

## 责选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

玉	泰金	別	介值	
国泰金鼎价值精选混合型1 2007年3月9日金鼎证券投资基 07年4月11日起,由《金鼎证券 国泰基金管理有限公司(" 公市国际企会按准(由于国际	重要 正券投资基金(以下简称"国泰金期 基金基金份额持有人大会决议通过、 投资基金基金合同》修订而成的《 本基金管理人"或"基金管理人"或 "基金营本基金集中申购的核准.并不	价值基金"或"本基金")由金! 并获中国证监会2007年3月27日 国泰金鼎价值精选混合型证券抗 "管理人")保证招募说明书的	關证券投资基金转型而来。基金转型 日证监基金字(2007)88号文核准。 Ⅰ 投资基金基金合同》生效。 内容真实、推确、完整。本招赛说明 条册业实施性则断产者及证,和 不事用	2011年
8于本基金没有风险。 投资有风险,投资者拟申购 8承受能力,并对于申购基金 8者作出投资决策后,基金运	本基金时应认真阅读本招募说明书 的意愿。时机、数量等投资行为作出 营状况与基金净值变化引致的投资 等未来表现。 诚实信用、勤勉尽责的原则管理和	,全面认识本基金产品的风险地独立决策。基金管理人提醒投资风险,由投资者自行负责。	文益特征,应充分考虑投资者自身的 设者基金投资的"买者自负"原则,在	的 主
投资者在进行投资决策前, 在招募说明书中涉及的与打 报告为2013年1季度报告,有 一、基金管理人	请仔细阅读本基金的《招募说明书》 任管相关的基金信息已经本基金托管 长财务数据和净值表现截止日为2015	》及《基金合同》。 官人复核。本招募说明书所载内		
(一)基金管理人概况 名称:国泰基金管理有限公设立日期:1998年3月5日 住所:上海市浦东新区世纪 办公地址:上海市浦东新区 法定代表人:陈勇胜	司 大道100号上海环球金融中心39楼 世纪大道100号上海环球金融中心3	9楼		
注册资本:1.1亿元人民币 联系人:何晔 联系电话:021-38569000,4	008888688 股东名称 国建银投资有限责任公司	設权比例	60%	
	意大利忠利集团 中国电力财务有限公司 60.其本体3/2		30% 10%	
《证券投资法》。国泰金多高。 国泰金马詹姆时证券投 好收益。国泰金姆伯伯斯 (中国公司特征上海大 (中国公司特征主人, (中国公司特征上海大 (中国公司)	管理人共管理(1,到树江证券投资, 郊肚金。国家货币市场证券投资基金(包括29.4 基金, 资基金、国家货币市场证券投资基金(由金州证 出国家金像体本增值混合证券投资基金 级果理证券投资基金(140.7 世)。 经工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂工厂	分别为国家全龙行业精造证券持 。国家企能性本增值混合证券 持好改准金钟型加来、1国家公司能务 签计等处设法金钟型加来、1国家双利债务 签证券投资基金钟型加来、1国 版工指数证券投资基金。国家 校之易贵于优工数证券投资基金。国家 校之易贵于优工数证券投资基金。国家 核之易贵于优工数证券投资基金。 国家校工券收货基金。但等(10年)( 指数证券投资基金。国家—10年, 指数证券投资基金。国家—10年, 基金里等全计基金等个一种。 基金里等全计基金等个一种。 是一种工作。	设据金。国泰金龙德等证券投资设施金。国泰金龙德等证券投资 设施金。国泰金城等的信息行中间断成长股票管证券投资基金。 12年投资基金。国泰农位优势规则 泰州斯立克10市按证券投资基金。 13月20月分级债券型证券投资基金。 13月20月分级债券型证券投资基金。 28年发表。28年发表。 28年发表。28年发表。 28年发表。28年发表。 13日本发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生发生	据型国型1.等.2型餐瓷型及金包业
观核、资金处翻处长、国际结构 正成之一、2000年2月。 正成业、营业等。1月。 1月,1月,1月,1月,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,1日,	議認副总经理(土持工作)、1992年 高級经济师。1999年8月至2004年1 月至2007年1月至2007年1 月至2007年1 月至2007年1 月至2007年1 日国建筑设存有限常任公司办公设 公司章事。 以上研究生。1997年至1月在1 日本设定。1997年至1月在1 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本区公园 日本设定。1997年至1日本设定	起任国泰亚李有限公司国际业、1999年1月 及任公司董事长。3月 在中国建设银行总行工作。3月 14 在中国建设银行总行工作。1990年1月 15 在中国建银设价交流,截流为,14 任一司金银设行公司,15 任一司金银设订公司,19 5 年 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16	条隔的差型。公司总经理助理兼比 然在建设。 第2章 等人可重独小公室工任,2007年3 有限费任公司工作,完后任资本标志 18世纪与国建。 18世纪与国建。 18世纪与国域。 18世纪国域。 18世纪与国域。 18世纪,	京 圣月芴 人舍 R.山宁王A. 公呆
2010年4月起任公司董丰 经交摊、董丰 此野年生 经理,北京证券营业新疆经 基本、董士等、董士等、董士等、 1月以上, 1日以上, 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上 1日以上	高级工程师。1994年3月至2002年2月 理,天津证券营业和邮房里。经理。 任化分全司总处理,突组制制记,就任 年证券从业经历。1993年7月至200 6分处长、2001年11月至2004年7月 2006年1月至2007年5月在陽平月 18任任公司董事。 是著名粹师,执业范围包括金融证券 《单样师工作,现为北京中仓律师等 《参加原总章》大届学科评议组步》 "今台国际全济技学研究、函会长、引 5月中裁委员会等大届学科评议组步》 "今台国际全济技学研究、通常长、行 5月中裁委员会中被员、动加坡国际等 5月高级经济师。1980年纪任吉林客 任于古林省托发县委寄资。第5年8 新行行行长、党委书记;1998年起任中	月在中国电力信托投资有限公司 2002年2月起在中国电力财务有 中中国电力财务有限公司党组员 1年11月在中国证监会工作。历代 在华夏基金管理有限公司任副 投资有限公司任副 投资有限公司任副 经的人,中国国际经济贸易 大学比率系、法学批准、任助 经知及员、全国法律专业学位研 国际经济发展等 发展等等的发展等分别 接触之一种发展。 长白星局服治多变素特定。1800年的 发展。 1800年的	工作,历任经理即项目经理、证券保险可作,先后任信息中心主任任息,则会处理。2024年月居在公司,是这理。2004年7月至2006年1月在任意中的代表。2007年7月至2006年1月在任商基金的代表。2007年7月任任商基金的,并未是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的人工,但是一个专人的一个专人的一个专人的一个专人的一个专人的一个专人的一个专人的一个专人的	部公司 事室會 大壬二、房里等 县二办
轉少华,独立董事,大学专利 组书记;分行总会计师。2003 2.监事会: 唐建光,监事会主席,大学邓 中国统配媒矿总公司基建局任 在撰炭部基建管理中心工作,	料、高級会计师。1964年起在中国建 年至2008年任河南省豫财会计师事 本科、高级工程师。 1982 年1月至15 工副处长;1993 年7月至195年9月右 先后任综合处处长、中心副主任;	务所副所长。2010年11月起任2 988年10月在煤炭工业部基建司 E中煤建设开发总公司总经理办 1998年10月至2005年1月在中目	公司独立董事。  任工程师;1988年10月至1993年7  公室任处长;1995年9月至1998年1  国建设銀行资产保全部任副总经理	月 0
