### 纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

报告送出日期:二〇一五年一月:					
別及连带责任。 基金托管人中国建设银行股份有 种内容,保证复核内容不存在虚假记。 基金管理人承诺以诚实信用,勤	E本报告所載資料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。并对其内容的真实性、准确性和完整性补 可限公司根据本基金合同规定于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标。净值表现和投资组合报行 载、误导性矫正或者重新运调 越受到的原则设置和运用基金资产但不保证基金一定盈利。 未表现、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设明书。				
基金简称 国泰纳斯达克100 (DII-ETF )					
基金主代码	513100				
交易代码	513100				
基金运作方式	交易型开放式				
基金合同生效日	2013年4月25日				
报告期末基金份额总额	49,622,120.00分				
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。				
	本基金主要采取完全复制策略。即按照标的指数的成份股单成及其权重构建基金股票 投资组合,并根据标价指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因标解, 份股长期停率。成份股权重由于自由遗憾发生变化。成份股之间行				

投资目标	緊密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。		
投資網路	本基企主要采款企会短期编码。即使联系的销售的成份股标成及其只取能建基金便规 投资组合。并根据标的指数成价税及技程或即步步进行标证。但我特殊机会 份投长期除牌。成份按定生变更。成份接收距由于自由流通量处生变化、成份投公司行 为、市场流池性不足等,异效本基金管理人类比较根据的消费地度及权量进行到 整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量除近期骤以减速 在正常市场情况下,基金量的风险控制中压线进程上的翻察编度度的绝对值不起 过2.2%,干燥器设施不提过2%。即因外的背景域编现规则继续或其他很常导致或器构成 度和视路线差相过上途的温度。基金管从企业保存增措推查股票编度度,则需从是 进步力。本金金基于形态性管理的需要,将投资于与本基金有相近的投资目标,投资 销售。且以本金金的条约的数分分类形的物理如《基金·包括FFF》则形,是价 销售。且以本金金的条约的数分处类形的的整型、基本金包括下的,则形,或 设备。并未全金额之上,从即解依据就是表本,本金包接下的。则可 按例,并未全金额之一,从可能从为处理的。 设备,是一个工程,是有 是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是 位用于规模的资金金额产生。从即解依据就是表本,本金是使货产金额产品。以即解依据就是发水,本金是使货产金额产品。因		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率 经汇率调整后的总收益指数收益率)。本基金的标的指数为纳斯达克100指数 (Nasdaq-100 Index )。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期风险与收益离于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复额法据基际价指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的服务所能的风险或选择证。		
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		
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company		
境外资产托管人中文名称	美国道富银行		
3.1 主要财务指标	§ 3 主要财务指标和基金净值表现		
3.1 T3CM 21 H/0	单位:人民市		
-h-medil Life Ac-Ar-	招告期		

	年12八尺日
主要财务指标	报告期 2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	6,329,782.6
2.本期利润	3,476,610.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0584
4.期末基金资产净值	68,471,088.70
5.期末基金份额净值	1.380
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投	·资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已

3.2 基金净值表现 3.2.1本报告期基金 阶段	份额争值增长率及 净值增长率①	净值增长率标准	基准收益率的比较 业绩比较基准收	业绩比较基准收	(D=(3)	(A) (F)
BIEZ	中国和大学(1)	差②	益率(3)	益率标准差④	0-0	2-4
过去三个月 3.37% 0.97% 4.33% 0.99% -0.96% -0.02%						
注:同期业绩比较达 3.2.2 自基金合同。	主效以来基金累计值	纳斯达克100? 《计净值增长率与』	交易型开放式指数i	的历史走势对比图		



姓名	职务	任本基金的基	<b>&amp;</b> 金经理期限	证券从业年限	说明
姓名	4X.95	任职日期	离任日期	UESFANUET-PR	0.094
徐皓	本基金金经中小板上 在	2014-11-04	-	<b>7</b> 年	部上研究生、FRM、注射增金处验分析 的 信等一级,这世时中中国上面解析 运行资产性管部、2010年3月加盟国金 金人任高级及坚理。2011年3月加盟国金 多位,1980年3月1日,1981年3月1日,1981年3日 2014年1月担任上世:1980金融交易更升 这大海牧业等处据金、国本上面1982年3 1982年2011年5十四、0018世纪李秋敦 金的报金基金及图市产产等0018世纪李秋敦 金的报金基金及图市产产等0018世纪李秋敦 金的报金基金罗图市公开始业务投资基 电报关基金及图市产产等0018世纪李秋 对太月报收季处资基金等短期。2010年1月起任中小····································
崔涛	本基金的基金经理	2013-04-25	2014-11-04	10年	每上研究生,曾巴联于Paloma Patress 资产管理之项,高键银行 组约 2,000 年6月加入国泰基金管理有限公司,任 有效是一个企业,但是一个企业,是一个企业, 约1生品投资,指收加金和肛门的投资对 交见及境中的股份资明了。2011年5月 至2014年11月任国泰纳斯达克(00拾版 业界投资基金的基金经理。2011年5月 至2014年11月在国泰大宗 前品配置业券投资基金(00 的场金经 是一、2013年4月至2014年11月兼任国泰大宗 前品配置业券投资基金(00 的场金经 是一、2013年4月至2014年11月兼任国泰大宗 会的基金经理。2013年4月至2014年11月第七日

劃實方指統記則 "格殊"在學表計。在學校改基金法》,概念管理公司公平交易制度指导電視。跨有关法律法規約報定 約定本電線末信用。動態享景。最大限度保护投资人合法权益等限制管理转运用基金资产。在控制风险 或指导期本基金宣作台选合规。发生指著基金的编制有人种趋的方,本发生消费金质,提供市场和 或擴展計。消輸、完整本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产,投资组合与公司资产之间严格分 让空港升速量分享度,规范定年,格心管理和能产价处准,有效保赖设度从合金设产的

4.3.1 公平交易制度的执行情况 本程是明庆未基金管理人等的专项,但是是一个企业,但是一个企业,但是一个企业,但是一个企业,但是一个企业, 程对各环节的投资风险的管理风险进行有效控制。一格控制不同投资组合之间的周日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送 的同日反向交易,确保公平均均等理的所有基金和投资组合,以市场充租输送行为。

