

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 报告送出日期:二〇一五年三月三十日

据告送出日期:二〇一五年三月三十日 基金管理人的董事会。董事保证本报告所载资料不存在虚假记载。误导性除述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性 和完整性本担个别及差需的法律责任。本年度报告上经二分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签奖。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于303年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、 郑明分配情况、财务会计报告,投资组合报告系纳客、保证复成内容不存在虚假记载。误导性标选或者重大遗漏。 基金管理人承报以课采信用,勤勉尽责的原则管理和运用基金货产。但不保证基金一定盈利。 基金管理人承报以课采信用,勤勉尽责的原则管理和运用基金货产。但不保证基金一定盈利。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 本报告的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投

2.1基金基本情	况	§ 2 基金简介		
基金简称			国泰金鼎价值混合	
基金主代码			519021	
交易代码			519021	
基金运作方式			契约型开放式	
基金合同生效日			2007年4月11日	
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	
报告期末基金份额	总额		2,974,607,865.11(5)	
基金合同存续期			不定期	
2.2 基金产品说	朔	·		
投资目标	本基金: 比较基/	本基金为价值精选混合型基金,以量化指标分析为基础,在严密的风险控制前提下,不断谋求超越业约比较基准的稳定回报。		
投资策略	本市场相 市场相 B、 上 中个股份总体风 C、 大	容金环境、证券市场走势的分析、预测宏 均位益率,主动顺整股票、债券及现金类; 复票资产投资路路 &金以量化分析为基础,从上市公司的基 均估值水平和6值,运用组合优化模型。 给的前提下,谋求超额收益。 最券资产投资第路	本面分析人手,建立基金的一、二级股票池。根据股票池 积极创建并持续优化基金的股票组合,在有效控制组合 势分析为基础,结合中短期的经济周期,宏观政策方向及	
业绩比较基准	65%×.上	证综合指数收益率+35%×上证国债指数	收益率+35%×上证国债指数收益率	
风险收益特征 本基金属于具有较高		属于具有较高预期风险和预期收益的证	券投资基金品种。	
2.3 基金管理/	人和基金托管人			
	ĺΒ	基金管理人	基金托管人	
名称		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
	姓名	林海中	田青	
Charles Salaman Av. 1888 1	mi で かごも			

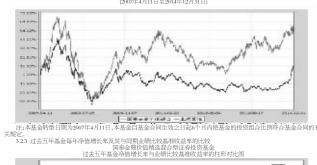
	延名		林福中	田島
信息披露负责人	联系电话		021-31081600特	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com		tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021	31089000,400-888-8688	010-67595096
传真			021-31081800	010-66275853
2.4 信息披露	方式	•		
登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址		http://www.gtfund.com		
基金年度报告备置地点		上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层北京市西城区闹市口大号院1号楼		
a di alami A Ma		§ 3 主要财务	指标、基金净值表现及利润	分配情况
3.1 土炭会订	数据和财务指标			会额单位, 人民

基金份额净值 0.811 0.730 0.563 ;;(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。

间到为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益; 2)所法基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 巫玉[月银寸	但但以千及共一	1-13-01-1E-3M1-P-4X-22E-0	日本と同じたいい			
阶段	份額净值增长率 ①	份额净值增长率 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	1.88%	1.46%	23.45%	1.00%	-21.57%	0.46%
过去六个月	14.55%	1.21%	36.09%	0.79%	-21.54%	0.42%
过去一年	11.10%	1.20%	34.22%	0.71%	-23.12%	0.49%
过去三年	36.76%	1.14%	34.60%	0.72%	2.16%	0.42%
过去五年	14.81%	1.12%	7.50%	0.77%	7.31%	0.35%
自基金合同生效起至 今	54.73%	1.45%	12.29%	1.11%	42.44%	0.34%
3.2.2 自基金转型	以来基金份额累	计净值增长率变法	动及其与同期业组	抗比较基准收益率	变动的比较	