05年1月起在中国建键投资有 Amerigo BORRINI、监事, 理、忠利集团资产管理公司的 及企业融资部总监,并在Ge- nencial Sp.A., Handridl B, Gen Diemen (NL), Generali Investi Julian N.V., Diemen (NL), I stinolTI, Premuda Sp.A., Gen 刘顺君、监事、硕士研究生。 至2004年1月在长江亚等有有 有限责任公司上党部高级经子 助理,华七分公司经经理助理 公司投资管理事主任。2012年 沙根、监事、硕士研究生, 至2006年1日,但知于华安斯全 多7006年1日,任职于华安斯全	限责任公司先后任资产管理处置部 大学本料、CFA、金融咨询师。1967年 多部首部跌片官。忠利集团财务部位 nerali Horizon S.P.A., Trieste (IT) perali Investment Flay SGR S.P.A., resti Investment Flay SGR S.P.A., restiment, Parigi (FR), Genitland (IRL) J. Centrale Finzairai Generale Supervosa(IT), Transocean Holding Corpor 高级经济师。1986年7月至2000年3, 股份任公司工作、历任投资银行总部 现金任公司工作、历任投资银行总部 现金任公司工作、历任投资银行总部 年月起任公司工作。2088年7月至199年11月任职于目录 999年5月至1999年11月任职于目录。 管理有限公司,2088年7月加入国泰 6年11月起任公司职工宣事。 任任国参省及亚亚岛等入司会计、清算部设	②整理、企业管理高高级业务包 非起历生总特理 Apt 计算算 。 注意、走利集团总经理助理、走 Triste(T)、General Lorence General Multimational Persion A, Net Engineering Internation A, Net Engineering Internation attor(UA)等之分前接任辦。 到存在中国人民解放军军事经济 级分司工作,完任任金编租贷公 经继续、厂产生派、福建业务需 看管规律系,199年;月至2000年 基金管理得的公司 生活任任公	區。2010年 11 月起任公司宣奉。 上申採用金融分析需。北利集团集产 等用首市网施官。北利集团集产 18、SICAV(Lux)、Generali Fanare Bl Soltions SICAV (Lux)、Generali 18 天A. Padova (TI), Perseo Sp. Al 18 天A. Padova (TI), Perseo Sp. Al 18 天A. Padova (TI), Perseo Sp. Al 18 大路、TI, ME教员、副士任、2000年 18 大路、TI, ME教员、副士任、2000年 18 大路、TI, ME教员、副士任、2000年 18 大路、TI, ME教员、国际、TI, MERITER (TI) 18 大路、TI, MERITER (TI) 18	会 金女 a / , 平正主有 1 / 1 /
.現社会管理網絡思急。2007 東國教主 漢字长、周历情况 原現性、漢字长、周历情况则 是立鬼、湖土研究生、高级 海外衛部副总是理、高历情况则 原現性、海外衛部副公里上海分、 周周男、超土研究生、77年 周周男、超土研究生、77年 18年 (19年 ) 田田、東一研究生、17年 ) 田田、東一研究生、17年 ) 北京公司、日本公司、日本公司、日本公司、日本公司、日本公司、日本公司、日本公司、日本	年11月底社公司联儿监事。 起事会成员介绍。 设计师。20年证券基金从业经历。199 设计师。20年年12月加入国泰基金管 经还监。2007年12月加入国泰基金管 及近望。2007年12月加入国泰基金管 2017年12月加入国泰基金管 2017年13日11日11日11日11日11日11日11日11日11日11日11日11日1	23年4月至1998年4月在华夏证券 1月在华夏基金管辖有限公司 1月在华夏基金管辖有限公司 2月在中国建设银行总行工作。 公室高级业务经理、业务运营生 18月在博用设备管理等的经验理。2012年8月 250年4月在中国证监会信息中心 设在,2012年6月加入国 引证券。2012年6月加入国	上工作,历任营业密财务经理、公司 作,历任综合管部部总经理、基金公 公司副总经理、2011年1月起兼化 先后任办公室科员、个人银行业务 负责人、2011年1月加入国泰基会 负责人、2011年1月加入国泰基会 加入国泰基金管营有限公司,2012年 工作,历任专业助理、主任科员、201 泰基金管理有限公司、2012年8月 金管理有限公司、历任行业研究员、3	十五京 耶辛 毎年 15号 土
金鼎基金(2000年5月16日)	&金羚埋。 4月11日至2008年3月由崔海峰担任 至2007年4月10日): 2000年5月至200 F3月由何江旭担任基金終理, 2004年	12年5月由张以杰担任基金经理	,2002年5月至2003年1月由胡定超拉	且且
(3)相关研究人员配备 为确保实现基金合同规定的 究开发部在对宏观经济发展不 则算的结果提出投资可性外 。 机农油等委员合成员		础上拟定投资建议;金融工程部	B负责数量分析,根据历史模拟和B	XI,
平中心、市场体系等负责人员 帮公司投资决策委员会会议。 标投资策略、基金大类资产配 投资决策委员会成员组成好 全地女士:总经理 周向勇先生:副总经理	条决策委员会,其成员在公司总经理中产生。公司总经理可以推荐上述 中产生。公司总经理可以推荐上述 公司投资决策委员会主要职责是根 置原则,以及研究相关投资部门提出 四下:	人员以外的投资管理相关人员 据有关法规和基金合同,审议并 出的重大投资建议等。	目标。通过表现一种的公司管体系负责 生成员、警察长和运营体系负责 决策公司投资研究部门提出的公司	Į Į
黄焱先生:总经理助理 张则赋先生:财富管理中心 沙骎先生:投资总监 张玮先生:投资总监兼研究 裴晓辉先生:固定收益投资 6.上述成员之间均不存在设				
一、基本作品へ (一)基本情况 名称:中国建设银行股份有 住所:北京市西城区金融大 办公地址:北京市西城区间 法定代表人:王洪章	限公司(简称:中国建设银行) 街25号			
存结期间,持结经营	零玖拾集万集仟肆佰捌拾陆元整 中国证监会证监基字[1998]12号			
联系电话:(010) 6759 5096 中国建设银行股份有限公司 国建设银行是中国四大商业银 行的商业银行是中国四大商业银 位银行中首家在海外公开上; 银行A股在上海证券交易所上	司拥有悠久的经营历史,其前身"中 银行之一。中国建设银行股份有限2 资产和负债。中国建设银行假票代 市的银行。2006年9月11日,中国建设 市并开始交易。A股发行后中国建设	公司由原中国建设银行于2004年 冯:939)于2005年10月27日在香港 2银行又作为第一家H股公司晋	9月分立而成立,承继了原中国建设 B联合交易所主板上市,是中国四次 身恒生指数。2007年9月25日中国	。 足大主
1%。 中国建设银行在中国内协议	国建设银行资产总额139,728.28亿元 - 化资产回报率为1.47%,年化加权得 - 取益率为2.75%,均较上年同期提高 - 发有1.47%,分为机构,1987年间,	新加坡, 注兰古福, 约翰内斯堡	. 在京. 首尔. 纽约. 胡志明市. 悉尼	
建信金融租赁、建信信托、建 2012年,本集团各方面良好 杂志联合Brand Finance发布	比设有代表处、海外机构已覆盖到全 条架构已初步形成。中国建设银行筹 信人寿、中值生房储蓄银行等多家、可 表现、得到市场与社会各界广泛认见 的"世界银行品牌500强"以及Interle 15名"中列第77位、较上年上升31位。 托管 投行 投资者关系和企业社会	F公司,为客户提供一体化全面; 可,先后荣获国内外知名机构授- brand发布的"2012年度中国最信 业的。本集团运费在了国内的。	金融服务能力进一步增强。 予的30多个重要奖项。在英国《银行 走品牌"中,位列中国银行业首位;在 新展的技术之间分别。	Ť
