(上接B278版)

减:二、费用	8,133,554.11
1.管理人报酬	3,645,235.46
2.托管费	607,539.23
3.销售服务费	–
4.交易费用	3,478,143.17
5.利息支出	–
其中:卖出回购金融资产支出	–
6.其他费用	402,636.25
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	12,423,473.47
减:所得税费用	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	12,423,473.47

注:本基金于2013年2月19日转型,因此无上年度可比期间金额。

7.2.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)

本报告期:2013年2月19日(基金份额转换日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年2月19日至2013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	–139,550,145.18	703,554,393.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	12,423,473.47	12,423,473.47
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)	–696,669,923.55	116,887,929.51	–579,781,994.04
其中:1.基金申购款	5,404,197.65	–491,552.95	4,912,644.70
2.基金赎回款	–702,074,121.20	117,379,482.46	–584,694,638.74
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)	146,434,614.86	–10,238,742.20	136,195,872.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告从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:张琼,会计机构负责人:王嘉浩

7.2.4 报表附注

7.2.4.1基金基本情况

国泰估值优势股票型证券投资基金 (LOF)(原国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金转型)(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]第1295号《关于核准国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF),首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币842,970,017.67元(其中场内募集人民币496,056,000.00元,场外募集人民币346,914,017.67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(2010)第038号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》于2010年2月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为843,104,538.41份,其中认购资金利息折合134,520.74份,按照基金合同约定的1: 1比例份额分离为国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金优先类份额(以下简称"估值优选")421,553,139.14份和国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金进取类份额(以下简称"估值进取")421,551,399.27份。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金封闭期届满后,基金管理人按照基金合同所约定的管理估值优先和估值进取基金份额在封闭期末的基金份额净值计算规则分别计算估值优先份额和估值进取份额在封闭期末的基金份额净值,并以各自的份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值转换为同一上市开放式基金(LOF)的份额。

根据《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》,本基金的封闭期于2013年2月18日届满。经深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2013]61号)同意,本基金于2013年2月19日终止上市。自2013年2月19日起,本基金的基金名称变更为国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行、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它金融工具。封闭期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,股票投资占基金资产的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证券品种占基金资产的5%–40%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率X80%+中证全债指数收益率X20%。

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2014年3月27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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券基金投资业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2013年度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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.2.4.6 税项

根据财政部、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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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	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
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(AssicurazioniGeneraliS.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

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。

7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

7.2.4.8.2关联方报酬

7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年2月19日(基金份额转换日)2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,645,235.46
其中:支付销售机构的客户维护费	130,533.97

注:支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月末,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 1.50% / 当年天数。

7.2.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年2月19日(基金份额转换日)2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	607,539.23

注:支付基金托管人中国工商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。

7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1 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 2013年2月19日(基金份额转换日)2013年12月31日
期初持有的基金份额	20,001,800.00
期间申购/买入总份额	–
期间因拆分变动份额	–
减:期间赎回/卖出总份额	20,001,800.00
期末持有的基金份额	0
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0%

注:1.期初持有的基金份额因基金转型,由国泰优先份额10,000,900.00份以及国泰进取份额10,000,900.00份转型而来。

2. 基金管理人国泰基金管理有限公司在本年度赎回本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理,适用费率为0.5%。

7.2.4.8.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.2.4.8.5 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 2013年2月19日(基金份额转换日)2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,151,183.24	276,761.28

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002573	国电清新	2013–12–23	公告重大事项	22.17	2014–03–25	20.80	80,000.00	904,308.15	1,773,600.00	–

注:本基金截至2013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。

7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有卖出回购金融资产。

7.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有卖出回购金融资产。

7.2.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为123,578,828.36元,无属于第二层级及第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级493,004,215.07元,无第二层级及第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

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	572,148,696.58	81.17
	其中:股票	572,148,696.58	81.17
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	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	132,135,947.62	18.75
6	其他各项资产	585,186.55	0.08
7	合计	704,869,830.75	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(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	23,514,675.31	3.34
C	制造业	228,914,921.56	32.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,443,649.74	4.04
E	建筑业	120,992,377.05	17.20
F	批发和零售业	47,060,472.03	6.69
G	交通运输、仓储和邮政业	31,084,550.64	4.42
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	37,952,224.62	5.39
K	房地产业	18,442,751.52	2.62
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	21,355,186.05	3.04
N	水利、环境和公共设施管理业	14,387,888.06	2.05
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	572,148,696.58	81.32