安型以来基金份額第计學值增长率变如及其与同期型氧化效基值收益率变如的比较 国泰金期价值特选混合型证券投资基金 自基金转型以来基金份額累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2007年4月11日至2014年12月31日)





3.3 过去三年基金的利润分配情况 本基金过去三年未进行利润分配。

本基金过去三年未进行利润分配。
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及其常生态的经验
国泰基金管理和人及其常生态的经验
国泰基金管理和人国政立于1998年3月5日,是经中国证监会证监基字[1998]5号文胜准的首批规范的全国性基金管理
与其一人可注册资本为1.1亿元人民币、公司注册地为上海,并在北京和深圳股有分公司。
截至20.14年12月31日,本基金管理人共管理49天叶依式、进升投资基金。国泰金施销售企证券投资基金。国泰金龙系列证券投资基金。但该公计丰12月31日,本基金管理人共管理49天叶依式、进升投资基金。国泰金施销售企证券投资基金。国泰金总统的工作,这个企业,在全国企业,是全国企业,但是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,但是一个企业,但是一个企业,是一个企业,但是一个企

姓名 职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业年限	说明	
XIA	在駅日期 富任日期	19093			
邓时锋	本基金的基金经理、 国泰区位优势股票、 国泰估值优势股票 (LOF)的基金经理	2008-04-03	-	15年	部上研究生。曾任职于天間证券,200(年9月)加盟国等基金管理有限公司,万任行业研究 员、社保11组合基金经理助理。国泰金期价值报记,但是全期份 组混合和国泰金率封闭的基金经理助理。 基金的基金经理。2009年4月起源任国泰区位 优势限率规定,2009年4月起源任国泰区位 优势限率规定等投资基金的基金经理。 年9月起源任国泰位值优势股票型证券投资 基金的基金经理。
	的任职日期和离任				织日期为基金合同生效日。

对于不能通过潜价率均值为零的检验的基金组合配对。对于在时间窗口中潜价率均值过大的基金组合配对。已要来基金经理价价等估出了解解。根据基金经理解处可断下基金组组自己间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。
43.9%常交易行为的专项说明
本居华惠州内,本基金生基金管理人版下国秦国国证医为卫生行业指数分数证券投资基金处生一次同日页向交易且成交较少的电边交易量超过该证券自日成交量%的情况。国泰国证医为卫生行业指数分数证券投资基金处生一次同日页向交易且成交较少的电边交易量超过该证券自日成交量%的情况。国泰国证医为卫生行业指数分数证券投资基金为以完全复制为目标的指数基金。本程序制用大型型准金色可能等更不公平交易和知能输送的界常交易。
44.1 管理人对报告期内基金的投资路路和业绩表现的现象
44.1 管理人对报告期内基金的投资路路和业绩表现的现象
44.1 管理人对报告期内基金的投资路路和业绩表现的现象
44.1 程序则内基金设计资路和业绩表现的现象
44.1 程序制用基金的投资路和企业分量。2 第2014年世界经济指发展于收据的企业经济区、美国企业公司。4 14 12 第1965年2 第1965

业。本基金将一加限住的恪守基金契约,在价值投资理念的指导下、精选个股,注重组合的流动性,力争在有效控制风险的情况下为投资者创造最大的价值。
4.6倍理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人授则析关法律支援规定。设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督。确保基金估值的允允与合理。报告期内相关基金估值实由托管银行进行衰核。公司估理会会由主管宣誓副总经理负责。现员包括基金接领,风险管理、行业明务方面业务骨干,均具有丰富的行业分析。会计核集等证券基金行业从业全级及专业能力、基金经理如认为估值有被企由或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和键义。各万存在任何重大和选种实,一切以投资者利益最大化为最高准则。
4.7倍理人对报告期内基金利润分配情况的说明

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

为。 报告期内,本基金未实施利润分配。 53. 社管人对本年度报告中财务信息等内容的真实,准确和完整发表意见 本社管人度体查了本程的中财务指标,净值表现,利润分配情况,财务会计报告、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。

