

国泰事件驱动策略股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

1.1 重要提示
基金管理人国泰基金及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责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	国泰事件驱动股票
基金代码	000023
交易代码	000023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月17日
报告期末基金份额总额	231,550.678,000份

投资目标
在有效控制风险的前提下,通过积极主动的投资策略,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略
本基金通过定性分析和定量分析相结合的方法,在充分研究宏观经济、行业、公司基本面和估值的基础上,选择具有良好发展前景的个股,并构建投资组合。本基金采取自上而下和自下而上相结合的策略,在充分研究宏观经济、行业、公司基本面和估值的基础上,选择具有良好发展前景的个股,并构建投资组合。

业绩比较基准
沪深300指数收益率×80%+中证500指数收益率×20%

风险收益特征
本基金为股票型基金,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的品种。

基金管理人 国泰基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 2014年1月1日至2014年3月31日	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-5,200,012.71	
2.本期利润	-40,386,376.41	
3.本期基金份额净值增长率	-1.57%	
4.期末基金份额净值	312.079,9245	
5.期末基金份额净值增长率	1.348%	

注: 1.本基金采用收益法计提基金管理人报酬、托管费、其他收入,不含公允价值变动收益扣除相关费用后的余额,本期费用为本期已实现收益加; 2.本期基金份额净值增长率是指基金份额净值增长率,计算方法为: (期末基金份额净值/期初基金份额净值)^(1/报告期天数)-1,其中,基金份额净值是指基金份额净值,计算方法为: 基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。
3.2 基金业绩表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率	业绩比较基准收益 率	业绩比较基准收 益率标准差	①-③	②-④	
过去三个月	-1.57%	1.66%	-5.82%	0.09%	-1.91%	0.71%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
国泰事件驱动股票型证券投资基金自基金合同生效以来,本基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较,请参见本报告附件国泰事件驱动股票型证券投资基金自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较图。
注:本基金自2014年1月1日起,本基金在六个时间段内,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金管理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.2 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.3 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.4 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.5 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.6 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.7 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.8 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.9 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.10 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.11 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.12 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.13 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.14 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.15 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.16 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.17 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.18 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.19 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.20 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.21 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.22 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.23 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.24 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.25 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

4.26 基金经理人 基金经理人 简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王凯	基金经理	2011-08-17	13	瑞士银行、CFA,曾任平安资产管理公司、2009年1月加入国泰基金管理有限公司,历任国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、国泰基金专户基金管理部副经理、2011年8月加入国泰基金专户基金管理部担任基金经理,2011年8月17日正式担任本基金基金经理,2014年3月31日仍在任。 2011年8月17日至2014年3月31日止

基金投资组合

1 基金投资组合	-	-
2 基金投资组合	-	-
3 基金投资组合	-	-
4 基金投资组合	-	-
5 基金投资组合	-	-
6 基金投资组合	6,262,060.55	2.00
7 基金投资组合	5,006,601.31	1.61
8 基金投资组合	313,398,782.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	227,727,887.67	72.97
C	建筑业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	5,543,290.62	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	21,700,818.24	6.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,208,424.63	6.41
J	金融业	20,808,424.63	6.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,791,930.00	3.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	建筑业	-	-
P	建筑业	-	-
Q	建筑业	-	-
R	建筑业	-	-
S	综合	284,776,881.17	91.25

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600877	新华医疗	280,000	23,391,200.00	7.5
2	300124	汇川技术	300,000	21,300,000.00	6.83
3	600855	宏发股份	900,000	20,808,000.00	6.44
4	2614	蒙发利	684,751	16,436,227.20	5.97
5	2583	杰赛股份	292,000	17,578,400.00	5.67
6	2242	九鼎股份	1,453,294	16,436,755.14	5.23
7	600997	新华乳业	917,488	15,377,065.48	4.93
8	600486	金明机电	785,900	11,607,296.00	3.55
9	118805	中信国安	488,700	10,733,762.50	3.44
10	600855	宏发股份	550,000	10,982,000.00	3.39

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	118805	中信国安	17,000,000.00	5.45
2	118805	中信国安	-	-
3	118805	中信国安	-	-
4	118805	中信国安	-	-
5	118805	中信国安	-	-
6	118805	中信国安	-	-
7	118805	中信国安	-	-
8	118805	中信国安	-	-
9	118805	中信国安	-	-
10	118805	中信国安	-	-

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	品种名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1407	13,000	17,000,000.00	5.45
2	IF1407	13,000	17,000,000.00	5.45
3	IF1407	13,000	17,000,000.00	5.45
4	IF1407	13,000	17,000,000.00	5.45
5	IF1407	13,000	17,000,000.00	5.45

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	品种名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1407	13,000	17,000,000.00	5.45</