8.1.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000651	格力电器	1,404,152	41,085,487.52	5.84
2	300197	铁汉生态	736,293	31,248,274.92	4.44
3	601006	大秦铁路	3,924,817	31,084,550.64	4.42
4	002375	亚厦股份	1,097,587	29,305,572.90	4.17
5	600011	华能国际	4,238,994	28,443,649.74	4.04
6	002081	金 螳 螂	657,865	27,169,824.50	3.86
7	002140	东华科技	875,822	23,603,402.90	3.35
8	600157	永泰能源	1,743,119	23,514,675.31	3.34
9	600060	海信电器	1,874,724	21,859,281.84	3.11
10	002398	建研集团	937,865	21,355,186.05	3.04

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文

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	002375	亚厦股份	28,887,580.32	4.45
2	002081	金 螳 螂	27,592,855.14	4.25
3	000651	格力电器	22,977,271.79	3.54
4	600016	民生银行	19,767,032.74	3.05
5	000521	美菱电器	19,561,374.76	3.02
6	600015	华夏银行	19,201,268.96	2.96
7	600201	金宇集团	16,738,998.66	2.58
8	600376	首开股份	13,477,755.37	2.08
9	600690	青岛海尔	13,321,706.03	2.05
10	002250	联化科技	13,269,501.83	2.05
11	000861	海印股份	9,774,065.06	1.51
12	600587	新华医疗	9,743,237.32	1.50
13	600011	华能国际	9,700,657.32	1.50
14	600702	沱牌舍得	9,696,541.83	1.49
15	600157	永泰能源	7,925,569.30	1.22
16	000705	浙江震元	6,810,298.78	1.05
17	600055	华润万东	6,722,766.18	1.04
18	002236	大华股份	6,605,336.90	1.02
19	000858	五 粮 液	6,575,740.35	1.01
20	002398	建研集团	5,495,927.47	0.85

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	601333	广深铁路	29,436,470.03	4.54
2	002226	江南化工	23,287,674.96	3.59
3	002567	唐人神	22,884,525.12	3.53
4	600292	中电远达	19,369,267.42	2.99
5	600388	龙净环保	18,169,451.29	2.80
6	000543	皖能电力	17,530,793.47	2.70
7	601117	中国化学	13,209,449.60	2.04
8	600376	首开股份	11,783,100.56	1.82
9	600231	凌钢股份	11,580,710.94	1.79
10	000778	新兴铸管	11,490,138.32	1.77
11	600581	八一钢铁	10,948,121.11	1.69
12	600157	永泰能源	10,227,334.93	1.58
13	600967	北方创业	8,177,805.10	1.26
14	600016	民生银行	6,882,950.04	1.06
15	002573	国电清新	6,565,663.62	1.01
16	002628	成都路桥	6,464,360.22	1.00
17	000858	五 粮 液	6,433,108.15	0.99
18	002029	七 匹 狼	5,278,995.85	0.81
19	002277	友阿股份	5,254,782.95	0.81
20	600060	海信电器	4,113,367.15	0.63

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

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	277,176,260.70
卖出股票的收入(成交)总额	255,213,494.65

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。

8.1.5期末按债券品种分类的债券投资组合

国泰估值优势分级封闭报告期末未持有债券。

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

国泰估值优势分级封闭报告期末未持有债券。

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

国泰估值优势分级封闭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

国泰估值优势分级封闭报告期末未持有权证。

8.1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

国泰估值优势分级封闭报告期末未持有股指期货。

8.1.9.2本基金投资股指期货的投资政策

国泰估值优势分级封闭报告期末投资股指期货。

8.1.10投资组合报告附注

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 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。

8.1.10.3 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	418,208.92
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	166,977.63
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	585,186.55

8.1.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

国泰估值优势分级封闭报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.1.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

国泰估值优势分级封闭报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.2国泰估值优势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	123,578,828.36	90.26
	其中:股票	123,578,828.36	90.26
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	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	11,276,792.25	8.24
6	其他各项资产	2,062,731.29	1.51
7	合计	136,918,351.90	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	99,259,187.37	72.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	5,659,716.84	4.16
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,599,580.40	9.25
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	4,286,743.75	3.15
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,773,600.00	1.30
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	123,578,828.36	90.74