容不存在能實近點,現學理除述或有重大應編。 本程告期的基金財务会计报告经普华永道中天会计师事务所得获普通合伙/审计,注册会计师签字出具了无保留意见的 审计报告.报资者可通过签载于本管理人网站的年度报告正文套着审计报告全文。 **8.7年度贸务报表**

7.1 资产负债表 会计主体:国秦金鼎价值精选混合型证券投资基金 报告截止日;2014年12月31日

er c	本期末	上年度末
	2014年12月31日	2013年12月31日
贵产:	-	
银行存款	111,260,880.62	244,423,601.
店算备付金	3,395,745.09	1,982,238.4
存出保证金	746,856.61	709,626.
交易性金融资产	2,313,121,827.68	2,669,612,174.8
其中:股票投资	2,268,657,084.14	2,524,329,664.
贴金投资	-	
责券投资	44,464,743.54	145,282,510.
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	-	
汀生金融资产	_	
买人返售金融资产	_	
立收证券清算款	8,589,656.14	
立收利息	717.537.36	2.601.873
立收股利	-	-100-1010
立收申购款	593,229,98	44,638.
	,	,
i 他资产		
	2.438.425.733.48	2.919.374.153.
	本期末	上年度末
负债和所有者权益	2014年12月31日	2013年12月31日
6 億:	_	
短期借款		
交易性金融负债		
汀生金融负债		
卖出回购金融资产款		
· 分子	6,964,045,76	55.823.464.
立付転回款	9,557,538.13	2.205.174.
· 分付管理人报酬	3,177,351,82	3,394,072,
立付托管费	529.558.62	565.678.
立付销售服务费	527,530.02	202,070.
立付交易费用	5,280,197,18	1.680.665.
立交税费	3,200,197.10	309.654
立文·元贞		309,0343
立付利润		
並15 不納 第延所得税负债		
を延り1990以前 其他负债	100.404.81	100.067.
5. 他人们 价值合计		
	25,609,096.32	64,078,777.
所有者权益:	1 000 000 017 22	2.277.451.252
妇收基金	1,808,888,917.33	2,377,451,253.
未分配利润	603,927,719.83	477,844,121.
所有者权益合计 2017年	2,412,816,637.16	2,855,295,375.
负债和所有者权益总计	2,438,425,733.48	2,919,374,153.

7.2 利润表 会计主体:国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

		单位:人民币
项目	本期	上年度可比期间 _
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
一、收人	307,835,553.50	784,308,125.68
1.利息收入	4,748,788.63	6,928,543.49
其中:存款利息收入	1,216,139.30	1,781,865.19
债券利息收入	3,306,795.67	4,185,137.67
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	225,853.66	961,540.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益 假失以""填列)	572,714,944.41	410,998,199.19
其中:股票投资收益	551,776,750.55	380,928,798.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,839,340.42	15,077,702.03
资产支持证券投资收益	-	_
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	18,098,853.44	14,991,698.85
3.公允价值变动收益(损失以""号填列)	-269,889,593.96	365,720,538.15
4.汇兑收益 (横失以 ""号填列)	-	-
5.其他收入 锁失以 ""号填列)	261,414.42	660,844.85
减:二、费用	63,832,761.74	59,385,855.03
1.管理人报酬	38,199,884.13	40,804,573.67
2.托管费	6,366,647.40	6,800,762.26
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	18,503,131.15	11,285,460.89
5.利息支出	301,077.63	40,677.64
其中:卖出回购金融资产支出	301,077.63	40,677.64
6.其他费用	462,021.43	454,380.57
三、利润总额(亏损总额以 ="号填列)	244,002,791.76	724,922,270.65
滅:所得税费用	-	_
四、净利润(净亏福以""号域列)	244 002 791 76	724 922 270 65