# 2014 第四季度 报告

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析
2014年第四季度美股仍震荡上行,但波动加大,前期对俄罗斯的表态及制裁对市场情绪有所影响。经过10月份的V形调整后,美国纳指、柯
普、道琼斯3大股指均再创新高、美元指数持续上涨于年末突破91点、原油价格持续下跌。经济数据从10月FOMC会议以来一直稳健.11月制造
业产生加速增长,表明经济增长势头强劲,Q3GDP由初值3.9%大幅上修至5.0%,较大程度提升投资者风险偏好。
作为完全跟踪标的指数的被动型基金。本基金避免了不必要的主动操作。减少了交易冲击成本,并通过精细化管理确保基金组合与指数
权重基本一致。
本报告期内如统一以美元资产计价计算本基金日均跟踪误差为0.061%对应年化跟踪误差为0.934%符合基金合同预定的日均误差不
超过0.2%、年跟踪误差不超过2%的限制。跟踪误差主要来源为申购赎回的冲击。
4.4.2报告期内基金的业绩表现
本基金在2014年第四季度的净值增长率为3.37%。同期业绩比较基准收益率为4.33%(注:同期业绩比较基准以人民币计价。)。
4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
《公开年初的雪菜调整》)

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	
经过年初的震荡调整以后,四季度美股重新回到了上涨的态势,在持续向好的宏观经济数据和强劲的公司盈利推动下利	急步上行。从基本
面的角度,并没有太多不利的因素。各项经济数据均显示,在美联储强力的货币政策刺激下,美国经济已经走上了稳健复苏的	轨道,接下来市场
最关注的就是美联储将何时、以何种方式退出超级宽松的货币政策。从历史表现来看,结束宽松进人加息周期时,往往会引	
荡、因此如何平稳、缓慢的退出这场史无前例的宽松、避免对经济和市场造成冲击,是美联储面临的最大难题,也是短期内最	大的市场风险所
在。因此需要紧密关注FOMC会议态度及措辞的变化。	
美股上涨过程是不断消化利空、恢复信心、长期稳健向上的过程,未来美股涨跌幅最核心的决定因素是美国经济数据	
向,取决于美国实体经济复苏是否得到验证。后QE时代的资本回流、完美的基本面以及美国以外的美经济体不稳定政治经	
响下将开启一个美元的时代,这意味着大部分货币对美元都将走弱。基本面良好以及低通胀环境对股票市场极为有利,并且	推动美股的动能
中仅有低利率会在未来消失。构成了未来全球资产选择中的一大主题——美股和美元强势基本面的主导。高配美股将是未	
配置。未来三年间我们认为美国经济将极大概率走向复苏周期。国泰纳指 100是国内首只跟踪海外指数的QDII产品,汇聚了	
核心竞争力、拥有革命性技术的公司、建议投资者积极配置国泰纳斯达克100(ODII-ETF 513100)、并充分享受二级市场交易的	)便利。
§ 5 投资组合报告	
5.1 报告期末基金资产组合情况	
上北今江	282年651年61

序号	1	<b></b>	<b>±</b>	:額 (人民币元)	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资			62,020,202.89	89.7
	其中:普通股			89.7	
	存托凭证			-	
	优先股			-	
	房地产信托			_	
2	基金投资			1,729,260.00	2.5
3	固定收益投资			-	
	其中:债券			-	
	资产支持证券			-	
4	金融衍生品投资			-	
	其中:远期			-	
	期货			_	
	期权			_	
	权证				
5	买人返售金融资产			_	
	其中:买新式回购的买人返售	金融资产	=		
6	货币市场工具			_	
7	银行存款和结算备付金合计			5,363,692,38	7.
8	其他资产			23,241.78	0.
9	合计			69,136,397.05	100.
5.2 报信	占期末在各个国家(地区)证券市场	的股票及存托凭证投资分布			
	国家 他区)	公允价值(人民币元)		占基金资产	净值比例(%)
包		62,0	020,202.89		90.5
	合计	62,0	020,202.89		90.5
5.3 报台	与期末按行业分类的股票及存托!				
	行业类别	公允价值(人民币元)		占基金资产	争值比例 66)
息技术	·	35,388,735.94			51.
必需消費	费品		9,548.88		17.
(健		9,58	7,175.80		14.
需消费品	T	2,85	54,749.08		4.
M/L		1,48	9,193.26		2.
信服务		50	8.813.39		0.0

注:0	注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。 5.4 报告期末按公允价值占基金资产争值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细								
序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在 证市 場場	所属国家 他区)	数量 段)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净 值比例 66)	
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯 达克	美国	12,200	8,240,065.68	12.03	
2	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯 达克	美国	16,700	4,746,600.09	6.93	
3	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯 达克	美国	700	2,254,729.12	3.29	
4	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯 达克	美国	9,700	2,153,967.55	3.15	
5	FACEBOOK INC-A	脸书	FB US	纳斯 达克	美国	4,500	2,148,319.71	3.14	
6	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科 学公司	GILD US	纳斯 达克	美国	3,600	2,076,396.98	3.03	
7	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯 达克	美国	600	1,948,265.12	2.85	
8	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯 达克	美国	1,000	1,899,031.65	2.77	
9	CISCO SYSTEMS INC	思科公司	CSCO US	纳斯	美国	10,200	1,736,039.85	2.54	

10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克	美国	4,-
本基 5.6折 本基 5.7折 本基 5.8	报告期末按债券信用等级分类 金本报告期末末持有债券。 经告期末按公允价值占基金资 经告期末按公允价值占基金资 金本报告期末末持有债券。 金金本报告期末末持有资产支持 报告期末按公允价值占基金资 《金本报告期末	产净值比例 产净值比例 寺证券。 (产净值比例	大小排序的前五  大小排序的前十	名资产	支持证券技	

5.9报告期	]末按公允价值占基金资产净值比例为	小排序的前一	十名悲金投资	明细		
序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 66)
1	PROSHARES ULTRAPRO QQQ ETF基金 开放式 ProShares Trust 1.729,260.00 2.5					2.53
5.10.1 本 5.10.2基金 5.10.3其作	5.10 及實體合稅基階柱 5.10 未准告期末基金股務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。 5.10 基本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。 5.10.3基本投资的资产构成					
序号				金額 (人)	<b>元</b> 币元)	
1	1 存出保证金					_
2	应收证券法管券					