□210人。目2007年起,托管音 (二)主要人员情况 杨新丰,投资托管业务部总 計划财务、会计结算、营运管理	各一个9%/似上十二人51以 社管,投行,投资者关系和企业社会 社管业务部、下设综合处、基金市场 产校算团队、养老金托管处、托管业 居盆线槽资外部会计师审多所对托管 经理、曾就职于中国建设银行江苏名 整工作,具有丰富的客户服务和业	了业务进行内部控制审计,并已约 省分行、广东省分行、中国建设银 务管理经验。	全成为常规化的内控工作手段。 1行总行会计部、营运管理部,长期从	J
纪伟,投资托管业务部副总 事大客户的客户管理及服务 张军红,投资托管业务部副	经理,曾就职于中国建设银行南通允 工作,具有丰富的客户服务和业务管 总经理,曾就职于中国建设银行青岛 务管理等工作,具有丰富的客户服务	}行、中国建设银行总行计划财: 理经验。 3分行、中国建设银行零售业务;	多部、信贷经营部、公司业务部、长其 部、个人银行业务部、行长办公室,十	<b>州</b>
关于国家证券投	泰中国企业 资基金201	境外高收3年境外	益债券型 主要市场	
中立 体据《国泰中国企业境外》的有关规定,为了保障基金 除上海和深圳证券交易所已 债券型证券投资基金(以下符	支日 哲	大父历比 合同)、《国泰中国企业境外高 购、赎回等业务,国泰基金管理 8外主要市场节假日或非交易, 的交易,并自下一开放日恢复2	业益债券型证券投资基金招募说 有限公司(以下简称"本公司") 背算日,暂停国泰中国企业境外高 本基金的正常交易,届时不再另行	朋决收公
日期		美国		ı

日期	美国
013年7月1日	香港特别行政区成立纪念日
013年7月4日	美国独立日
013年8月8日	新加坡开斋节
013年8月9日	新加坡国庆节
013年9月2日	美田劳动节
013年10月14日	香港重阳节
013年10月15日	新加坡率牲节
013年11月28日	美田感恩节
013年12月25日	美国、香港、新加坡圣诞节
013年12月26日	香港圣诞节

## 国泰6个月短期理财债券型 证券投资基金偏离度绝对值 达到/超过0.5%公告

基金名称	国泰6个月短期理财债券型证券投资基金
基金简称	国泰6个月短期理财债券
基金主代码	020029
基金管理人名称	田泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
公告依据	根据《国泰6个月短期理财债券型证券投资基金基金合同》、《国泰6个月短期理财债券型证券投资基金招募设明书》等相关文件的规定。
偏离度绝对值达到/超过0.5%的日期	2013-5-22
偏离度	0.5036%
偏离的具体原因	因市场收益率波动,本组合持有的短期磁资券等品种市场收益率下行,造成偏离度持续上升,超过 0.5%。
对偏离的处理方法	按照基金合同约定,根据风险控制的需要调整组合。

国泰基金管理有限公司 二零一三年五月二十四日

			(201) 管理人:国泰基 托管人:中国颈		理有限公	
WW.					רן כלו אנו בין	) PLC
[丰富的客户] (三)基金 作为国内] 内部控制,严	服务和业务管理经验。 注托管业务经营情况 首批开办证券投资基金托管 「格履行托管人的各项职责」	r业务的商业银行,中国建设银行一直乘持"! 切实维护资产持有人的合法权益,为资产委	部、长期从事客户服务、信贷业务管理等工作、 以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管 托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步	理 39	安信证券股份有限公司	注册地址:8 法定代表人 联系电话:0
、QFII、企业: 已托管285只 09年起连续! 管银行" 奖	年金等产品在内的托管业务 引证券投资基金。建设银行 四年被国际权威杂志《全球 并获和讯园2011年度和201	·体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商: 专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了 托管人》评为"中国最佳托管银行",在2007:	2资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人 业银行之一。截至2012年12月31日,中国建设 "业内的高度认同。中国建设银行在2005年及 年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最 权威经济媒体《每日经济观察》2012年度"最	银 自 佳	东莞证券有限责任公司	客服电话:4 注册地址:3 法定代表人
金托管银行 三、相关服 (一)基金 1、直销机 序号	<b>货机构</b> ≥份额发售机构	81.	构信息	1		电话:0769- 客服电话:0 注册地址:P 法定代表人
1	国泰基金管理有限公司上海直 柜台	地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球	金融中心39楼 传真:021-68775881	41	恒拳证券股份有限公司	生活:0471- 客服电话:0 注册地址:8
2	国泰基金管理有限公司北京直 柜台	联系人:蔡丽萍 地址:中国北京市西城区金融大街7号第5层 电话:010-66553078 联系人:干彬	阿址:www.gfund.com 传真:010-66553082	42	世纪证券有限责任公司	法定代表人 电话:0755- 传真:0755-
3 2、代銷机	国泰基金电子交易平台 构 银行及券商	网站:www.gtfund.com 登录网上交易页面 电话:021-38561841	联系人:沈茜	43	厦门证券有限公司	注册地址:提 法定代表人 电话:0592- 客服电话:0
序号	机 构 名 称 中国银行股份有限公司	注册地址;北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人;肖钢	京信息 联系人:客户服务中心	44	华宝证券有限责任公司	注册地址:」 法定代表人 电话:021-6
2	中国建设银行股份有限公司	客服电话:95566 注册地址:北京市西城区金融大街25号 办公地址:北京市西城区拥市口大街1号院1号楼 法定代表人:王洪章	网址:www.boc.cn 客服电话:95533	45	中国国际金融有限公司	客服电话:4 注册地址:1 法定代表人 电话:010-6
3	中国农业银行股份有限公司	网並:www.ccb.com 注册地址:北京市东城区建团门内大街69号 办公地址:北京市东城区建团门内大街69号 法定代表人:蒋超良	客户服务电话:95599	46	华福证券有限责任公司	网址:www. 注册地址:礼 法定代表人
		联系人;刘一宁 网址;www.95599.cn 注册地址;北京市西城区复兴门内大街55号(10000	传真:010-85109219			电话:0591- 客服电话:0 注册地址:1 法定代表人
4	中国工商银行股份有限公司	办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号(10000 法定代表人;姜建清 网址:www.icbc.com.cn 注册地址:上海市银城中路188号	5) 电話:95588	47	天相投资颐问有限公司	电话:010-6 客服电话:0 注册地址:1
5	交通银行股份有限公司	法定代表人,胡怀邦 联系人,曹榕 阿並,www.bunkcomm.com 注册地址,深圳市深南大道7088号招商银行大厦	客服电话:95559 电话:021-58781234	48	信达证券股份有限公司	法定代表人 电话:010-8 客服电话:4 注册地址:1
6	招商银行股份有限公司	注册地址: 採用印採附入組 //88号相同银行入展 法定代表人: 傳育宁 电话: 0755-83198888 客户服务热线: 95555	联系人: 邓桐鹏 传真: 0755-83195109 网址: www.cmbchina.com	49	中国民族证券有限责任公司	法定代表人 电话:010-5 客服电话:4
