国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金 2010年年度报告摘要

基金管理人的董明 任。本年度报告已約	事会、董事保证本报会 至三分之二以上独立	5所载资料不 董事签字同道	存在虚假i 8,并由董!	2载、误导性陈过 K长签分。	重要提	大造漏,并对	其内容的真实	性、准确性和完整性	承担个别及连带的流
其会托管人中国?	[商银行股份有限公 证复核内容不存在] 以诚实信用、勤勉尽!	司相提太其4	- 公田却宝	. 于2011年3月2	1日領末	*了本招告は	的财务指标、	净值表现、利润分配	情况、财务会计报告
						-定盈利。 细阅读本基:	金的招募说明	书及其更新。	
本报告的财务资料	第自年度报告正文,持 科经审计,普华永道中 F2月10日 協金合同	中天会计师事	务所有限分	公司为本基金出。	建文。 具了无	保留意见的	审计报告,请接	资者注意阅读。	
§2 基金简介 2.1 基金基本标		±xn mi	2010-1-12)	1310.					
基金简称	100							国泰	估值优势分级封闭
交易代码			to or more	A ALTHRON		-1-45 5 54		or destroises.	16021
基金运作方式			契约型型	: 並。封闭期ス)=+	, 本基金(d 务。封闭	b並合同》生: 期届满后,2	改后,在封闭别内/ 本基金转换为上市	K开放申购、赎回』 开放式基金(LOF)
基金合同生效日								Est at	2010年2月10日 基金管理有限公司
基金托管人								E 4-	基亚官 理有限公司 银行股份有限公司
报告期末基金份额	順总額								843,104,538.41
基金合同存续期 基金份额上市的证	工學力見部								不定期 深圳证券交易所
上市日期	20 2000								2010-03-0
下属分级基金的基						国泰优先			国泰进耳
下属分级基金的3 报告期末下属分约					21.55	3,139.14份			15001 421,551,399.276
2.2 基金产品记		-							
投资目标			1 85 2	· 환명				实现基金资产的长	
		业规	本基金 政策以及 划模型, 2、行业	的资产配置领 资本市场资金 确定大类资产	配置力	5案。		下状况、国家财政和 平,使用联邦(FEI 明性规律,来优价	
		Re 业 力	OIC,投资 运用所有 。 3、个形	资本回报率, 「债权人和股系 选择策略	是评位 长投入	一资本投入[为企业获得	回报有效性的 }现金盈利的	的常用指标。该指 1能力,也用来衡量	标主要用于衡量(企业创造价值的自
投资策略	进基	本基金的个股选样主要采取"自下面上"的策略、通过对仓业的基本面由市场竞争格局 进行分析。重点专案具有竞争力和估值优势上市公司股票,在实施严格的风险管理手段的基础上,获取特殊稳定的经规院调整后约合度回报。 4.债券投资策略 本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏							
		视投	政策方向 资管理。 5、权训	及收益率曲約投资策略	見分析	,通过债券	置換和收益	率曲线配置等方法 分析的基础之上,	长,实施积极的债息
			控制风险 6、资产 对各相	b .	E策略 E券利	率敏感度进	±行综合分析	。在给定提前还能	
业绩比较基准								全债指数收益率x	
风险收益特征		型	基金和货	行市场基金。				资产整体的预期 风险收益水平高	
下属两级基金的质	A.险收益特征 人和基金托管人		参优先5 的特征。	計額将表現出付	IK M K	1、収益相系	高的特	取份额则表现出z 证。	5风险、収益相对等
項			1	医金管理人				基金托管人	
名称		国泰基金管	理有限2	公司				行股份有限公司	
200 day day day 200 day	姓名 联系电话	李峰 021-385616	500##				赵会军	99	
^	电子邮箱	xinxipilu@g	tfund.com				custody@icbe	c.com.cn	
客户服务电话		(021)38569		-888-8688			95588		
传真 2.4 信息披露2	行式	021-385618	suU				010-6610579	78	
	告正文的管理人互	联网网址		-	-	//www.gtfu			-
基金年度报告备置		§3	±1	要财务指标、基金				环球金融中心39楼	
3.1 主要会计算	数据和财务指标	3-							金额单位:人民
	数据和指标			2010年2	月10日	1(基金合同	「生效日)至2	010年12月31日	
本期已实现收益本期利润									53,793,093.4
平均利四 加权平均基金份都	前本期利润								0.140
本期基金份額净值									14.009
3.1.2 期末	数据和指标					201	0年末	-	
期末可供分配基金 期末基金资产净f									961,272,745.6
期末基金份額净值注: (1)本期已实现	 直 即收益指基金本期利	息收入、投资	收益、其他	收入 怀含公允	价值变	动收益 油嘴	:相关费用后的]余额,本期利润为本	1.14
允价值变动收益; 2 所述基金业绩 8 本基金合同生 3.2 基金净值?	指标不包括持有人让 效日为2010年2月10	人购或交易基 日,截至2010	金的各项的 年12月31日	费用,计人费用后 日不满一年。					
3.2.1基金份額净值 阶段	份額净值增长率 ①		[增长率	比较 业绩比较基准 益率3)	主收	业绩比较:	基准收益 (本/A)	①-③	2-4
过去三个月	3.549		1.31%		89%	- 中怀但	主任 1.42%	-1.35%	-0.119
过去六个月	24.059	6	1.18%	17.3	31%		1.24%	6.74%	-0.069
PLAN A DESCRIPTION OF	14.009	6	1.05%	-0.2	21%		1.28%	14.21%	-0.239
自基金合同生效 起至今									