序号	名称	金額 (人民币元 )
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	=
3	应收股利	22,101.03
4	应收利息	1,140.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	=
8	其他	-
9	合计	23,241.78
5.10.4报 本基金2	告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 体报告期末未持有可转换债券。	

5.10.5 报告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。 §6 开放	式基金份额变动 单位:
报告期期初基金份额总额	64,622,120.00
报告期基金总申购份额	7,000,000.00
减:报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	=
40 A- Bullo III 4F A M 46C M 46C	10 (22 120 00

\$ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 本报告期内,本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金、截止本报告期末。本金管理人未持有本基金 

2 计初速点 基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层,基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

## 国泰事件驱动策略股票型证券投资基金

### 2014 第四季度 报告

MUZTUH:	C. 4. ####		
別及连带责任。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据	61 重要提示 该對不存在虛假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性和 (本基金合同规定,于2015年1月16日复核了本报告中的财务指标。净值表现和投资组合指		
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资 本报告中财务资料未经审计。	则管理和运用基金资产但不保证基金一定盈利。 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10月1日起至12月31日止	§ 2 基金产品概况		
15金简称	国泰事件驱动股票		
s金主代码	020023		
<b>E</b> 易代码	020023		
金运作方式	契约型开放式		
s金合同生效日	2011年8月17日		
2告期末基金份額总額	101,199,552.04份		
<b>投资目标</b>	深人挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会,在积极把握 宏观经济和市场发展起势的基础上精造具有估值优势的公司股票进行投资,力争获取 超越业绩计长涨准衡的成品		
<b>史安</b> 鄉略	本基金並注承人控制可能好行业成公司的当前或未来价值产生重大影响的事件。在积 核把附至原是影布的场发展趋势的基础上,将事件但因素作为货币的主线,并等用作级 动投资缩度预测本基金的投资密理中。 具核而言。本基金的投资密理中。 具核而言。本基金的投资密理。 为的"更"。 为"的"则"。 为"的"则"。 为"的"则"。 为"的", "则"。 "是一个"是一个"。 "是一个" "是一一个 "是一一个 "是一个" "是一一个 "是一一个 "是一一一一 "是一一一一一 "是一一一 "是一一一 "是一一 "是		
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%		
观险收益特征	本基金为股票型基金,股票型基金的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、相对较高预期收益的品种。		
1. 金管理人	国泰基金管理有限公司		
1.金托管人	中国建设银行股份有限公司		
3.1 主要财务指标	§ 3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民市		
主要财务指标	报告期 <b>20</b> 14年10月1日-2014年12月31日)		
本期已实现收益	42.915.811.8		
本期利润	31,455,063.3		
加权平均基金份额本期利润	0.262		
期末基金资产净值	176,165,753.8		
- 期末基金份额争值	1.74		

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	交基准收益率的比较	筊		
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准收 益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-3	2-4
过去三个月	18.92%	1.47%	34.88%	1.31%	-15.96%	0.16%
3.2.2自基金合同生		国泰事件9 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引 引	宏力策略股票型证券	投资基金 的历史走势对比图		
26,646,						70
AT, 24Pk						1
NIAM.				7	A	- 14
46.00%				- Stand	h .	11/100
30.40%				May 4 and	"M	1
28.83%			10 10		WALL	
340,0000			ALM I			4

主:本基金	的合同生效日	为2011年8月17日。本基:	金在六个月建仓期结: 8.4 管理人	東时,各项资产配置比( 据告	列符合合同约定。
4.1 基金丝	P理(或基金经	理小组)简介	34 日柱八	JIKD	
姓名 职务	任本基金的基	金经理期限	证券从业年限	说明	
XI-fr	87(95	任职日期	宮任日期	HE35-MAR-1-PR	0091
王航	本基国股泰州金州市城市公司市场的理会。	2011-08-17	-	13	斯士研究生、CFA、曾任职于南方证券 有限公司:500年1月期盟国基基金管 理解限公司:历任社会11组合基金象 保本基金经理助理。国泰金与稳健混合 的基金经理助理。国泰金与稳健混合 的基金经理助理。国泰金与规健混合 发展。1200年4月至2012年1月 任田泰金龙尺型地路。证券企场上的人员 基金经理则理。2008年5月至2012年1月 基金经理则理。2008年5月至2013年9月 基金经理则过。2014年9月董任 多月总进任即泰里中年第2014年9月兼任 多月总进任即泰里中年第2014年9月兼 推任国泰金龙行。中精生患者以常基金 等校营基金的基金经理。2014年9月 推任国泰金龙行。中精生患者以常基金 使被必须式后、置信合包生务权党基金 使被必须式后、置信合包生务权党基金 与基础的基金经理。2014年3月最 设置基金的基金经理。2013年9月 2014年3月任任资额总监。2014年3月起 任权登城务位等金发型。2014年3月起

增长率为18.92%,同期业绩比较基准收益率为34.88%。

序号	项目	金額 (元 )	占基金总资产的比例 6
1	权益投资	166,132,674.17	90
	其中:股票	166,132,674.17	90
2	固定收益投资	6,012,000.00	3
	其中:债券	6,012,000.00	3
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-	