7	上海浦东发展银行股份有限 公司	注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号 办公地址:上海市中山东一路12号 法定代表人;吉璐辉 联系人;高天、虞谷云	电话:021-6161888 客户服务集线:95528	50	华龙证券有限责任公司	注册地址: 法定代表人 电话:0931- 客服电话:0
8	华夏银行股份有限公司	网址:www.spdb.com.cn 注册地址:北京市东城区建国门内大街22号 办公地址:北京市东城区建国门内大街22号		51	国元证券股份有限公司	岡址:www.l 注册地址:9 法定代表人
		法定代表人;吴建 网址:www.hxb.com.cn 注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大制 法定代表人;孔丹	客户服务热线,95577 夏C座 联系人,丰靖		min 0 min 0 min min - 4	电话:0551- 客服电话:9 注册地址:标 法定代表人
9	中信银行股份有限公司	电话:010~65550827 客服电话:95558 注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人:董文标	传真:010-65550827 网址:www.bank.ecitic.com 联系人-崔云镇. 吳雀鹏	52	杭州银行股份有限公司	电话:0571- 客服电话:4 注册地址:0
10	中国民生银行股份有限公司	电话:010~58351666 客服电话:95568 注册地址:北京市西城区金融大街3号	传真:010-83914283 网址:www.cmbc.com.cn	53	西部证券股份有限公司	法定代表人 电话:029-8 客服电话:9 注册地址:0
11	中国邮政储蓄银行股份有限公司	法定代表人:李国华 客服电话:95580 网址:www.psbc.com 注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交	联系人;陈春林 传真:010-68858117 <b>死</b> 处荣超商多中心A栋第18层-21层及第04层	54	平安银行股份有限公司	法定代表人 电话:0755- 岡址:www.l
12	中国中投证券有限责任公司	01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元 法定代表人;龙增来 电话:0755~82023442 网址;www.china~invs.cn	界处來超商务中心A栋第18层-21层及第04层 联系人:刘毅 客服电話:400-600-8008	55	德邦证券有限责任公司	注册地址;」 法定代表人 电话:021-6
13	国拳君安证券股份有限公司	注册地址;上海市浦东新区商城路618号 法定代表人;万建华 电话;021-38676161	联系人: 芮敏棋 传真: (021-38670161	56	中航证券有限公司	客服电话:4 注册地址:内 法定代表人 电话:0791-
14	宏源证券股份有限公司	客服电话:400-888-8666 注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路23 法定代表人:冯戎 电话:010-88085858	网址:www.gtja.com 3号 联系人;李巍 传真:010~88085195	57	东海证券有限责任公司	客服电话:4 注册地址:① 法定代表人 电话:0519-
15	万联证券有限责任公司	客服电话:400-800-0562 注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广 法定代表人:张建军 电话:020-38286651	网址; www.hysec.com 场F條18,19层 联系人; 罗创斌 传真;020-22373718-1013	58	方正证券股份有限公司	客服电话:4 注册地址;尚 法定代表人
16	中信建投证券股份有限公司	客服电话:400-888-8133 注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼 法定代表人;王常青	网址:www.wlzq.com.cn 联系人:魏明	36	万正能等级矿有限公司	电话:0731- 客服电话:9 注册地址:对 法定代表人
		电话:010~85130588  客服电话:400~888~8108  注册地址:上海市淮海中路98号  法定代表人:王开国	传真:010-65182261 网址:www.csc108.com 联系人:李突鸣	59	山西证券股份有限公司	佐定1(次人 电话:0351- 客服电话:4 岡址:www.i
17	海通证券股份有限公司	电话;021-23219000 客服电话;400-888-8001(全国),021-95553 网址;www.htsec.com 注册地址;北京市西城区金融大街35号国际企业大	传真:021-23219100	60	湘财证券有限责任公司	注册地址:為 法定代表人 电话:021-6
18	中国银河证券股份有限公司	法定代表人:陈有安 电话:010~66568430 客服电话:400~8888~888	联系人:田徽 传真:010-66568990	61	华融证券股份有限公司	客服电话:4 注册地址:1 法定代表人 电话:010-5
19	中信证券(浙江)有限责任公司	网並:www.chinastock.com.cn 注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒组 法定代表人:沈强 电话:0571−86078823	生大厦19楼 联系人:周妍 客服电话:0571-96598	62	日信证券有限责任公司	客服电话:0 注册绝址:所 法定代表人
20	申银万国证券股份有限公司	阿並;www.bigum.com.cn 注册地址;上海市常熟路171号 法定代表人;丁國宋 电话;021-54033888	联系人:邓寒冰			电话:010-6 客服电话:0 注册地址:是 法定代表人
21	东方证券股份有限公司	を貼-021-34033888 客服电話:021-962505 注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层 法定代表人:潘鑫军	传真:021-54038844 网址:www.sw2000.com.cn 联系人:吴宇	63	江海证券有限公司	电话:0451- 客服电话:4 注册绝址:广
21	<b>朱力证券配订有权公</b> 司	电话:021-63325888  客限电话:95503  注册地址:苏州工业园区型园路181号商旅大厦18- 法定代表人:吴永緒	传真:(021-63326173 网址: www.dfzq.com.cn 21层 联系人: 方晓丹	64	广州证券有限责任公司	法定代表人 电话:020-8 客服电话:0 注册地址:
22	东吴证券股份有限公司	电话:0512-65581136 客服电话:0512-33396288 注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会/	传真;0512-65588021 网址:www.dwzq.com.cn 	65	天源证券经纪有限公司	法定代表人 电话:0755- 客服电话:4
23	广发证券股份有限公司	办公地址。广东省广州天河北路大都会广场5、18、1 法定代表人、孙树明 电话:020~87555888 客服电话:95575	9、36、38、39、41、42、43、44標 联系人: 贫炭 传真: 020~87555305 网址: www.gf.com.cn	66	浙商证券股份有限公司	注册地址: i 法定代表人 电话:021-6 客服电话:9