注:本基金合同于2010年2月10日生效、截止2010年12月31日未满一年,按某际存获期计算。不按整个自然年度进行折算。 3.过注三年基金的利润分配情况 在封切期内,本基金不平距对基金份额份分离的国本优先与国等进取基金份额进行改益分配。 **84 管理、从管**

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		
余荣权	本基金理 经国际 基国健全司 总经理总统 不是 不是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	2010-02-10	-	17	組土研究生、物任限下尾肌增格集限财务分。 市事年宣和化股金公。年生学规基金管 对有限公司。2003年7月2000年8月第任宣 沒月配置查免的基金经理。2006年4月至 2007年4月兼任华宝兴业多事政制长基金的 全经理。2007年8月至2007年3月任股税包置。 公司。2007年8月至2009年3月任股税包置。 现入2010年2月起来任即参估值优势分级封闭 成五级时期上标准的企业,是在100年2月20日, 2010年3月20日,到底任公司的经验理
程洲	本基金的基金的基型 泰泰爾 (基金) 本基金 金属 (基金) 基金 医二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二甲基二	2010-02-10	-	10	級上研究生、CPA、曾任限于申银万国证券级 劳所。2004年4月加盟国委法全管理有股份 司,历任高级策略分析师。基金经理助理。 2008年4月至任国参全与稳健混合的基金经 理。2009年12月起兼任国参会参封闭的基金 份的基金经过,2010年2月起兼任国泰估值优势分级时 闭的基金经过,

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 本基金运作期不满。年、不适合与本基金管理人旗下的其他投资风格相同的基金进行比较。 4.3.3异常交易行为的专项的用

7.1 资产负债表 会计主体;国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金 报告截止日:2010年12月31日

	单位:人民司 本期末
资产	2010年12月31日
资产:	
银行存款	4,961,849.8
结算备付金	2,357,593.9
存出保证金	846,551.46
交易性金融资产	867,670,634.5
其中:股票投资	818,613,918.5
基金投资	
债券投资	49,056,715.9
资产支持证券投资	•
衍生金融资产	
买人返售金融资产	77,000,355.50
应收证券清算款	10,459,361.5
应收利息	506,239.70
应收股利	
应收申购款	:
逆延所得税资产	
其他资产	
资产总计	963,802,586.5
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	
衍生金融负债	
实出回购金融资产款	•
应付证券清算款	
应付赎回款	
应付管理人报酬	1,241,358.1
应付托管费	206,893.0
应付销售服务费	
应付交易费用	1,001,589.6
应交税费	
应付利息	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	80,000.00
负债合计	2,529,840.80
所有者权益:	
实收基金	843,104,538.4
未分配利润	118,168,207.20
所有者权益合计	961,272,745.6
负债和所有者权益总计	963,802,586.5