1 -	金融衍生品投资					1		
	买人返售金融资产							
	其中:买断式回购的买	【人扳售金融资产		_				
	限行存款和结算备付			8,476,818.44			4.6	
	其他资产				2,154,752.75			
	合计				182,776,245.36		100.0	
报告	期末按行业分类的股							
		·让类别		公允付	竹伯(元)	占基金资产净值	1比例 (%)	
	林、牧、渔业				-			
	Ť±lk				2,376,656.38		1.3	
	<b>当业</b>	de Carlli ala II			76,077,428.36		43.1	
	力、热力、燃气及水生? ****	"和厌应业			3,926,021.63		2.2	
	€业 分和家售业				15.591.236.18 3.082.420.35		8.8	
	《和麥哲业 通运输、仓储和邮政业	,			3,622,428.51		2.0	
	国和報饮业				3,022,426.31		2.0	
	3年1年以並 1.传输、软件和信息技	· 卡肥久小			10.196.997.20		5.7	
	は154m74V14-451197873× 単小	J I NOBE JT SE			35,455,906.20		20.1	
	erar.				10,444,146.51		5.9	
	西和商务服务业				5,359,402.73		3.0	
	产研究和技术服务业				-,,			
	小环境和公共设施管	理业			-			
	已服务、修理和其他服				-		-	
教育					-			
T).	E和社会工作				-	-		
	<b>と、体育和娱乐业</b>				30.12		0.0	
综合					-			
合i					166,132,674.17		94.3	
1位古	明木按公允訂但古悉	金资产净值比例大小相	肝的肌	十名股票投資明細		1 40 4 40 1	order filter Little	
号	股票代码	股票名称		数量 般)	公允价值 (元)	占基金资产	- 伊恒比例 ; )	
1	601318	中国平安		191,375	14,297,620	_	8.12	
2	002415	海康威视		444,466	9,942,70		5.64	
3	300168	万达信息		210,706	9,734,61		5.53	
4	002588	中丹利		236,902	9,227,33		5.24	
5	002388	北新建材		320,016	8,090,00		4.59	
5	600388	龙净环保		218,000	7,630,00		4.33	
7	600657	信达地产		860,251	7,019,64		3.98	
8	600587	新华医疗		223,502	7,002,31		3.90	
9	601988	中国银行		1,416,600	5,878,890		3.34	
0	002400	省广股份		247,319	5,359,40		3.04	
	期末按债券品种分类			247,319	3,339,40.	:./3	3.04	
F	9/12/15/16/19/10/11/19/19/	债券品种		公分:	价值 (元 )	占基金资产净	值比例 6s.	
	国家债券	Dr. A. Mari I		24,70	6,012,000.0		3.4	
	央行票据				3,012,000.0	-	3.4	
	金融债券					+		
	其中:政策性金融债	5				1		
	共平:以東任亚際国 企业债券	1				<del>1</del>		
						+	-	
	企业短期融资券					1		
	中期票据					1	-	
	可转债					_		
	其他					1		
Let AL.	合计	A Mirabak Mari No. 1 1 1	Luteria. 17	- As the state of the state of	6,012,000.0	Ð	3.4	
报告	明末按公允价值占基 债券代码	金资产净值比例大小引 债券名称	肝的前	五名债券投资明细 数量 (张)	公允价值 (元 )	占基金资产		
1	019422	14国债22	<del>                                     </del>	60,000	6,012,000.0		3.4	
4	019422	14690022	1	00,000	0,012,000.	~	3.41	

5. 报告期末按公公价值上基金货产净在比例大小排降的前上名货产支持证券投 未基金法附当根实长时值广土基金货产净在比例大小排降的前五名费金服投资明细 5.5 报告期末按公价值上基金货产净比例大小排降的前五名权证投资明细 本基金本报告期末末持有权证。 5.8 报告期末年次价值上基金股份的投资的投资。 第一个1000年的股份。 5.0 报告期末本基金投资的股份期份及时情况设置。 5.0 报告期末本基金投资的股份期份收购益明细 本基金本报告期末收封有股份股份。

序号	名称	金额 伝)
1	存出保证金	103,522.3
2	应收证券清算款	1,662,354.2
3	应收股利	
4	应收利息	64,605.3
5	应收申购款	324,270.7
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	2,154,752.7
5.11.4报告期末 本基金本报告期 5.11.5报告期末	等有的处于转股期的可转换债券明细 ]末未持有可转换债券。 6十夕股票内存在资通承回标识的说明	

5.11.5报告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。

§ 6 开放式基金份额变动	单
告期期初基金份額总额	141,613,115.
告期基金总申购份額	8,568,337
: 报告期基金总赎回份额	48,981,901
告期基金拆分变动份额	
告期期末基金份额总额	101,199,552
§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	
7.1 签本目注入17日平等本历研文4月0几	前

りた。 基金管理人:部分各査文件可在本基金管理人公司网站上査阅。 中心:申证:472121089000 400-888-8688

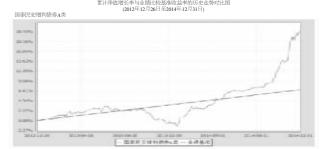
国泰基金管理有限公司 二〇一五年一月二十一日

\$1 **重要提示** 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载,误导性陈述成重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担 [26 <del>全年为</del>7] 个别及查带骨任。 基金性管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月16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运费、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人体定以诚实信用,通验是帮助原则管理知识用基金的产但不保证基金一定查利。 基金的过往业境并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应行细阅读本基金的招募说明书。 本路心时处全数样本经验计。

基金简称	国泰民安增利债券			
基金主代码	020033	020033		
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年12月26日			
报告期末基金份额总额	42,944,140.86(f)	42.944.140.8663		
投资目标	在适度承担风险并保持资产流动性的 求基金资产的长期稳定增值,通过适	在适度承担风险并保持资产流动性的基础上,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求基金资产的长期稳定增值,通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。		
投资策略	产业收策以及资本市场资金环境。通 据证价价未来。已时间联联,已时间联系 2. 陆市设施品种投资资格 2. 陆市设施品种投资资格 本基金集用的固定收益品种主 并强略等。 3. 我果投资资格 并成功价值最近,组合投资分额 排放以价值最近,组合投资分额 进入的企业中产品。未参与报复 有特殊的核心资单为,管理通明建划 第44 4. 权证投资资格 较近少本金金辅助性投资工具。	过对发现经济运行状况。国家财政和货币政策、国 涂市场走势的分析,预测定观经济的发展趋势,并 涂相对效益率。主动理整规要,债券支票产在经定 经总体风险水平相对稳定资品做上,优化投资组合。 提投资源的包括、人期策略,期限结构策略和个券边 提供组合证利能等。从服金的期限检查,基本会股 引通过法格高速力能影響,保证组合的高能之地; 组合的政验性;通过分的投资,组合投资,降低下性 分析与证代分析结合的方法。建在生业清晰,是 流、流动性好且估值具有高安全边际的个股份建建 其投资原则为有利于基金统产增值。本基金在权 用数量化模用分析其合理设价。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较标准为:一年期银	段行定期存款税后收益率 + 0.5%		
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和区 场基金。	以险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市		
基金管理人	国泰基金管理有限公司			
基金托管人	中国农业银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类		
下属分级基金的交易代码	020033	020034		
报告期末下属分级基金的份额总额	31,766,052,37(/) 11,178,088,49(/)			