8.2.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600872	中炬高新	1,009,269	11,475,388.53	8.43
2	600518	康美药业	520,000	9,360,000.00	6.87
3	600600	青岛啤酒	180,000	8,811,000.00	6.47
4	600887	伊利股份	220,000	8,597,600.00	6.31
5	600587	新华医疗	120,000	8,389,200.00	6.16
6	600276	恒瑞医药	199,860	7,590,682.80	5.57
7	601766	中国南车	1,470,000	7,364,700.00	5.41
8	600597	光明乳业	300,000	6,660,000.00	4.89
9	000895	双汇发展	138,453	6,518,367.24	4.79
10	002410	广联达	200,000	6,300,000.00	4.63

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

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	600016	民生银行	22,738,009.84	16.70
2	000651	格力电器	20,094,384.38	14.75
3	601117	中国化学	19,739,726.84	14.49
4	002219	恒康医疗	18,905,941.53	13.88
5	002367	康力电梯	17,850,784.31	13.11
6	002571	德力股份	17,028,913.70	12.50
7	000400	许继电气	16,776,801.11	12.32
8	600518	康美药业	15,730,703.71	11.55
9	002081	金 螳 螂	15,711,199.11	11.54
10	600720	祁连山	15,176,128.84	11.14
11	600967	北方创业	15,055,793.94	11.05
12	601965	中国汽研	14,808,192.63	10.87
13	002565	上海绿新	14,714,998.66	10.80
14	600887	伊利股份	14,567,107.60	10.70
15	002664	信质电机	14,461,080.10	10.62
16	600199	金种子酒	14,051,909.98	10.32
17	002450	康得新	13,934,079.69	10.23
18	002509	天广消防	13,904,975.00	10.21
19	601633	长城汽车	13,714,914.14	10.07
20	000705	浙江震元	13,640,824.69	10.02
21	002567	唐人神	13,572,393.83	9.97
22	600801	华新水泥	12,696,154.71	9.32
23	002273	水晶光电	12,500,358.31	9.18
24	600060	海信电器	12,231,242.77	8.98
25	600587	新华医疗	12,051,193.66	8.85
26	600585	海螺水泥	11,299,736.52	8.30
27	601601	中国太保	10,819,823.40	7.94
28	300216	千山药机	10,801,780.62	7.93
29	000100	TCL 集团	10,684,677.00	7.85
30	000521	美菱电器	10,180,510.17	7.47
31	601006	大秦铁路	10,180,104.33	7.47
32	600690	青岛海尔	10,177,026.69	7.47
33	600015	华夏银行	10,174,064.96	7.47
34	600197	伊力特	10,016,979.66	7.35
35	600583	海油工程	9,986,293.76	7.33
36	600820	隧道股份	9,926,986.58	7.29
37	600315	上海家化	9,852,566.33	7.23
38	002583	海能达	9,829,605.56	7.22
39	002364	中恒电气	9,802,582.93	7.20
40	002277	友阿股份	9,498,005.16	6.97
41	600292	中电远达	9,405,381.80	6.91
42	002284	亚太股份	9,045,451.63	6.64
43	000888	峨眉山A	9,021,372.96	6.62
44	600011	华能国际	8,819,560.23	6.48
45	000848	承德露露	8,729,932.30	6.41
46	600872	中炬高新	8,677,965.47	6.37
47	002353	杰瑞股份	8,421,881.97	6.18
48	002573	国电清新	7,947,136.42	5.84
49	600036	招商银行	7,816,090.00	5.74
50	002140	东华科技	7,673,343.70	5.63
51	600597	光明乳业	7,540,684.63	5.54
52	600600	青岛啤酒	7,477,812.68	5.49
53	002035	华帝股份	7,463,614.32	5.48
54	600702	沱牌舍得	6,898,707.60	5.07
55	002375	亚厦股份	6,815,363.14	5.00
56	300197	铁汉生态	6,785,844.47	4.98
57	002250	联化科技	6,781,697.51	4.98
58	000895	双汇发展	6,780,430.15	4.98
59	601766	中国南车	6,712,715.00	4.93
60	300146	汤臣倍健	6,563,064.41	4.82
61	600276	恒瑞医药	6,417,868.73	4.71
62	002410	广联达	6,211,502.67	4.56
63	300274	阳光电源	6,134,669.23	4.50
64	300188	美亚柏科	6,108,798.35	4.49
65	601299	中国北车	6,073,300.00	4.46
66	000553	沙隆达A	6,029,150.92	4.43
67	002042	华孚色纺	5,943,741.99	4.36
68	600000	浦发银行	5,868,381.89	4.31
69	002313	日海通讯	5,514,981.29	4.05
70	600511	国药股份	5,432,341.12	3.99
71	300332	天壕节能	5,317,018.34	3.90
72	000063	中兴通讯	5,253,915.00	3.86
73	600176	中国玻纤	4,855,393.90	3.57
74	300074	华平股份	4,750,947.51	3.49
75	002400	省广股份	4,388,589.74	3.22
76	002551	尚荣医疗	4,355,008.35	3.20
77	000716	南方食品	3,987,883.06	2.93
78	300228	富瑞特装	3,875,138.60	2.85
79	002216	三全食品	3,808,916.13	2.80
80	600837	海通证券	3,651,441.00	2.68
81	600157	永泰能源	3,627,393.60	2.66
82	603000	人民网	3,609,188.00	2.65
83	600201	金宇集团	3,543,249.74	2.60
84	600267	海正药业	3,437,206.27	2.52
85	600055	华润万东	3,391,130.91	2.49
86	002241	歌尔声学	3,359,593.70	2.47
87	002572	索菲亚	3,340,584.00	2.45
88	600009	上海机场	3,086,977.18	2.27