本报告期:2010年2月10日 協金合同生效日)至2010年12月31	単位:人民
項 目	本期
柳日	2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日
一、收入	136,190,130.6
1.利息收入	3,794,617.7
其中:存款利息收入	1,335,523.0
债券利息收入	288,443.9
资产支持证券利息收入	
买人返售金融资产收入	2,170,650.8
其他利息收入	
2.投资收益(损失以"-"填列)	68,020,399.0
其中:股票投资收益	62,511,295.4
基金投资收益	
债券投资收益	529,778.8
资产支持证券投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	4,979,324.7
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	64,375,113.7
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	
减:二、费用	18,021,923.3
1.管理人报酬	11,708,343.1
2.托管费	1,951,390.5
3.销售服务费	
4.交易费用	3,883,052.4
5.利息支出	2,287.5
其中:卖出回购金融资产支出	2,287.5
6.其他费用	476,849.7
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	118,168,207.2
减:所得税费用	
	The state of the s

**************************************	131		单位:人民币:
项目	2010年2月1	本期 0日(基金合同生效日)至20	10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)	843,104,538.41	-	843,104,538.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	118,168,207.26	118,168,207.26
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	=	-	=
四、本期向基金份額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)	843,104,538.41	118,168,207.26	961,272,745.67

版告的注:方明多报表的组成部分。 本报告7.1至7.4.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

2010年11月8日,海安市人类的公司。特征大条金世级,这些企业的制造企业企业的制造。1月8日,在自己的工作,但由中发生为国的特先,由中电阻,发生自转。2010年11月8日,由于一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由于一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由于一个工作,是由一个工作,是由于一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由于一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由于一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由一个工作,是由于一个一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是由于一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,

1983年本成型的加速域的中间加速放大厂将为金矿工的国本子推作。未基金能区下不到原类设备。价值设备的特容是约人价值时采用的价值方法及其关键度加下,每年转换取到保障股票,根据中国定量会合生 2008 388 等于进一步规定证券投资基金价值业务的特容是见,本基金采用。中国证券业协会基金估一40 化于利亚大学物理类型价值的参考方式,是国际的指数或基础的重要。 1983年,1 25.17.161%。 7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 7.4.5.1会计政策变更的说明

元。 7.4.5.3差错更正的说明

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
中国建银投资有限责任公司("中国建投")	基金管理人的控股股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东(2010年6月21日起)
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
中国国际金融有限公司("中金公司")	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司
中信建投证券有限责任公司("中信建投")	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司
万联证券有限责任公司	基金代销机构、基金管理人的原股东(2010年6月21日以前)
注:根据国泰基金管理有限公司于2010年6月21日发布的公告,经公司股东会议 投资有限责任公司、原股东万联证券有限责任公司将其所持有的国泰基金管理	F议通过,并报经中国证监会证监许可 [2009]1163号文批准,公司股东中国贸 时限公司合计30%的股权转让给意大利忠利集团。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

2.1基金管理费		单位:人民币元
项目	本期 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日	
生的基金应支付的管理费		11,708,343.16
(付销售机构的客户维护费		4,182.41
付基金管理人国泰基金管理有限公司的管 E人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 2.2基金托管费	理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。 当年天数。	其计算公式为:
Carried Carrie		单位:人民币元
项目	本期 2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日	

	20	10年2月10日(基金台	本期 計同生效日)至2010年	F12月31日		
银行间市场交易的名	6 债券交	基金逆回	1购	基金i	E回购	
关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中信建投	-	-	99,000,000.00	96,965.75		-
7.4.8.4各关联方投资 7.4.8.4.1报告期内基金	本基金的情况 №管理人运用固有资金投资	本基金的情况				份额单位
项目		2010年2月10	本期 日(基金合同生效日)至2010年12月3	18	
	10	泰优先			国泰进取	
基金合同生效日 2010年2月10日)持 百的基金份額		10,00	0,900.00			10,000,900.00
月间申购/买人总 }额		-				-
用间因拆分变动份 则		-				-
成:期间赎回/实出 总份额			-			=
用末持有的基金份 順		0,900.00			10,000,900.00	
用末持有的基金份 順占基金总份额比 列			2.37%			2.37%
2.基金管理人国泰基 7.4.8.4.2报告期末除 国泰优先 无。 国泰进取 无。	后基金总份额比例中的总金管理有限公司在本会计算 金管理人之外的其他关联 第一个专家会管理人之外的其他关联 的银行存款余额及当期产生	ll·丽人购本基金的交易 方投资本基金的情况	予额总额。 委托中国工商银行办理	· 适用费率为1.00	0.00元熎。	单位:人民:
			本期			
关联方名称			10日(基金合同生效	日)至2010年12月		
		期末余额			当期利息收入	