3.1 主要财务指标		单位-人民币
主要财务指标	报告 2014年10月1日-:	1 2000 10 4111
	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类
1.本期已实现收益	2,647,589.98	1,662,881.01
2.本期利润	3,157,300.48	1,952,989.90
3.加权平均基金份額本期利润	0.1277	0.1086
4.期末基金资产净值	38,555,123.73	13,434,902.29
5.期末基金份额净值	1.214	1.202
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收证 现收益加上本期公允价值变动收益; (2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金		

3.2 基金净值表现 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



# 国泰民安增利债券型发起式证券投资基金

### 2014 第四季度 报告

2014年12月31日

注.本基金的合同生效日为2012年12月26日,本基金在6个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。 国泰民安增利债券C\*

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
K±45	R7595	任职日期	离任日期	HE3P/MARH-PR	19091
张一格	本金泰斯国年FF55倍国条限国表祖国年FF56倍国泰明联合国经济国务员的国务员员会和置公司的国务员员会的国务员员会的支持。 医二氏管 医二氏管 医二氏管 医二氏管 医二氏管 医二氏管 医二氏管 医二氏管	2012-12-26	-	8年	硕士研究生、2006年6月至2012年8月在兴业银行 资金运营中心任投资经理、2012年8月起加人国 泰基金管理角尺河,2012年1月起任国来快定 期前债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2013年3月起报任正年年期间债务易开放式 有数证券投资基金及其粮居基金的基金经理。 2013年12月起来任国家任国教建造成活 金的基金经理。2013年12月起来任国家生造成活 能混合型业场投资基金 假基金的基金经理。2014年17月起来任国家生造成活 混合型证券投资基金 侧面条约度基金则 建任国家或是《成香国混合型工券投资基金》是 基金经理。2014年17起来任国家生废外资基金的基金经理。2014年4月起源任国家全废外资金的基金经理。2014年4月起源任国家全废外产老定期 定行混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月

2. 這勢从业的含义達从行业协会 征券业人业人员政務管理功法的利贷规定。 4.2 管理人共报告期内本基金应证海银宁省后的访问 本限告期内本基金管理人下格達可 征券法, 征券经表金法, 卷金管理公司公平交易制度指导意见, 跨有关法律法规的规定, 严格 遵守基金合同和驱逐到并持近未增被实用,最级要求,最大规定保护投资人合法权益等规则管理和运用基金资产。在控制风险的基础上 为持有人银来最大后结本招告期内本基金定律合法合规,未发生指穿基金价额持有人利益的行力未发生内离交易, 继续市场和汽当关联交 易及其他定期行力。但能被逐及时、海德、完整 本金电子基金管理人的管理的技能处金资产 投资信息公司资产之间严格分开、公平对待, 基金管理小组保持独立运作,并通过科学决策、规范运作,稀心管理和继续全体。有效保姆投资人的合法权益。

虑范围,社会融资成本的高企有结构性的原因,但总量原因也不应忽视。尽管经济的尾部风险确实有所下降,但依然需要警惕可能爆发的债务
风险。 权益市场方面,从历史和国际比较看,大盘蓝筹的估值修复可能还有少量空间,同时市场的反身性也将加强这种趋势。但应回避没有业绩
支撑靠预期炒作起来的小市值股票。
债券市场将继续演绎牛市下半场,考虑到经济基本面尚未企稳,通胀风险让位于通缩风险,目前该债券市场的反转还为时尚早。但单边牛
市也不太现实,一方面当前利率绝对水平已处于较低位置,另一方面短期的经济提振,央行货币政策始终低于预期,频繁的新股发行都会对市场造成扰动。可以预期的是,2015年的储市上下波动将更为频繁,30-50BP的波动机会很多,但将考验投资者波段操作的能力。
一季度,本基金在债券配置方面,将采用中高信用评级、中短久期的操作策略,力争抓住市场波动机会获取收益。在权益方面,我们将坚守
绝对价值的投资理念,选择有业绩支撑、符合债券基金低风险特点的优秀公司进行投资。
§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

2				63,227,417.90 86.4				
	其中:债券				63,227,417.90	86.45		
	资产支持证券				-	-		
3	贵金属投资				-	=		
4	金融衍生品投资				-	=		
5	买人返售金融资产				-	-		
	其中:买断式回购的	买人返售金融资产			-	-		
6	银行存款和结算备付	金合计			2,373,823.52	3.25		
7	其他资产				1,879,226.93	2.57		
8	合计				73,139,098.35	100.00		
5.2 报台	与期末按行业分类的股	票投资组合			,			
代码		行业类别			公允价值 (元 )	占基金资产净值比例 %)		
A 2	友、林、牧、渔业				-	_		
	采矿业				-	_		
	制造业				969,400.00	1.86		
D	电力、热力、燃气及水生	产和供应业			-	_		
	建筑业				_	_		
	比发和零售业				-	-		
	交通运输、仓储和邮政。	K				_		
Н	主宿和餐饮业				_	_		
I	言息传输、软件和信息技	支术服务业			-	-		
J s	金融业			1	1,849,730.00	3.56		
	房地产业				2,839,500.00	5.46		
L {	且赁和商务服务业				-	-		
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	-	-		
0	居民服务	、修理和其他服务业		1	-	-		
P		教育		1	-	-		
Q	12	生和社会工作			-	-		
R	文化	、体育和娱乐业			-	-		
S		综合			-	-		
6 2 H3 A	与期末按公允价值占基	合计	HEISTAN MELL	ク肌悪化物の	5.658.630.00	10.88		
				- 1		占基金资产净值比例		
序号	股票代码	股票名称	数量	(役)	公允价值 元)	(%)		
1	600048	保利地产		140,000	1,514,800.			
2	601318	中国平安		19,000	1,419,490.			
3	600657	信达地产		130,000	1,060,800.			
4	000651	格力电器		20,000	742,400.			
5	601988	中国银行		100,000	415,000.			
7	000024 002367	招商地产		10,000	263,900. 227,000.			
8	002367	康力电梯 国信证券		1,500	227,000.			
	5期末按债券品种分类			1,500	15,240.	0.03		
序号	17921-02 (04) 3 111 11 3 3 5 5	债券品种			公允价值 (元 )	占基金资产净值比例 %。)		
1	国家债券					V67		
2	央行票据							
3	金融债券			14,429,971.00				
	其中:政策性金融债				27.76 27.76			
4	企业债券	**			14.429.971.00 30.286.262.80			
	心业短期脑容类				14 512 450.00			