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	000651	格力电器	56,671,408.38	41.61
2	002081	金 螳 螂	42,272,986.04	31.04
3	601006	大秦铁路	39,950,320.19	29.33
4	600011	华能国际	37,462,625.16	27.51
5	600016	民生银行	36,994,324.83	27.16
6	300197	铁汉生态	36,480,678.23	26.79
7	002375	亚厦股份	36,384,111.58	26.71
8	600060	海信电器	34,482,368.21	25.32
9	601117	中国化学	32,271,713.88	23.70
10	002140	东华科技	30,725,454.42	22.56
11	600201	金宇集团	28,279,471.82	20.76
12	002573	国电清新	28,158,745.60	20.68
13	600690	青岛海尔	27,977,554.05	20.54
14	002277	友阿股份	27,674,487.66	20.32
15	600015	华夏银行	27,402,837.47	20.12
16	000521	美菱电器	26,975,183.78	19.81
17	002250	联化科技	22,347,099.53	16.41
18	002367	康力电梯	21,975,328.21	16.14
19	600587	新华医疗	21,812,710.36	16.02
20	000400	许继电气	21,743,508.02	15.96
21	000705	浙江震元	21,439,105.80	15.74
22	002219	独 一 味	21,436,333.50	15.74
23	002571	德力股份	20,790,711.33	15.27
24	002398	建研集团	20,596,129.16	15.12
25	002035	华帝股份	20,327,003.30	14.92
26	002029	七 匹 狼	19,159,351.16	14.07
27	002565	上海绿新	18,965,103.90	13.92
28	002251	步 步 高	18,952,580.10	13.92
29	600157	永泰能源	18,535,103.12	13.61
30	600967	北方创业	18,371,518.88	13.49
31	601965	中国汽研	17,365,696.62	12.75
32	000861	海印股份	17,072,818.54	12.54
33	601633	长城汽车	16,616,069.10	12.20
34	002450	康得新	16,569,892.41	12.17
35	002664	信质电机	13,640,255.44	10.02
36	002273	水晶光电	13,580,889.07	9.97
37	002509	天广消防	13,500,355.50	9.91
38	600702	沱牌舍得	13,238,557.17	9.72
39	600720	祁连山	12,989,320.68	9.54
40	603001	奥康国际	12,839,856.57	9.43
41	600801	华新水泥	12,399,795.40	9.10
42	002567	唐人神	12,028,887.92	8.83
43	600583	海油工程	11,691,348.45	8.58
44	601601	中国太保	11,119,604.86	8.16
45	600055	华润万东	11,048,882.65	8.11
46	000100	TCL 集团	10,627,462.45	7.80
47	600199	金种子酒	10,556,923.03	7.75
48	600585	海螺水泥	10,540,118.25	7.74
49	600315	上海家化	10,148,999.87	7.45
50	600292	中电远达	9,711,227.20	7.13
51	002364	中恒电气	9,393,706.08	6.90
52	002583	海能达	9,307,938.77	6.83
53	002353	杰瑞股份	9,137,182.14	6.71
54	600820	隧道股份	8,974,374.51	6.59
55	600197	伊力特	8,912,932.31	6.54
56	600066	宇通客车	8,700,527.63	6.39
57	300216	千山药机	8,671,289.70	6.37
58	000888	峨眉山A	8,659,939.17	6.36
59	000848	承德露露	8,466,370.38	6.22
60	002284	亚太股份	8,421,927.90	6.18
61	002236	大华股份	7,569,135.05	5.56
62	600887	伊利股份	7,347,639.31	5.39
63	000553	沙隆达A	7,191,672.61	5.28
64	300146	汤臣倍健	6,896,339.25	5.06
65	600036	招商银行	6,381,728.79	4.69
66	000063	中兴通讯	6,320,434.40	4.64
67	300274	阳光电源	6,200,380.62	4.55
68	002313	日海通讯	5,739,232.49	4.21
69	002042	华孚色纺	5,557,421.66	4.08
70	300074	华平股份	5,512,573.90	4.05
71	600000	浦发银行	5,267,500.00	3.87
72	300332	天壕节能	5,024,784.32	3.69
73	600518	康美药业	4,988,886.08	3.66
74	600176	中国玻纤	4,229,540.91	3.11
75	603000	人民网	4,047,680.82	2.97
76	600837	海通证券	3,618,030.99	2.66
77	000716	南方食品	3,400,668.19	2.50
78	600267	海正药业	3,352,954.00	2.46
79	300228	富瑞特装	2,999,570.25	2.20
80	600009	上海机场	2,937,702.77	2.16
81	002241	歌尔声学	2,922,122.60	2.15
82	600018	上港集团	2,891,103.34	2.12