总金额
总金额
1,380,600.00
1,

7.4.12.1.1 🕏	是限证券类别:形	表票								
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 成本总額	期末 估值总额	备注
600219	南山铝业	2010-03-29	2011-03-29	非公开发 行	8.82	9.50	1,500,000	13,230,000.00	14,250,000.00	-
002092	中泰化学	2010-04-19	2011-04-20	非公开发 行	16.33	13.42	500,000	8,165,000.00	6,710,000.00	-
002092	中泰化学	2010-09-20	2011-04-20	非公开发 行-送股	-	13.42	250,000	-	3,355,000.00	-
11.114	可作为特定投资	类.认购由中P	SiF监会《Frit7	NITT	管理力は	当地市市的主	- 八并安行卧画 6	行JI 做的影響自发行起	東ク日紀12个日内	3529

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票 7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.9.3.1银行间市场债券正回购 尤。 7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

于200年1月3日,本基金将有3以公党門與TT即以致上共下海」》。 李正三级的企業。 对于特的企業。即等時候要素,本基金将相关投票公允价值所属混殺于停轉期间从第一层级转人第二层级,并于复辨后从第二层级转回第一层级。 企 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要设理的实施重要等现。 58 按数值合报告 8.1 期末基金资产组合情况

818,613,918.57

金融收产 千式回购的买人返售金融收产 和前售客付金合计 收产 次的股票投资组合 「行业类别 通业	77,000,355.50 	7.99 - 0.76 1.23 100.00 金额单位,人民币 占基金资产单值比例 (%)
和培算各付金合计 资产 次药股票投资组合 行业类别	11,812,152.71 963,802,586.53 公允价值 ————————————————————————————————————	1.23 100.00 金額单位:人民币 占基金资产净值比例 (%)
资产 >类的股票投资组合 行业类别 ,商业	11,812,152.71 963,802,586.53 公允价值 ————————————————————————————————————	1.23 100.00 金額单位:人民币 占基金资产净值比例 (%)
7美的較等投資組合 行业类別 適业	963,802,586.53 公允价值	100.00 金額单位:人民币 占基金资产净值比例 (%)
行业类别	公允价值 - 16,120,000.00	金額单位;人民币 占基金资产净值比例 (%)
行业类别	16,120,000.00	占基金资产净值比例 (%)
進业	16,120,000.00	占基金资产净值比例 (%)
		-
d.		1.60
4		1.68
4	621,999,757.89	64.71
T	77,826,497.28	8.10
· 皮毛	25,429,726.88	2.65
ŕ	-	-
aj	19,199,912.70	2.00
4、塑胶、塑料	99,490,723.21	10.35
	-	-
	96,666,022.48	10.06
f、仪表	154,624,134.26	16.09
物制品	127,008,588.66	13.21
NF.	21,754,152.42	2.26
《及水的生产和供应业	=	-
	14,621,037.21	1.52
、仓储业	=	-
NF.	45,887,352.00	4.77
售贸易	119,985,771.47	12.48
全业	=	-
	=	-
业	-	-
化产业	=	=
	=	=
	818,613,918.57	85.16
	业化产业	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净 (%)
1	002250	联化科技	1,214,627	49,799,707.00	
2	000708	大冶特钢	3,013,717	46,290,693.12	
3	000423	东阿阿胶	800,000	40,880,000.00	
4	600352	浙江龙盛	3,378,177	39,626,016.21	
5	600271	航天信息	1,300,000	35,763,000.00	
6	000895	双汇发展	399,948	34,795,476.00	
7	600280	南京中商	1,188,689	32,807,816.40	
8	600327	大厦股份	2,388,595	28,639,254.05	
9	600062	双鹤药业	1,003,500	28,589,715.00	
10	601717	郑煤机	649,979	27,572,109.18	