	共中: 阪芬					63,227,417.90		86.45
	资产支持证券					-		-
	贵金属投资					-		-
	金融衍生品投资					-		-
	买人返售金融资产					-		_
_	其中:买断式回购的买力	. 近年全路咨产				_		
_	银行存款和结算备付金					2,373,823.52		3.25
	其他资产	пи				1.879.226.93		2.57
	合计							
						73,139,098.35		100.00
것은	<b>卡期末按行业分类的股票</b>	<b>父</b> 资组合						
	行	业类别			公允价值	t (= )	占基金资	<b></b> (产净值比例
$\perp$		an sens			23,76011	2 70 7		66)
	· 大林、牧、渔业							-
	<b>长机</b> 小水							-
	判造业					969,400.0	0	1.86
	也力、热力、燃气及水生产	和供应业						-
	<b>主</b> 筑业							-
	比发和零售业							-
	ど通运输、仓储和邮政业						-	-
f	主宿和餐饮业						-	-
fi	言息传输、软件和信息技术	服务业					-	-
	<b>於融业</b>					1,849,730.0	0	3.56
E	号地产业					2,839,500.0	0	5.46
	且赁和商务服务业							-
ř	斗学研究和技术服务业							-
Ť	水利、环境和	公共设施管理业						_
Ť		理和其他服务业						_
Ť		教育						_
Ť	<b>丁</b> 牛系	社会工作						_
Ť		育和娱乐业						_
Т		56						
Ŧ		综合 合计				5,658,630.0	0	10.88
34		合计	非序的前十	夕盼 票招咨田	日約日	5,658,630.0	0	10.88
_	5期末按公允价值占基金	合计 资产净值比例大小						
_		合计		名股票投资明 : 般)		5,658,630.0		资产净值比例
5년	占期末按公允价值占基金 股票代码	合计 资产净值比例大小 股票名称		(役)		允价值 玩)	占基金)	资产净值比例 %)
_	長期末按公允价值占基金 股票代码 600048	合计 资产净值比例大小 股票名称 保利地产		(役)		允价值 玩) 1,514,800	占基金) .00	86 ) 2.91
_	長期末按公允价值占基金 股票代码 600048 601318	合计 资产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安		(役) 140,000 19,000		允价值 玩) 1,514,800 1,419,490	占基金) .00	8产净值比例 %) 2.91 2.73
_	ト期末按公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657	合计 资产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产		(役) 140,000 19,000 130,000		允价值 元) 1,514,800 1,419,490 1,060,800	占基金) .00 .00	资产净值比例 %) 2.91 2.73 2.04
_	股票代码 600048 601318 600657 000651	合计 资产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器		(税) 140,000 19,000 130,000 20,000		允价值 元) 1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400	占基金) .00 .00 .00	资产净值比例 68) 2.91 2.73 2.04 1.43
_	長期末核公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000651 601988	合计 资产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000		允价值 元) 1,514,800 1,419,490 1.060.800 742.400 415.000	占基金) .00 .00 .00 .00	窓产净値比例 を) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80
_	を	合计 發产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招商地产		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000		(允价值 元 ) 1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	资产净值比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51
_	股票代码 60048 60048 601318 600657 000651 601988 000024 002367	合计 赘产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 相爾地产 康力电梯		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000		(完介值 元 ) 1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900 227,000	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	競产净値比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44
3		合计 餐产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招商地产 東力电证券 国信证券		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000		(允价值 元 ) 1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	资产净值比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51
3	股票代码 60048 60048 601318 600657 000651 601988 000024 002367	合计 餐产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招商地产 東力电证券 国信证券		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000		(完介值 元 ) 1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900 227,000	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	<ul> <li>(表)</li> <li>(表)</li></ul>
3	5期末校公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000651 601988 000024 002367 002376 9期末校債券品种分类的	合计 餐产净值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招商地产 東力电证券 国信证券		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000		1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900 15,240	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	资产净值比例 60) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03
글 닷컴	的期末校公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000651 601988 000024 002367 002736 5期末校债券品种分类的	合计 股票名称 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地牌 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900 15,240	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	<ul> <li>(表)</li> <li>(表)</li></ul>
글 닷컴	ト期末校公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000657 000651 000024 002367 002736 り期末校債券品种分类的	合计 股票名称 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地牌 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 415,000 263,900 15,240	占基金) .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00	资产净值比例 60) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03
글 닷컴	り期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600057 000057 000057 000053 000023 0022367 0022367 0022367 (回2367 002367 (回2367 (u2367 (	合计 股票名称 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地牌 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	た价値 年) 1.514.8000 1.419.4901 1.060.800 742.400 415.000 263.9000 15.240	占基金) - 1	後) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03
글 닷컴	時期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000657 000651 0002367 002736 5 即末按値券品种分类的 値容等 央行環報	合计 股票名称 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地牌 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	先价値 年) 1,514,800 1,419,490 1,060,800 742,400 263,900 227,000 15,240	占基金) 000 000 000 000 000 000 000 000 000 0	资产净值比例 6 ) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03 20°净值比例 6 ) ———————————————————————————————————
글 닷컴	り期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000657 000657 000054 000236 002236 002236 002236 (可2367 002736 (可2367 (可2367 (重3667 女子子) (単3667 女子) (単3667 女子) (単3667 女子) (単3667 女子) (単3667 女子) (単3667 女子) (単3667 女子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (単3677 く子) (世3677 (世36	合计 股票名称 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地牌 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	矢价値 年) 1.514.8000 1.419.4901 1.060.800 742.4000 263.900 227.0000 15.240 16.00	占基金	後) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03
글 닷컴	将来校公允价值占基金   股票代码   600048   601318   600657   000657   000651   0002567   002736   日本校領券品种分类的   国家領券   央行弾阻   金融信券   英元・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・東京・	合计 股票名称 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地牌 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	デか作権 (元) 1,514,800 1,419,490 1,419,490 1,1600,800 742,400 263,900 277,000 15,240 16.00 17,240 17,240 17,240 14,429,971.0 14,429,971.0 14,429,971.0 14,429,971.0	占基金() 000 000 000 000 000 000 000 000 000 0	资产净值比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03 66) 27.76 27.76 27.76 58.25
