 信息披露方式	
投资者可登陆深圳证券交易所官方网站	http://www.gtfund.com
基金年度网上各重要地点	
上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 层	

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年5月27日基金合同生效日至2009年12月31日
本期已实现收益	31,402,643.37	43,348,510.39
本期公允价值变动损益	249,045,812.21	213,140,922.62
加:期初基金净值	1,018.99	1,018.99
期末基金净值	1,554,242,478.65	1,554,242,478.65
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末基金份额净值	1.0034	1.0003
期末基金资产净值	2,037,545,499.55	913,154,511.90
期末基金份额净值	1.311	1.153

注:0 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 期末基金净值增长率不包括持有以公允价值计量的金融资产的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

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	业绩比较基准收益率	份额净值增长率-业绩比较基准收益率	①-②	②-③
过去三个月	5.56%	1.48%	5.11%	1.42%	0.09%
过去六个月	28.57%	1.29%	17.68%	1.24%	0.09%
过去一年	13.79%	1.23%	-9.12%	1.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	36.69%	1.25%	13.84%	1.41%	-0.16%

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的比较

自基金合同生效以来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
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.4 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.5 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.6 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.7 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.8 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.9 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.10 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.11 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.12 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.13 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.14 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.15 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.16 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.17 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.18 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.19 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.20 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.21 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.22 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.23 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.24 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.25 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.26 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.27 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.28 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.29 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.30 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.31 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.32 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.33 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.34 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.35 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.36 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.37 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.38 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.39 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.40 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.41 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.42 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.43 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.44 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.45 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.46 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.47 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.48 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.49 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

3.2.50 自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2009年5月27日至2010年12月31日

注:本基金的投资组合投资于股票资产占基金资产净值比例不低于80%,投资于权证资产占基金资产净值比例不超过5%。

2010年12月31日

关联方名称	当期佣金	占当期佣金总额的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
交通证券	197,597.26	6.94%	197,597.26	11.67%

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

注:关联方佣金的服务范围包括佣金收取及本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金报酬