股票代码	股票名称	本期累计买人金额	(%)
600377	宁沪高速	46,953,267.85	4.88
000708	大冶特钢	44,862,448.25	4.67
600028	中国石化	43,765,800.00	4.55
600897	厦门空港	43,421,758.10	4.52
600352	浙江龙盛	41,941,591.40	4.36
002250	联化科技	37,943,551.44	3.95
600660	福耀玻璃	37,445,411.44	3.90
000895	双汇发展	36,745,834.40	3.82
600169	太原重工	36,400,512.21	3.79
600362	江西铜业	36,034,841.50	3.75
601628	中国人寿	34,043,629.50	3.54
600327	大厦股份	33,331,927.53	3.47
000880	潍柴重机	33,150,084.91	3.45
000635	英力特	32,949,040.99	3.43
000987	广州友谊	32,885,692.14	3.42
600280	南京中商	32,833,931.10	3.42
600335	鼎盛天工	31,776,186.16	3.31
600779	水井坊	30,524,268.35	3.18
600426	华鲁恒升	30,495,560.24	3.17
601717	郑煤机	28,177,127.37	2.93
600062	双鹤药业	28,014,531.34	2.91
600486	扬农化工	27,689,959.98	2.88
000726	鲁 泰A	27,065,782.91	2.82
002293	罗莱家纺	26,257,613.76	2.73
600600	青岛啤酒	26,202,926.82	2.73
000999	华润三九	25,734,059.97	2.68
600271	航天信息	25,594,148.44	2.66
600115	东方航空	25,413,810.30	2.64
600481	双良节能	25,300,980.32	2.63
601006	大秦铁路	25,132,574.54	2.61
000423	东阿阿胶	24,941,555.31	2.59
600673	东阳光铝	24,427,578.27	2.54
000338	潍柴动力	23,981,921.41	2.49
600859	王府井	23,390,030.47	2.43
600887	伊利股份	22,680,955.58	2.36
000550	江铃汽车	22,598,431.74	2.35
002038	双鹭药业	22,127,423.00	2.30
600036	招商银行	20,926,600.00	2.18
000951	中国重汽		2.16
600056	中国医药	20,375,807.11	2.12
			2.05
600577	精达股份	19,537,274.49	2.03
	600377 000708 600028 600028 6000397 600352 002250 600362 601628 600367 000887 600368 600779 60077	600377	600377 宇产高速 46,953,267,85 6007078 大か砂料 44,862,448.25 600028 中間石化 43,765,800.00 600897 夏(丁を港 43,421,778,10 600332 西江を窓 41,941,991,40 600332 西江を窓 41,941,991,40 600353 西江を窓 41,941,991,40 600600 延駆境境 37,445,411,44 600895 双江東原 36,745,834,40 600895 双江東原 36,745,834,40 600160 太軍県工 36,400,512,21 600322 江西県北 36,403,841,50 601628 中国人参 34,043,629,50 600327 大原県内 33,331,907,53 600327 大原県市 32,885,602,14 600328 衛産県机 33,150,684,91 600328 南東北市 32,885,602,14 600328 南京北市 32,885,602,14 600335 東力特 32,949,940,99 600335 東京市 31,776,188,16 600779 水井坊 30,242,88,35 600335 北京市 31,776,188,16 600779 水井坊 30,242,88,35 600326 年齢任井 30,495,560,24 601717 塚雄帆 28,177,127,37 600062 双南丹北 28,014,531,34 600486 粉を化工 27,689,996 600486 粉を化工 27,689,996 600486 粉を作工 27,689,996 600486 粉を作工 27,689,996 600481 双京市総 25,574,613,76 600699 年前三九 25,734,659,97 600271 板下原原 25,734,659,97 600271 板下原原 25,734,589,97 600271 板下原原 25,734,589,97 600333 尾南南野 25,894,194,194 600887 伊利曼衍 25,894,194,194 600887 伊利曼衍 22,680,985,588 600338 双南野市 22,598,431,74 600087 伊利曼衍 22,680,955,58 600036 日間原行 20,777,100,99 600012 年末前月 20,777,100,99 600012 47,418,524 600012 47,418,524 600012 47,418,524 600012 47,418,524 600012 47,418,524 600013 47,418,524 600014 47,578,27 600015 47,418 600015 47,418 600015 47,418 600015 47,418 600016 47,418 600016 47,418 600016 47,418 600016 47,418 600017 47,418 600017 47,418 600018 47,418 600018 47,418 600018 47,418 60001