24	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市水叔路15号 办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金 法定代表人:曾小普 电话:0791-6285337		67	新时代证券有限责任公司	注册地址: 法定代表人 电话:010-8
25	民生证券股份有限公司	电站:0/971 <sup>-0</sup> 628337 网址:www.gstock.com 注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金 法定代表人:余政	職中心A座16-18层 联系人:赵明	68	西南证券股份有限公司	客服电话:4 注册地址: 法定代表人 电话:023-6
		电话:010~85127622 客服电话:400~619~8888 注册地址:上海市西藏中路336号 法定代表人;都忠民	传真,010~85127917 网址:www.mszq.com 联系人:张瓘	69	中银国际证券有限责任公司	岡址:http:// 注册地址:」 法定代表人
26	上海证券有限责任公司	电话:021-53519888 客服电话:021-962518 注册地址:上海市静安区新网路1508号	传真:021-53519888 网址:www.962518.com		1 800000 0000 00000	电话:021-2 客服电话:4 注册地址:1 法定代表人
27	光大证券股份有限公司	法定代表人:徐浩明 电话:021-22169999 客服电话:10108998:400-888-8788 网址:www.ebscn.com	联系人:刘晨 传真:021-22169134		国都证券有限责任公司 三方销售机构	生活:010-8 客服电话:4
28	中信万通证券有限责任公司	注册地址: 肯岛市崂山区苗岭路29号澳利玛大厦15 办公地址: 肯岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融 法定代表人,杨宝林 电话:0532~85022326		序号	机构名称	注册地址: 法定代表人
29	中信证券股份有限公司	客服电话:0532-96577 注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越即 法定代表人:王东明	网址:www.zxwt.com.cn 中代广场 (二期) 北座 联系人:陈忠		ト海上書サム砂井田・・・・・	电话:021-5 客服电话:4 注册地址:」 法定代表人
		电话:010-84588888		2	上海长量基金销售投资顾问 有限公司	法定代表人 电话:021-5 客服电话:4 注册地址:8
30	华泰证券有限责任公司	法定代表人:吴万善 电话:025-84457777 客服电话:95597	联系人;张小波 网址:www.htzq.com.cn	3	深圳众禄基金销售有限公司	法定代表人 电话:0755- 客服电话:4
31	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦 法定代表人:胡运钊 电话:027-65799999 客服电话:95579	联系人:李良 传真:027~85481900 网址:www.95579.com	4	杭州数米基金销售有限公司	网址:www.i 注册地址:h 法定代表人
32	国海证券股份有限公司	注册地址:广西桂林市辅星路13号 法定代表人:张雅锋 电话:0755~83709350 客服电话:95563	联系人;牛孟宇 传真:0755-83704850 网址;www.ghzq.com.cn	4	www.m.m.需要 対告付限公司	电话:0571- 客服电话:4 注册地址:」
33	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写 办公地址:天津市河西区寬水道8号 法定代表人:杜庆平	字楼101室 联系人:王兆权	5	上海天天基金销售有限公司  册登记机构	法定代表:封 电话:021-5 客服电话:4
		电话:022-28451861 客服电话:400-651-5988 注册地量:郑州市郑东新区商务外环路10号 办公地量:郑州市郑东新区商务外环路10号17层	传真: (022-28451892 网址: www.bhzq.com	序号	加 构 名 称	
34	中原证券股份有限公司	法定代表人; 曾明军 电话:0371-65585670 客服电话:400-813-9666/0371-967218 网並: www.ccnew.com	联系人,程月铯,款铭 传真:0371-65585665	(三)出序号	具法律意见书的律师事务所 机 构 名 称	注册地址
35	国信证券股份有限公司	注册地址;深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券 法定代表人:何如 电话:0755-82130833	联系人:齐晓燕 传真:0755-82133952	(四)审	上海源泰律师事务所计基金财产的会计师事务所	负责人:/ 电话:021 经办律师
36	招商证券股份有限公司	客服电话-95536 注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-4 法定代表人:宫少林 电话:0755-82943666	<b>网址:www.guosen.com.cn</b> 忌 联系人, 黄健 传真:0755−82943636	序号	机构名称 普华水道中天会计师事务所有	注册地址办公地址

9	安信证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大队 法定代表人:牛冠兴 联系电话:0755-82825551	第35层 28层 A02单元 联系人:陈纯虹 传真:0755-82558355
0	东莞证券有限责任公司	客服电话:400-800-1001 注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心 法定代表人:游锦鲜	网址:www.esence.com.cn 30楼 联系人:梁健作
		电话:0769-22119341 客服电话:0769-961130 注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街1 址中件事人: 库仑层	
1	恒泰证券股份有限公司	法定代表人; 庞介民 电话:0471-4972343 客服电话:0471-4961259 注册地址; 深圳市深南大道7088号招商银行大队	联系人: 王旭华 传真: 0471-4961259 阿址: www.cnht.com.cn Z40-42楼
2	世纪证券有限责任公司	法定代表人:卢长才 电话:0755-83199511 传真:0755-83199545	联系人:王飞 客服电话:0755-83199511 网址:www.csco.com.cn
3	厦门证券有限公司	注册地址;厦门市塞前西路二号莲富大厦十七标 法定代表人;傅毅辉 电话;0592-5161642	联系人:卢金文 传真:0592-5161140
4	华宝证券有限责任公司	客服电话:0592-5163588 注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球 法定代表人:陈林 电话:021-68778081	同址:www.xmzq.cn 金融中心57层   联系人:刘明川   传車021-68778117
5	中国国际金融有限公司	客服电话:400-820-9898 注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦28 法定代表人:李刘阁	网址:www.cnhbstock.com #27层及28层 联系人;罗文雯
,	**************************************	电话:010-65051166 网址:www.cicc.com.cn 注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7.8原	