글 닷컴	り期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000657 000657 000657 000236 000236 002367 00236 002367 00236 002367 00236 位間整備券 長年1数保住金融倍 企业短期确定券	合计 發序等值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地产 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	矢价値 年) 1.514.8000 1.419.4901 1.060.800 742.4000 263.900 227.0000 15.240 16.00	占基金() 000 000 000 000 000 000 000 000 000 0	後) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03
글 닷컴	時期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600657 000651 000651 0002367 002736 号期末按债券品种分类的 資本債券 契付非据 金融債券 其中;改棄性金融倍 企业债券	合计 發序等值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地产 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	(元)	占基金分 .00	资产净值比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03 2产净值比例
글 닷컴	的期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 60057 000657 000657 000657 000276 002736 002736 002736 002736 002736 002736 002736 时间增加 400067 位面等 5年中,政策性金融值等 企业短期通效等 中期票据	合计 發序等值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地产 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	デか作権 (元) 1,514,800 1,419,490 1,419,490 1,1600,800 742,400 263,900 277,000 15,240 16.00 17,240 17,240 17,240 14,429,971.0 14,429,971.0 14,429,971.0 14,429,971.0	占基金分 .00	资产净值比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03 66) 27.76 27.76 27.76 58.25
글 닷컴	時期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600057 000651 000054 002367 002367 002367 002367 9期末按信券品种分类的 (国家信券 其中: 政策性金融信 企业信券 其中: 政策性金融信 企业情勢 其中: 政策性金融信 企业情勢 其中: 政策性金融信	合计 發序等值比例大小 股票名称 保利地产 中国平安 信达地产 格力电器 中国银行 招前地产 国信证券 请券投资组合		140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 20,000	/2	大の作曲 (元) 1.514.8000 1.419.490 1.660.800 742.4000 245.4000 227.000 15.240 16.27 14.429.971.0 14.429.971.0 14.429.971.0 14.429.971.0 30.286.262.8 14.512.450.0 3.998.734.1	古基金分 00 00 00 00 00 00 00 00 00 0	売产申値比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03 ど产争値比例 を) - - 2.776 58.25 2.791 - 7.69
를 됐습니다.	的期末按公允价值占基金 股票代码 600048 601318 601318 60057 000557 000551 601388 000024 002756 002756 002756 1期公债券品种分类的 (国家债务品种分类的 (国家债券品种分类的 (国家债务品种分 (国家债务品种分 (国家债务品种分 (国家债务品种分 (国家任务品种分 (国家是)	合计 股票名称 股票名称 使料助空 中国坚宏 信法助空 格力电器 中国器行 招商地空 無力电路 国信证券 海外设备 商券是 商务	数量	(©) 140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 1,500	公允价值	(元)	古基金分 00 00 00 00 00 00 00 00 00 0	资产净值比例 66) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.80 0.51 0.44 0.03 2产净值比例
를 됐습니다.	時期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600057 000651 000054 002367 002367 002367 002367 9期末按信券品种分类的 (国家信券 其中: 政策性金融信 企业信券 其中: 政策性金融信 企业情勢 其中: 政策性金融信 企业情勢 其中: 政策性金融信	合计 股票名称 股票名称 使料助空 中国坚宏 信法助空 格力电器 中国器行 招商地空 無力电路 国信证券 海外设备 商券是 商务	数量	(©) 140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 1,500	公允价值	大の作曲 (元) 1.514.8000 1.419.490 1.660.800 742.4000 245.4000 227.000 15.240 16.27 14.429.971.0 14.429.971.0 14.429.971.0 14.429.971.0 30.286.262.8 14.512.450.0 3.998.734.1	古基金分 00 00 00 00 00 00 00 00 00 0	度产売値比例 (6) 2.91 2.73 2.04 1.43 0.83 0.83 0.51 0.51 0.51 0.51 0.51 0.51 0.51 0.52 2.776 6:) 2.776
를 됐습니다.	內期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600057 000057 000057 000056 000023 000236 000236 00236 00236 00236 00236 00236 00236 00236 位間繁殖 全路债券 上中,政策住金融债 企业短期验资券 中期票据 可处理期验资券 中期票据 可处理期验资券 中期票据 可处理期验资券 中期票据 可处理的债务 上中,政策性金融债 企业债券	合计 资产净值比例大小, 股票名称 使利制/空 中国单层 信达地/空 格力电器 中国单层 信达地/空 格力电器 中国超行 招面地/空 据力电器 理力超超行 据向地/空 無力电器 由力电器 由力 由力电器 由力电器 由力电器 由力电器 由力电器 由力电器 由力 由力 由力 由力 由力 由力 由力 由力 由力 由力	数量	(股)  140,000 19,000 19,000 20,000 20,000 10,000 20,000 1,500	公允价值	(年) 14,429,971.0 14,429,971.0 3,398,734,17.9 63,227,417.9 15,348,000 15,240 16,000 15,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 16,000 16,240 1	占基金() .00	後 (金)
를 됐습니다.	時期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 601318 60057 000657 000651 002736 002736 002736 002736 明末按债券品种分类的付 位款债券品种分类的付 位款债券品种分类的付 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 可少期额债券 可少期额债券 可少税债 可以期额债券 可以期的债务 可以时的债务 可以时的有。 可以时的 可以时的 可以时的 可以时的 可以时的 可以时的 可以时的 可以时的	合计 资产净值比例大小, 股票名称 使利地产 中国学安 信达地产 格力电器 中国器行 招商地产 据力电器 即国辖行 招商地产 兼力电梯 国信还单 黄净设组合 贵拳品种	数量	(©) 140,000 19,000 130,000 20,000 100,000 10,000 1,500	公允价值	大売价値	占基金() 00 () 00 () 00 () 00 () 00 () 00 () 00 () 00 () 00 () 00 () 01 () 02 () 03 () 04 () 05 () 06 () 07 () 07 () 08 () 09 ()	表产冷値比例 (6) 2.91 2.91 2.04 1.43 0.083 0.051 0.03 1.67 2.7.66 2.7.66 2.7.66 1.1.61
를 됐습니다.	り期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 601318 600557 0000551 001958 000024 002736 002736 002736 002736 1以179 位置 1 1以179 位置 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	合计 於原名館比例大人才 股票名称 使新机炉。 中国學生 信达地戶。 核力电器 中国線打 括面地戶。 報力电梯 国信证券 黄华投資組合 畫拳品种	数量 数量 非序的前五	(股)  140,000 19,000 19,000 20,000 20,000 10,000 20,000 1,500	2 公允价值 (张) 100,000	大売价値 年) 1,514,800 1,419,490 1,606,800 742,400 263,900 227,000 15,240 16年) 14,429,971,0 14,429,971,0 14,429,971,0 30,286,27,417,9 63,227,417,9 63,227,417,9	占基金领 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .0	養产等値比例 6) 291 273 204 143 0.80 0.51 0.44 0.03 (产等値比例 を) 2276 2276 2276 2276 2276 12161 12161 上基金数产等 低比例を)
를 됐습니다.	時期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 600057 000057 000051 601988 000024 002236 002236 002236 002236 期末按债券品种分类的付 值等 企廠债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 中央工票额债务 中央工票额债务 中央工资 中等工资 中产工资 中产工资 中产工资 中产工资 中产工资 中产工资 中产工资 中产	合计 资产净值比例大小, 股票名称 使利地产 中国学安 信达地产 格力电器 中国器行 招商地产 据力电器 四国综立等 责争设策组合 贵拳品种	数量 非序的前五 尔 5 3	(股)  140,000 19,000 19,000 20,000 20,000 10,000 20,000 1,500	公允价值 公允价值 帐 ) 100,000	大売价値	古基金貨 000 000 000 000 000 000 000 000 000 0	表产冷値比例 6) 291 291 204 143 083 083 083 083 083 051 043 2776 2776 2776 2776 2776 11.61 上基金資产資 低比例 年)
를 됐습니다.	り期末接公允价值占基金 股票代码 600048 601318 601318 600557 0000551 001958 000024 002736 002736 002736 002736 1以179 位置 1 1以179 位置 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	合计 於原名館比例大人才 股票名称 使新机炉。 中国學生 信达地戶。 核力电器 中国線打 括面地戶。 報力电梯 国信证券 黄华投資組合 畫拳品种	教量 非序的前五 尔 5 3 3 P001	(股)  140,000 19,000 19,000 20,000 20,000 10,000 20,000 1,500	2 公允价值 (张) 100,000	大売价値 年) 1,514,800 1,419,490 1,606,800 742,400 263,900 227,000 15,240 16年) 14,429,971,0 14,429,971,0 14,429,971,0 30,285,238 14,512,450,0 3,998,734,1 63,227,417,9 公允价値 10 5	占基金领 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .00 .0	養产等値比例 6) 291 273 204 143 0.80 0.51 0.44 0.03 (产等値比例 を) 2276 2276 2276 2276 2276 12161 12161 上基金数产等 低比例を)