1	600377	宁沪高速	47,683,298.54	4.96
2	600897	厦门空港	46,620,228.43	4.85
3	000338	潍柴动力	46,376,239.67	4.82
4	600169	太原重工	38,717,356.98	4.03
5	600859	王府井	31,159,161.88	3.24
6	601628	中国人寿	30,644,255.42	3.19
7	600779	水井坊	30,288,064.68	3.15
8	000550	江铃汽车	30,008,330.38	3.12
9	600486	扬农化工	29,688,945.84	3.09
10	600660	福耀玻璃	29,547,839.12	3.07
11	600028	中国石化	27,122,000.00	2.82
12	000999	华润三九	26,398,579.04	2.75
13	000726	鲁 泰A	26,353,956.07	2.74
14	000635	英力特	26,263,781.23	2.73
15	600887	伊利股份	25,883,376.33	2.69
16	600115	东方航空	24,178,332.14	2.52
17	601006	大秦铁路	24,069,280.63	2.50
18	600426	华鲁恒升	22,624,517.01	2.35
19	600056	中国医药	22,386,268.18	2.33
20	600519	贵州茅台	19,543,254.97	2.03

本期累计卖出金额

序号 股票代码 股票名称

					单位:人民币:
买人股票的	成本(成交)总额				1,744,477,368.64
	收入(成交)总额				1,053,644,072.60
	·票成本、卖出股票收力 末按债券品种分类的信		的無以成交数量 填列,不考	感相关交易费用。	
6.3 991	A-19 (M-29-0019T-2) 3-283 (I	HOPEX PERSON			金额单位:人民币:
序号		债券品种		公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1		国家债券		19,920,000.00	2.07
2		央行票据		9,781,000.00	1.02
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		19,355,715.94	2.01
7		其他		-	-
8		合计		49,056,715.94	5.10
8.6 期	末按公允价值占基金的	管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:
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	019036	10国债36	200,000	19,920,000.0	2.07
2	110003	新钢转债	155,000	17,860,650.0	1.86
3	1001021	10央行票据21	100,000	9,781,000.0	0 1.02
4	126729	燕京转债	8,914	1,202,587.7	4 0.13
5	110011	歌华转债	2,380	292,478.20	0.03
本基金本 8.8 期 本基金本	报告期末未持有资产支		十名资产支持证券投资明细 五名权证投资明细		

序号	名称	金額
1	存出保证金	846,551.46
2	应收证券清算款	10,459,361.55
3	应收股利	-
4	应收利息	506,239.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,812,152.71
8.9.4期末持	有的处于转股期的可转换债券明细	Administration Description
		金额单位:人民币元

9.1	9171-186-3E DO 1961	UHINO ROZZIUHINGHI					份额单位: 6	
				持有人结构				
份额 级别	持有人户	户均特有的基金份额	机构投	资者		个人投	资者	
502.391	数(户)	3701774341377	持有份额	占总位	分额比例	持有份额	占总份額 比例	
国泰优 先	5,637	74,783.	24 280,203,87	4.46	66.47%	141,349,264.68	33.53%	
国泰进取	8,214	51,321.	09 145,510,32	0.45	34.52%	276,041,078.82	65.48%	
合计	13,851	60,869.	58 425,714,19	4.91	50.49%	417,390,343.50	49.51%	
注:以上 国泰优5		场内数据由中国证券登记	己结算有限责任公司深圳分公	可提供。				
序号	ł	寺有人名称	持有份額(份)			占上市总份额	七例	

1	中国人寿保险股份有限公 司	60,319,786.00	17.11%
2	民生人寿保险股份有限公司	26,136,108.00	7.42%
3	中国人寿保险(集团)公司	25,002,125.00	7.09%
4	丁金香	18,116,160.00	5.14%
5	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	16,068,586.00	4.56%
6	中国太平洋人寿保险股份 有限公司-红利发帐户	10,000,550.00	2.84%
7	海尔纽约人寿保险有限公 司	9,536,631.00	2.71%
8	工银瑞信基金公司-工行- 黑龙江省北方矿业 (集团) 有限公司	8,986,542.00	2.55%
9	国信-华夏-"金理财"4号集 合资产管理计划	7,500,450.00	2.13%
10	平安资产管理有限责任公司-自有资金	7,449,940.00	2.11%
注:以上信 因泰进取	息是根据中国证券登记结算有限测	任公司深圳分公司提供的前一百名持有人名	册编制。
序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份額比例
1	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	34,886,887.00	9.87%
2	邹瀚枢	27,328,371.00	7.73%
3	中国人寿保险(集团)公司	25,002,125.00	7.08%
4	国元证券-农行-国元黄山2 号集合资产管理计划	18,073,444.00	5.12%
5	国元证券-民生-国元黄山3	11 592 200 00	2 790.