6	华福证券有限责任公司	法定代表人,黄金琳 电话,0591-87278701 客服电话,0591-96326 注册地址,北京市西域区金融街19号富凯大厦B	联系人:张腾 传真:0591-87841150 网址:www.hfzq.com.cn 缩701
7	天相投资顾问有限公司	法定代表人:林义相 电话:010-66045608 客服电话:010-66045678	联系人:林爽 传真:010-66045527 网址:www.bssec.com
8	信达证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区闸市口大街9号院1号标 法定代表人:高冠江 电话:010-88656100 客服电话:400-800-8899	联系人:唐静 传真:010-88656290 同址:www.cindasc.com
9	中国民族证券有限责任公司	各版电信:400-800-8899 注册地址:北京市西域区金融大街5号新盛大厦 法定代表人;赵大建 电话:010-59355941	
		客服电话:400-889-5618 注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号 法定代表人:李晓安	陽址:www.e5618.com 联系人:李昕田
0	华龙证券有限责任公司	电话:0931-8888088 客服电话:0931-4890100,4890619,4890618 网址:www.hlzqgs.com	传真:0931-4890515
l	国元证券股份有限公司	注册地址,安徽省合肥市寿春路179号 法定代表人,风良志 电话:0551-2257012 客服电话:95578	联系人:祝丽萨 传真:0551-2272100 网址:www.gyzq.com.cn
2	杭州银行股份有限公司	各版电话:95578 注册地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦 法定代表人:吴太普 电话:0571-85163127	問班:www.gyzq.com.cn 联系人;严峻 传真;0571−85179591
3	西部证券股份有限公司	客服电话,400-888-8508 注册地址,陕西省西安市东新街232号信托大厦 法定代表人,刘建武	同址:www.hzbank.com.cn 16-17楼 联系人:冯萨
		电话:029-87406488 客服电话:95582 注册地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发 法定代表人:肖遂宁	传真:029-87406387 同址:www.westsecu.com 定展银行大厦 联系人:王昕
4	平安银行股份有限公司	电话:0755-22168032 网址:www.bank.pingan.com 注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9档	客服电话:95511-3或95501
5	德邦证券有限责任公司	法定代表人; 姚文平 电话:021-68761616 客服电话:400888128	联系人:罗芳 传真:021-68767981 同址:www.tebon.com.cn
6	中航证券有限公司	注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619年 法定代表人:杜航 电话:0791-86768681 客服电话:400-8866-567	联系人: 厳密   快系人: 厳密   传真:0791-86770178   同址:www.avicsec.com
7	东海证券有限责任公司	注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广址 法定代表人:朱科敏 电话:0519-88157761	
8	方正证券股份有限公司	客服电话:400-888-8588 注册地址:湖南省长沙市英客中路二段华侨国际 法定代表人:雷杰	联系人:郭瑞军
		电话;0731-85832503 客服电话;95571 注册地址;太原市府西街69号山西国际贸易中心 法定代表人;侯巍	传真:0731-85832214 同址:www.founders.com )东塔楼 联系人:郭增
9	山西证券股份有限公司	电话:0351-8686659 客服电话:400-666-1618,95573 网址:www.i618.com.cn	传真:0351-8686619
0	湘财证券有限责任公司	注册地址;湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际 法定代表人;林俊波 电话;021-68634518	联系人:钟康端 传真:021-68865680
1	华鼬证券股份有限公司	客服电话,400-888-1551 注册地址,北京市西城区月坛北街26号 法定代表人,宋德清 电话;010-58568040	関址:www.xcsc.com 联系人:陶源 传真:010~58568062
		客服电话,010-58568118 注册地址,呼和浩特市新城区锡林南路18号 法定代表人,孔佑杰	同址:www.hrsec.com.cn 联系人:陈书杉
2	日信证券有限责任公司	电话:010-66413306 客服电话:010-88086830 注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56 <sup>5</sup>	
3	江海证券有限公司	法定代表人。孙名杨 电话。0451-82336863 客服电话。400-666-2288 注册地址。广州市天河区珠江西路5号广州团际	联系人: 张宇宏 传真: 0451-82287211 同址: www.jhzq.com.cn 会验中心: + 2510楼 20楼
4	广州证券有限责任公司	法定代表人: 刘东 电话: 020-88836655 客服电话: 020-961303	联系人:林洁茹 传真: 020-8836654 网址: www.gs.com.cn
5	天源证券经纪有限公司	注册地址,青海省西宁市长江路53号 法定代表人:林小明 电话:0755-33331188	联系人:王斌 传真:0755-33329815
6	浙商证券股份有限公司	客服电话:4006543218 注册地址:新江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广 法定代表人;吴承根 电话:021-64318893	同址:www.tyzq.com.cn - 场A座6/7   联系人:毛亚莉   传真・021-64713795
	新时代证券有限责任公司	客服电话:967777 注册地址:北京市西城区金融大街1号A座8层 法定代表人:马金声	同址:www.stocke.com.cn 联系人:孙恺
7	初时几世莽有税页社公司	电话:010-83561149 客服电话:4006989898 注册绝址:重庆市江北区桥北莞8号	传真:010-83561094 同址: www.xsdzq.cn
3	西南证券股份有限公司	法定代表人;余维佳 电话:023-63786141 网址:http://www.swsc.com.cn 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银	联系人: 张煜 传真:023-63786212 大厦39层
)	中银国际证券有限责任公司	法定代表人;许刚 电话;021-20328216 客服电话;4006208888	联系人: 李丹 传真: (21-50372474 网址: www.bocichina.com
)	国都证券有限责任公司	注册地址;北京市东城区东直门南大街3号国华 法定代表人;常喆 电话;101-84183333	联系人: 黄静 传真: 010-84183311-3389