			単位:人民币デ		
项目	:	本期 2014年1月1日至2014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(ҍ金净值)	2,377,451,253.86	477,844,121.88	2,855,295,375.74		
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数 (本期利润)	=	244,002,791.76	244,002,791.76		
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)	-568,562,336.53	-117,919,193.81	-686,481,530.34		
其中:1.基金申购款	95,364,346.85	26,447,417.34	121,811,764.19		
2.基金赎回款	-663,926,683.38	-144,366,611.15	-808,293,294.53		
四、本期向基金份额持有人分配利 润产生的基金净值变动 (争值减少 以""号填列)	-	-	-		
五、期末所有者权益(健金净值)	1,808,888,917.33	603,927,719.83	2,412,816,637.16		
项目	上年度可比期间 2013年1月1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)	3,316,935,541.46	-245,525,948.15	3,071,409,593.31		
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)	-	724,922,270.65	724,922,270.65		
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)	-939,484,287.60	-1,552,200.62	-941,036,488.22		
其中:1.基金申购款	195,193,318.69	31,175,311.78	226,368,630.47		
2.基金赎回款	-1,134,677,606.29	-32,727,512.40	-1,167,405,118.69		
四、本期向基金份额持有人分配利 润产生的基金净值变动 (争值减少 以"号填列)	-	-	-		
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,377,451,253.86	477,844,121.88	2,855,295,375.74		

族保护江河州河北宋时岛成高州河。 林报告页码(序号)从71至74,财务报表由下列负责人签署: 基金管理人负责人:陈勇胜,主管会计工作负责人:张琼,会计机构负责人:王嘉浩

基金管理人负责人,陈男桂,王管会叶上作负责人;张垠,会叶机构以取人;土癌伯 7.4 报表往往 7.4 报金基本情况 日本金基本情况 日本金量的估售选混合型证券投资基金是根据原金鼎证券投资基金以下简称"基金金鼎",基金份额持有人大会2007年 3月9日审议通过的《关于金鼎证券投资基金转型有关即项的汉案》并终于国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会") 19证基金全贸00788号《关于标金鼎证券投资基金基金份制等有人人会2007年3月9日审议通过的《关于金鼎证券投资基金基金份制有人人会2007年3月9日由、根据上交所上边份"经7200729年(关于线上金咖啡券投资基金基上市的决定),据基金金鼎产2007年3月0日由、根据上交所上边份"经7200729年(关于线上电池进券投资基金基金。用头房上市的决定),据基金金鼎为企业并成长金。于水场企业外发生,在10年20年20年3月1日,根基金金鼎外企业市场上市市场外的即行《日本金邮》在10年3月0年3月0年3月0日,未在金°7、金鼎证券投资基金金合制》大级的即行《日本金邮》的信誉是法是全证券投资基金金合制》大级的即行(国本金邮》的信誉是是全证券投资基金金合制。发出、基金分规分的即行(国本金邮》的信誉是一个企业等投资基金金合制。发出、基金管理人为国基金管理有限公司、基金任管人为中国建设银行股份有限公司、职基金金编书基金合制生效的部分的影响的情况是一个企业等投资基金金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为本基金的基金资产的自业效日全部转为企业。

本基金在平括晋明用无观场归约291 25四天11.2.
74.6 保顶
74.6 保顶
图家院多总局財程[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
所得税苦代准重效策的通知)、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
相关财税法规知3字整件。主要规项列示如下。
(1) 以发疗基金方式素学金不属于营业统证收资阻、不配收营业税、基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。
(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。2012年1月4月。
2012年2015年8月税。

人。哲不正改企业所得税。

(5) 对基金使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月日起,对基金从上市公司取得的股股产利所得,持股期限在1个月以内仓1个月的,其股租至利所得全额计人应纳税所得编,持股期限超过。中的 笔迹就25%计入应纳税所得编,持股期限超过。中的 笔迹就25%计入应纳税所得编,持股期限超过。中的 笔迹就25%计入应纳税所得编,持股期限超过,中的 笔迹就25%计入应纳税所得编,对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入被据上达规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算,解禁前取得的股息。红利收入被张发音被25%计入应纳税所得编,上述所得完一造用20%的税率计位个人所得税。
(4) 基金发出股票约如,15%的基金增加税买之股份订允,不及股票不而投票更买多用订充。

