

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  
报告期截止日:二〇一三年三月二十七日

### § 1 重要提示

基金管理人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。年度报告分为三分册，即“综合报告书”、“年度报告正文”和“年度报告摘要”。  
基金管理人和国泰基金管理有限公司承诺于每年4月25日披露本基金的年度报告。利害关系人可以向基金管理人或基金管理公司查询有关基金的信息，了解基金的投资情况。  
基金管理人和基金管理公司承诺不将基金的管理费、托管费、运作费、销售服务费、申购赎回费、赎回费、交易费、交易佣金等收入归入基金管理人的收入。

本基金过往表现并不代表未来表现。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。

本年度报告摘要经年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务数据经审计，华普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，对投资者注意阅读。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

### § 2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金名称 国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

基金简称 国泰金鼎

基金代码 545471 517319

基金运作方式 契约型开放式

上市地 2009年1月11日 上海证券交易所

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

报告期基金份额总额 5,484,741,317.03

报告期末基金份额净值 1.0000

报告期净值增长率 -0.50%

报告期净值增长率标准差 0.10%

报告期净值增长率相对基准收益的标准差 0.00%

报告期净值增长率相对基准收益的历史波动率 10.11%

报告期夏普比率 0.1089

报告期詹森指数 -0.0147

报告期特雷诺指数 0.1195

报告期索提纳指数 -0.0030

报告期信息比率 -0.0066

报告期阿尔法系数 -0.0242

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320

报告期收益率标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的标准差 0.0250

报告期收益率相对基准收益的历史波动率 0.031%

报告期夏普比率 0.1056

报告期詹森指数 -0.0380

报告期特雷诺指数 0.1010

报告期索提纳指数 -0.0206

报告期阿尔法系数 -0.0066

报告期贝塔系数 0.2950

报告期收益率 -0.0320