第三才	方销售机构 机 构 名 称	客服电话:4008188118 杉 注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号4	网址:www.guodu.com L 构 信 息 樣449室
_	上海好买基金销售有限公司	法定代表人:杨文斌 电话:021-58870011 客服电话:400-700-9665	联系人:王玉山 传真:021-68596916 同址:www.chowbuy.com
	上海长量基金销售投资顾问 有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220 法定代表人:张跃伟 电话:021-58788678-8201	室 联系人: 放玲 传真:021-58787698
		客服电话:400-089-1289 注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银 法定代表人:薛峰	同址:www.erichfund.com 银行大厦25様Ⅰ,J单元 联系人; 童彩平
_	深圳众禄基金销售有限公司	电话 :0755-33227950 客服电话 :4006-788-887 网址 :www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com	传真:0755-82080798
	杭州数米基金销售有限公司	注册地址:杭州市余机区仓前街道海曙路东2号 法定代表人:陈柏青 电话:0571-28829790	联系人: 周纏曼 传真:0571-26698533
	ト海子子せん峰和ケベハー	客服电话:4000-766-123 注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 法定代表:其实	阿址;www.fund123.cn 联系人;朱钰
	上海天天基金销售有限公司 登记机构	电话:021-54509988-1071 客服电话:4001818188	传真:021-64383798 岡址:www.1234567.com.cn
7	机构名称 中国证券登记结算有限责任公	办公地址:中国北京西城区金融大街27号投	机构信息 资广场22层 传真:010-58598907 电话:010-58598839
)出具	法律意见书的律师事务所 机 构 名 称	注册地址:上海市浦东南路256号华夏银行大	机构信息 厦14楼
)审计	上海源泰律师事务所基金财产的会计师事务所	负责人;廖海 电话:021-51150298 经办律师:廖海、田卫红	联系人:廖海 传真:021-51150398
7甲川	本	注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路 办公地址:上海市湖滨路202号普华水道中心	>11楼
	公司	法人代表:杨绍信 电话:021-61238888	联系人:微佳兆 传真:021-61238800

七.投资范围 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,短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证益会允许基金投资的其缔金融工具,其中债券投资的主要品种包括交易所能积何间所市场的国债。金融信业经济与转换信息。如果法律法规运营的规划。后先往秦建校营工总制,基金需要人使评还当量程序。10 均其结束从投资范围。未完金股票房产的设计设计上发生发展,是一个企业工程,是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程的工程,但是一个企业工程,但是一个工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个企业工程,但是一个工

本基金 的一级	股票油个股篮说	的方法,从个股选择 投票池的基础上,					
本基金 2、二级	:在运用估值模型 :股票池个股筛送	!对行业内个股内在	E价值估值的基础	出上,选取各行业内	价值排名前1/3的	个股组成基金的-	-级股票池。
本基金 对于选择 大选基票 本。	金运用加权平均 期性行业等现金 的优先考虑因素 在一级股票池中 组合构建和调整	」选取折现值靠前的 E	ACC),充分考虑 上,本基金在现金 约300个左右个股	到股权成本和债券 流折现的基础上,依 组成基金的二级股	成本的差异和税务 衣据这类个股的市 票池。	·盾牌的作用,精确 场表现,估算个股	計算个股的 的α值,以α(
化股票	组合,以达到单	b内在价值和风险的 位风险下的收益最 略 至主要以长期利率起 5、实施积极的债券	大化。				
、収益 当预測 责券组	E率曲线配置具体  收益率曲线平行  合的平均久期;	5、失地怀极的 同分 第略 扩上移或是陡峭化印 当预测收益率曲线 加债券组合的平均	寸,适当地降低债 剧烈平行上移时	券组合的平均久期 ,同时降低债券组合	;当预测收益率曲 合的平均久期和债	线平行下移或是 券组合的持仓量	平坦化时,适;当预测收益
组合进 2、债券 本基金 的数量	注行子弹型或是吗 置換策略 注以利差分析为書 上、減少企业债和	F铃型配置。 磁·当债券利差增 金融债的数量;债券 3建债券组合之后,	大时,适当增加公 学组合的平均信用	と业债和金融债的制 等级保持在投资级	效量、减少国债的数 及(A+级)以上。	数量,当债券利差	
1) 短打 2) 中十 3) 央行 4) 债法	朝经济运行指标 长期国内通货膨 行通过公开市场 卷一级市场上的	,如短期通货膨胀 胀预期的变动引起 操作引导市场收益 发行方式创新及新	率、短期名义利率 中长期利率走势 率水平的走向,从 儘定价与由购情	(、汇率等发生变动, 变动,导致整个投资 人而引起债券市场约 况发生亦化 导致。	,引起的市场实际和 各组合重新估价:	利率的变动;	
7) 甲/ 九、业组	个寿枰或某一类: <b>责比较基准</b>	改变等因素引起的 的变化引起信用风 別债券的定价偏差 E综合指数收益率-	,也就是市场失衡	h导致的投资机会等	Ť.		
上证综 A股市 贵为样 市场代	合指数以上海证 场发展趋势。该 本,按照国债发行 表性。	E券交易所上市所存 指数具有较强的公 分量加权而成。上记	有股票为样本,大 ·正性与权威性,可 证国债指数是上证	部分为中国A股市 市场代表性较强;上 E指数系列的第一员	《预夯指数,反映图	《国际东市功验体	变动状况,共
里人在 <b>+、风</b> № 本基金	经过基金托管 <i>》</i> <b>验收益特征</b> :属于具有较高剂	中,如果由于外部投 、同意后可以对业约 與期风险和预期收益	計比较基准进行這	查当调整,并在报中	整业绩比较基准员 国证监会核准后,	亞符合基金份額持公告并予以实施。	有人的利益,「
本基金 至扣不	知及在带青年	告 《及董事保证本报台 设行股份有限公司村 容不存在虚假记载					
本投资 (一)排 序号	组合报告所载数 设告期末基金资	各个存住區版记载 好据截止2013年3月 产组合情况 项目	31日,本报告所列	川财务数据未经审计 金額(元)	r.	占基金总资产的	
2	权益投资 其中:股票 基金投资			2,181,670,202 2,181,670,202		83.19 83.19	
3	固定收益投資 其中:债券 资产支持证金	<b>)</b>		268,132,065 268,132,065		10.22 10.22	
5	-	融资产 回购的买人返售金融	资产	-		-	
6 7 8	其他各项资产	合计		112,209,132 60,461,662. 2,622,473,062	52	4.28 2.31 100.00	
代码 A	农、林、牧、渔业	分类的股票投资组 行业类别	Ħ	公允价值(	ī)	占基金资产净值]	七例(%)
C D	_	及水生产和供应业		1,308,378,27 107,313,014		50.65 4.15	
F G	建筑业 批发和零售业 交通运输、仓储和	和邮政业		105,761,997 354,826,905 -		4.09 13.74	
H I J	住宿和餐饮业 信息传输,软件和 金融业	和信息技术服务业		- 169,342,182 -	.28	- 6.56 -	