7.4.7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		
中国建设银行股份有限公司(中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构		
宏源证券股份有限公司(宏源证券")	基金销售机构、受中国建投控制的公司		
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东		
张大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.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		
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东		

·国际破疫的科院的社会列 注:1) 下连天球交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 2申万宏游集团股份有限公司(以下简称"申万宏游")发行股份吸收合并宏游证券股份有限公司(以下简称"宏游证)的申请已录件申国证券监督管理表员企证监节(2014 1209号批复的核准、宏源证券股界 股票代码,600562)已自 4年12月10日开始完建外隙,并于2015年1月26日起在深圳证券交易所终止上市。在换股实施股权登记日(2015年1月23日) 16、宏游证券根架实施股股转换或中万宏温免股股票,并于2015年1月26日在深圳证券交易所上市及挂牌交易。 7.48本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.48本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.48和通过表许交易单元进行的交易 7.481通过美元交易单元进行的交易

7-48.1.3校正交易 本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。 7-48.1.3储全交易						
				金额单位:人民币	元	
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年	12月31日		
大联刀石桥	成交金額	占当期债券成交 总额的比例	成交金額	占当期债券成交 总额的比例		

年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

X4XJ-CHr	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例	
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日				
7.4.8.1.5应支付关联方的(用金			金额单位:人民币	
宏源证券	69,000,000.00 27.71% 50,000,000.00			,000.00 71.43%	
大吹刀右你	成交金額	占当期债券回 成交总额的出		占当期债券回购 成交总额的比例	
关联方名称	本期 2014年1月1日至201	4年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	

在原理 注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方的高确定,以扣除由中国证券登记结算有 证管费和经手费的停缩则示。 2. 该类佣金协议资服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

		半亚:八尺川儿
項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	38,199,884.13	40,804,573.67
其中:支付销售机构的客户维护费	8,647,412.16	9,242,842.54
注:支付基金管理人国泰基金管理有限公司的 月底,按月支付,其计算公式为: 日管理人抵酬—前一日基金资产净值 X 1.509 7.4.8.2.基金托管费		

註、支付基金計(曾入中国歷度X限1)37,10日 (土其计算公式为: 日托曾读声前—日基金资产净值 X 0.25%/当年天数。 7.48.3与关联方进行银行间同业市场的债券(合回购)交易 本基金水指告期及上年更订比割间以末与关联方进行银行间同业市场的债券(合回购)交易。 7.48.4名关联方投资本基金的情况, 7.48.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	-	17,699,686.0
期间申购/买人总份额	-	-
期间因拆分变动份额	=	-
减:期间赎回/卖出总份额	=	17,699,686.0
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.8.4.2似百朔木除盛逝百姓人之7的共他大块万仅页平盛逝的同况 本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5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
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
中国建设银行	111,260,880.62	1,149,652.57	244,423,601.35	1,711,732

国建设银行 指:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管。按银行同业利率计息。 7.48.6本基金在采销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期及上年度可比期间均无在采销期内参与关联方承销证券的情况。 7.48.7其他实使交易率项的设置。 本基金本报告期及上年度可比期间均无须作设用的其他关联交易事项。 7.49期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券 本基金地开工及比划解放力增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金地开工及比划解放力增发证券而于期末持有的流通受限证券。 本基金地开工及比划解放力增发证券而于期末持有的流通受限证券。 7.49.181人以制度处于参加于现实

									金额单位:	人民币元
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
002507	涪陵榨 菜	2014-12- 22	重大事项	28.80	2015- 03-23	31.68	2,200,000.00	55,057,210.35	63,360,000.00	-
600754	錦江股 份	2014-11- 10	重大事项	25.11	2015- 01-19	27.00	2,307,347.00	48,597,275.43	57,937,483.17	-
002068	黒猫股 份	2014-12-	配股	8.71	2015- 01-09	7.96	2,500,000.00	20,948,602.25	21,775,000.00	-