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

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	835,934,852.64
卖出股票的收入(成交)总额	1,300,001,479.63

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。

8.2.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

8.2.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

8.2.11 投资组合报告附注

8.2.11.1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。

8.2.11.2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。

8.2.11.3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	175,832.36
2	应收证券清算款	1,877,917.31
3	应收股利	–
4	应收利息	2,476.24
5	应收申购款	6,505.38
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,062,731.29

8.2.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.2.11.5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。

§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国泰估值优势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
6,588.00	22,223.94	17,864,026.91	12.20%	128,547,284.93	87.80%

9.1.2 国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

份额单位:份

份额级别	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
国泰优先	5,328	79,120.33	267,685,318.46	63.50%	153,867,820.68	36.50%
国泰进取	12,818	32,887.46	48,961,379.45	11.61%	372,590,019.82	88.39%
合计	18,146	46,462.28	316,646,697.91	37.56%	526,457,840.50	62.44%

注:以上信息中持有人场内数据由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

9.2期末上市基金前十名持有人

9.2.1 国泰估值优势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	五矿国际信托有限公司	16,459,053.00	24.44%
2	李媛芳	1,000,150.00	1.48%
3	张健	990,448.00	1.47%
4	梁铁岩	745,139.00	1.11%
5	上海新业出租汽车服务有限公司	701,683.00	1.04%
6	莘县源源化工有限公司	672,483.00	1.00%
7	白念祥	596,732.00	0.89%
8	阎冬梅	566,895.00	0.84%
9	冯欢	447,549.00	0.66%
10	勾大成	438,325.00	0.65%

注:上述份额均为场内份额,持有人均为场内持有人。

9.2.2 国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

国泰优先

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	55,816,218.00	15.62%
2	天安人寿保险股份有限公司	33,843,961.00	9.47%
3	东航集团财务有限责任公司	32,967,516.00	9.23%
4	中国人寿保险(集团)公司	25,002,125.00	7.00%
5	安邦人寿保险股份有限公司–保守型投资组合	18,100,040.00	5.07%
6	安信证券–中信–安信理财3号宏观领航集合资产管理计划	10,000,000.00	2.80%
7	中国银行股份有限公司企业年金计划–中国农业银行	9,521,000.00	2.66%
8	中国大唐集团财务有限公司	7,000,000.00	1.96%
9	国信证券股份有限公司	6,720,000.00	1.88%
10	天安财产保险股份有限公司	6,680,657.00	1.87%