K L M	房地产业 租赁和商务服务 科学研究和技术			114,800,000 - -	.00	4.44	
O P	水利、环境和公: 居民服务、修理和 教育	和其他服务业		-		-	
Q R S	卫生和社会工作 文化、体育和娱! 综合			21,247,824.	28	0.82 - -	
(三)排 序号	设告期末按公允 股票代码 600518	合计 价值占基金资产净 股票名称 事業药业	值比例大小排序 数量(股) 14,280,000	2,181,670,20 的前十名股票投资 公允价 250,471	明细 值(元)	84.45 占基金资产净值 9.70	比例(%)
2 3	600276 600511 600887	恒瑙医药 国药股份 伊利股份	6,000,000 10,123,958 4,999,921	201,660, 182,130, 158,397.	000.00	7.81 7.05 6.13	
5	000538 600697 000671	云南白药 欧亚集团 阳 光 城	1,808,744 6,623,850 7,000,000	154,647, 140,558, 114,800	612.00	5.99 5.44 4.44	
8 9 10	002311 300168 600315	海大集团 万达信息 上海家化	5,523,705 4,252,003 1,199,986	94,510,: 85,465,: 84,143,1	592.55 260.30	3.66 3.31 3.26	
(四)排 序号	设告期末按债券	品种分类的债券投 债券品种 国家债券	资组合	公允价值(元) 103,137,800.00		占基金资产净值1: 3.99	比例(%)
3		央行票据 金融债券 其中:政策性金融债		49,990,000.00 - -		1.94	
4 5 6		企业债券 企业短期融资券 中期票据		9,920,000.00 - 10,285,000.00		0.38 - 0.40	
7 8 9		可转债 其他 合计		94,799,265.40 - 268,132,065.40		3.67 - 10.38	
(五)打 序号 1	设告期末按公允 债券代码 113003	债券名 重工和	<b>ş</b> 儉	的前五名债券投资 数量(张) 487,260	明细 公允价值(元) 56,351,619.00	占基金资	产净值比例(%) 2.18
3 4	019219 1001032 110015	12国位 10央行列 石化和	(据32 行债	500,000 500,000 343,160	50,115,000.00 49,990,000.00 38,447,646.40		1.94 1.94 1.49
(七基) (七基) (七基) (大基本基期 (大基本基期 (大基本基期 (大基本基期 (大基本基期 (大基本基 (大基本基 (大基本基 (大基本基 (大基本基 (大基本基 (大基本基 (大五本 (大五五 (大五本 (大五五 (大五 (大	本报告期末未未 报告期末按公允: 本报告期末本基金 期末本基金投资 非末本基金投资 企本投资股末本期; 企本投资股末, 企本投资股末, 企本投资的。 企本投资的。 企业投资的。 企业投资的。 企业投资的。 企业投资的。 企业投资的。 企业的。 企业的。 企业的, 企。 企。 企。 企。 企。 企。 企。 企。 企。 企。	投资的股指期货交 有的股指期货持仓和 有股指期货。 行的投资政策 所股指期货。若本基 要采用流动性好、	值比例大小排名 值比例大小排名 易情况说明 叫损益明细 金投资股指期货 交易活跃的期货	的前五名权证投资 ,本基金将根据风贴 合约。	明细 金管理的原则,以系		
本基金 法律法 (九)社 (太本报	管理人将充分表 规对于基金投资 投资组合报告附 告期内基金投资	我投资时,将通过对 方虑股指期货的收益 新股指期货的投资等 注 在的前十名证券的发票中,没有投资于	益性、流动性及风 酸略另有规定的, 设行主体没有被监	险特征,通过资产的 本基金将按法律法 适管部门立案调查到	记置、品种选择, 谨 规的规定执行。 战在报告编制日前	慎进行投资,以附 一年受到公开谴责	5低投资组合的
1 存出保证金 2 应收证券消算款 3 应收股利			225 (8 (.70.) 996, 163.46 55,836,176.14				
4 5 6	应收利息 应收申购款 共他应收款			3,500,006.27 129,316.65			
7 8 9 1、报告	特維費用 其他 台计 期末持有的处于转股期的可转换债券明细		60,461,662.52				
序号 1 2 报基二米 本二、北	領券 1136 1106 期末前十名股男 全本报告期末前十 建金砂业绩 ・統裁止日为2015	代码 1015 「中存在流通受限性 一名股票中不存在的 2年12月31日,并经	债券名称 重工转债 石化转债 等况的说明 配通受限的情况。 基金杆管人复核	公允价值 56,351,61 38,447,64	9.00	占基金资产净值 2.18 1.49	
	阶段	守、诚实信用、勤免 现。投资有风险, 净值增长率①	VENT NAME OF A STATE OF			t n n	2-4
7年4月	11日至2007年12月 2008年度 2009年度	31∃ 58.30% -53.83% 84.39%	1.69% 2.33% 1.48%	32.70% -47.00% 48.51%	1.41% 1.84% 1.23%	25.60% -6.83% 35.88%	0.28% 0.49% 0.25%
		10.11%	1.22%	-8.02% -13.17%	0.92%	18.13%	0.30%
	2010年度 2011年度 2012年度	-23.76% -5.06%	0.93%	3.57%	0.71%	-8.63%	0.25%

·培明。 9、依法可以注基金财产中项支的其他使用。 (二)上述基金费用由基金管理人、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列支、法律法规另有规定时从其规

9、保企中以任志並到"中州文司为他费用。 (二)上基金费用由基金管度用基金管管及,基金性管人在注释规定的范围内按照公允的市场价格按实列文、法律法规另有规定时从其规 2. (三)基金费用计推方法。计提标准和文付方式 1.基金管理人的管理费 在通常的次下,基金管理费较前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下; H=EX平管理费率,当年天数 H为每日应计提的基金管理费数,一进基金管理人的基金社管人炎送基金管理费划付指令。经基金社管人复核后于次月首日起3个工 15内从基金财产中一次性支付结金管理人。活遇法定节度日、优度日、支付日期顺延。 2.基金社管人的托管费 在通常信页下,基金社管教授前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下; H=EX平行管费率,当年天数 H为每日应计划的法金数计可,由基金管理人的基金社管人发送基金社管费划付指令。经基金社管人复核后于次月首日起3个工 1日内从基金财产单位 1日内从基金财产单位 1日内从基金财产单位 1日内从金金财产单位 1日内从金金财产单位 1日内从金金财产单位 1日内从金金财产单位 1日内从金金财产的提供。由基金管理人的基金社会个发展发展也是设定规定,按费用支出金额支付,列人或摊人当 基金型别,列人基金费用,基金台周大级制度,从继续是有一个发生对给基金业工作关系的事项发生 1度用,列人基金费用,基金台周大级制度,从继续是有一个发生发生。 1度用于次月查查是一个发生对给基金业工作关系的事项发生 1度用,第一次是金融工作是一个发生对价。是一个发生的工作是一个发生的工作之关的事项发生 1度用等不列人基金费用,基金合同之收留所发生的信息按照常,是一个发生的工作之关的事项发生 1度用等在产品和发金分配,从基金分配,从基金对产业大会企业工作之关的事项发生 1度用作定课帐上刊签公告

国泰基金管理有限公司 二〇一三年五月二十四日