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	的前十名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。	
	按公允价值占基金资产净值比例大小排序的	的前五名贵金属投资明细
,	5期末未持有贵金属。	
	按公允价值占基金资产净值比例大小排序的	的前五名权证投资明细
,	5期末未持有权证。	
	本基金投资的股指期货交易情况说明	
	末本基金投资的股指期货持仓和损益明细	
	5期末未持有股指期货。	
	投资股指期货的投资政策	
		於,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
	主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。	
		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。
		A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。
	F基金投资股指期货的投资策略另有规定的	,
	本基金投资的国债期货交易情况说明 &金合同,本基金不能投资于国债期货。	
依据平型面面 5.11投资组合		
		· 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、外罚的情况。
	明内基亚仪页的用于石证券的及行主体仅生 密的前十名股票中,没有投资干超出基金合li	
5.11.3其他资		可观比普及IX 示件之7PD 同OL。
5.11.3共他贝 序号		会額 (元.)
	名称 存出保证金	金額 (元) 6.553.31
1	TTILIN-III.W	6,533.31

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	113001	中行转债	1.	,323,185.50	2.55			
2	127002	徐工转债	徐工转债 178,806.00 0.34					
	5.11.据告期末前十名股票中存在准重受限情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在准重受限情况。 \$6 开放式基金份额变动 组份多数							
	项目	围	泰民安增利债券A类		国泰民安增利债券C类			
报告期期初基	金份額总額		19,795,242.92		37,050,897.95			
报告期基金总申购份额			19,524,704.04		5,045,235.38			
减:报告期基金总赎回份额			7,553,894.59		30,918,044.84			

报告期期末基金份额总额		31,766,05	2.37	11,178,088.49
§ 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	7 基金管理人	运用固有资金投资本基金情况		
				单位
项目		国泰民安增利债券A类		国泰民安增利债券C类
报告期期初管理人持有的本基金份额		10,000,988.07		-
报告期期间买人申购总份额		-		=
报告期期间卖出赎回总份额		=		=
报告期期末管理人持有的本基金份額		10.000.988.07		_

报告期期间卖出赎回总份额			-		
报告期期末管理人持有的本		10,000,98	8.07		
报告期期末持有的本基金份 (%)		2	13.29		
注:本报告期内本基金管理, 7.2 基金管理人运用固有资 本报告期内,本基金的基金管	金投资本基金交易明 管理人未运用固有资金	Ħ	起资金持有份额	情况	
(E	持有份额总数	持有份額占基金 总份額比例	发起份额总数	发起份额占基金总 份额比例	发起份额承诺持有期 閱

10,000,988.0 金管理人股东

9.2存放地点 本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。

可咨询本基金管理人,部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。