/	司			8,069,432.00				2.28%		
8	中国太平洋人寿保险 有限公司-红利发帐户		7,000,550.00		7,000,550.00		7,000,550.00			1.98%
9	刘卫琼			6,490,000.00				1.84%		
10	蒋劼			4,831,000.00				1.37%		
	息是根据中国证券登记结算 末基金管理人的从业人员持			供的前一百名持有人名	册编制。					
	项目	(5)	额级别	持有份额总数	(份)		占基金总份额比例			
			国泰优先		98,880.	73		0.02%		
基金管理公本开放式基	:司所有从业人员持有 :金		国泰进取		98,880.	73		0.02%		
			合计		197,761.	46		0.02%		
			§10	开放式基金份额变	动			单位:6		
	TEFF			国家保生			FEEL AND LIST TOTAL			

	坝日	国茶儿尤	国泰进取
基金合 总额	同生效日(2010年2月10日)基金份额	421,553,139.14	421,551,399.27
基金合 购份额	同生效日起至报告期期末基金总申	=	-
减:基金 赎回份!	全合同生效日起至报告期期末基金总 額	=	=
基金合 变动份	同生效日起至报告期期末基金拆分 额	=	-
本报告!	期期末基金份額总額	421,553,139.14	421,551,399.27

11.4 基金經濟學院的改革 接替期,基基金經濟學院的工程 11.5 为基金是行射計的会計博事務所認 报告與,本基金提供前計報会計博事務所認

各的年限为1年。 11.6 管理人,托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 每许额内,本基金管理人,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。

		股票交易		应支付该券商	备注	
券商名称	交易单元数量	成交金額	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
西南证券股份有 限公司	1	913,793,604.65	33.02%	776,720.68	33.55%	本期新增
国信证券股份有 限公司	2	518,281,628.39	18.73%	431,103.73	18.62%	本期新增
上海证券有限责 任公司	1	425,678,020.72	15.38%	361,825.26	15.63%	本期新增
中国民族证券有 限责任公司	1	397,755,306.82	14.37%	323,178.61	13.96%	本期新增
申银万国证券股 份有限公司	2	203,875,394.13	7.37%	167,404.70	7.23%	本期新增
国泰君安证券股 份有限公司	2	181,874,563.46	6.57%	147,774.19	6.38%	本期新增
安信证券股份有 限公司	1	99,250,453.36	3.59%	84,362.52	3.64%	本期新增
海通证券股份有 限公司	1	26,722,575.33	0.97%	22,714.20	0.98%	本期新增
联合证券有限责 任公司	1	=	=	=	-	本期新增
中信金通证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	本期新增
中国银河证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增
上海爱建信托投 资有限责任公司	2	=	=	=	-	本期新增
光大证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中国国际金融有 限公司	1	-	-	-	-	本期新增

中国国际金融 有限公司

	债券交易		回购交易		权证交易	
券商名称	成交金額	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	成交金額	占当期权证 成交总额的 比例
西南证券股份 有限公司	39,093,495.70	87.30%	2,334,000,000.00	48.03%	-	-
国信证券股份 有限公司	319,455.00	0.71%	560,000,000.00	11.53%	-	-
上海证券有限 责任公司	3,856,245.50	8.61%	965,000,000.00	19.86%	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1,235,783.48	2.76%	-	-	-	-
申 银 万 国 证 券 投份有限公司	-	-	300,000,000.00	6.17%	-	-
国 泰君 安 证 券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	277,244.90	0.62%	300,000,000.00	6.17%	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	400,000,000.00	8.23%	-	-
联合证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中信金通证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海爱建信托 投资有限责任 公司	-	=	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-