注:以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的前一百名持有人名册编制。

国泰进取

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	五矿国际信托有限公司	27,581,988.00	7.70%
2	李政良	5,343,770.00	1.49%
3	廖昌清	5,105,788.00	1.43%
4	中融国际信托有限公司–中融增强15号	4,111,100.00	1.15%
5	汤百里	3,574,650.00	1.00%
6	李八一	3,414,801.00	0.95%
7	万山	2,880,000.00	0.80%
8	洪荷	2,500,000.00	0.70%
9	孙妍	2,500,000.00	0.70%
10	莘县源源化工有限公司	2,300,000.00	0.64%

注:以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的前一百名持有人名册编制。

9.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.3.1 国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理及其他基金从业人员未持有本基金。

9.3.2 国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰优先	98,880.73	0.02%
	国泰进取	98,880.73	0.02%
	合计	197,761.46	0.02%

国泰优先:

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含);

国泰进取:

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含)。

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金转型日(2013年2月19日)基金份额总额	843,104,538.41
本报告期期初基金份额总额	843,104,538.41
本报告期基金总申购份额	5,403,207.48
减:本报告期基金总赎回份额	702,096,434.05
本报告期基金拆分变动份额	
本报告期期末基金份额总额	146,411,311.84

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

报告期内,本基金无基金份额持有人大会决议。

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:

2013年3月6日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》,经本基金管理人第五届董事会第二十四次会议审议通过,梁之平先生不再担任公司副总经理,转国泰基金管理有限公司专业子公司任职。国泰基金管理有限公司专业子公司国泰元鑫资产管理公司已于2013年5月完成工商注册登记,取得营业执照。

2013年6月25日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》,经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过,李志坚先生出任公司副总经理。

2013年9月18日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》,经本基金管理人第五届董事会第三十一次会议审议通过,田昆先生不再担任公司副总经理。

2013年11月1日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》,经本基金管理人第五届董事会第三十三次会议审议通过,贺燕萍女士出任公司副总经理。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 60,000.00 元,目前的审计机构已提供审计服务的年限为4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

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国泰估值优势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	
中金公司	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
爱建信托	1	–	–	–	–	本期退租
申银万国	2	944,730,698.48	44.23%	848,599.08	43.90%	–
光大证券	1	279,132,810.97	13.07%	254,121.68	13.15%	–
西南证券	1	263,568,301.71	12.34%	239,953.13	12.41%	–
上海证券	1	167,409,596.81	7.84%	152,407.73	7.89%	–
银河证券	2	152,010,722.35	7.12%	138,389.31	7.16%	–
华泰证券	1	198,604,428.14	9.30%	180,810.36	9.35%	–
国信证券	2	8,410,706.06	0.39%	7,442.78	0.39%	–
海通证券	1	66,160,094.51	3.10%	60,232.67	3.12%	–
金元证券	1	28,983,779.92	1.36%	26,386.78	1.37%	本期新增
国泰君安	2	22,017,372.40	1.03%	20,044.57	1.04%	–
民族证券	1	4,907,820.92	0.23%	4,468.12	0.23%	–

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)公司具有较强的研究能力,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债券投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	债券交易		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	
中金公司	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
爱建信托	1	–	–	–	–	本期退租
申银万国	2	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
上海证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	2	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
金元证券	1	–	–	–	–	本期新增
国泰君安	2	–	–	–	–	–
民族证券	1	–	–	–	–	–

11.7.2国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

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	2	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	2	75,494,733.78	14.18%	66,805.23	13.98%	–
光大证券	1	145,471,084.42	27.32%	132,436.11	27.71%	–
银河证券	2	53,255,492.02	10.00%	48,483.55	10.14%	–
申银万国	2	186,701,459.69	35.07%	165,212.81	34.56%	–
民族证券	1	–	–	–	–	–
上海证券	1	71,466,985.44	13.42%	65,063.75	13.61%	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
爱建信托	1	–	–	–	–	–
华泰证券	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)公司具有较强的研究能力,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债券投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	债券交易		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	2	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	2	–	–	–	–	–
申银万国	2	–	–	–	–	–
民族证券	1	–	–	–	–	–
上海证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
爱建信托	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–