注:本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可 允市事项的重大影响部除后: 经交易所批准复牌。 7.4.9.3期末债券至回购妥身中作为抵押的债券 7.4.9.3.1银行间市场债券正回购 本基金本报告期未无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。 7.4.9.3.2数房市场债券正回购

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购 本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。 7.4.10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) 金融工具公允价值计量的方法

並施工大公元的加區可屬的公居 大价值计量括集所面层度次、由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定; 一层次,相同资产或负债在活跃市场上未签则整的报价。 二层次、降用三次输入值的州采贷产或负债直接或间接可观察的输入值。 三层次、精用关资产或负债的不可观察输入值。

8 | 台口 8.2期末按行业分类的股票投资组合

6) 各层次金融工具公允价值 干2014年12月31日,本基金特有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产中属于第一层次的会额为2.160,3445万。属于第三层次的余额为153,079,483.17元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日;第一层次为2.600,298,729.26 第二层次9.313.445.95元,无第三层次)。 (3) 公允价值所属层次间的重上交动 对于证券交易所上价值股票,名出现重大事项停牌,交易不活跃(包括张鉄仲时的交易不活跃)。或属于非公开发行等情本基金不会干停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃间及限售期间将相关复票的公允价值列人第一层次;并根据包额处平分平可聚%输入值对于公允价值的影响程度,确定相关数票公允价值应属第二层次还是第三层次。 (6) 第三层次公允价值余额和本期变动金额 无。 元。 () 非持续的以公允价值计量的金融工具 于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日;同)。

于2014年12月31日,全途逐不19日中195002年42月8日 (d) 不以公允价值计量的金融近耳 不以公允价值计量价金融资产和负债主要包括点收款项和其他金融负债,其账而价值与公允价值相差很小。 (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期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元 占基金总资产的比例 %。) 2,268,657,084.14 44,464,743.5

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	-	-
В	采矿业	76,305,051.54	3.16
С	制造业	829,969,172.61	34.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	159,793,740.88	6.62
F	批发和零售业	279,367,146.95	11.58
G	交通运输、仓储和邮政业	36,000,000.00	1.49
Н	住宿和餐饮业	57,937,483.17	2.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	287,788,322.96	11.93
J	金融业	405,016,925.27	16.79
K	房地产业	36,720,000.00	1.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	59,800,000.00	2.48
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	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	39,959,240.76	1.66

全麵单位:人民币元

金额单位:人民币5	細	的前十名股票投资明	资产净值比例大小排序	按公允价值占基金	8.3期末
占基金资产净值比例(%)	公允价值	数量(股)	股票名称	股票代码	序号
7.77	187,452,395.57	2,509,067	中国平安	601318	1
6.60	159,350,580.00	5,142,000	国药股份	600511	2
5.94	143,424,370.96	5,480,488	美亚柏科	300188	3
5.94	143,325,827.00	3,751,985	华宇软件	300271	4
5.81	140,130,000.00	13,500,000	中炬高新	600872	5
4.77	115,202,128.86	9,746,373	豫园商城	600655	6
4.62	111,514,214.68	8,309,554	大北农	002385	7
4.25	102,566,018.40	2,078,760	老白干酒	600559	8
3.32	80,133,740.88	6,884,342	安徽水利	600502	9
3.09	74,449,529.70	2,304,939	中国太保	601601	10
担生正立	北 奈爾 / 网址的任度:	9旧如 应阅读珍珠干	日本其会地咨的所有职具	老%了解末担生!	计 机线

8.4报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

1	000625	长安汽车	192,413,925.71	
2	002229	鸿博股份	179,573,168.81	
3	601318	中国平安	158,276,422.83	
4	002507	涪陵榨菜	144,310,529.93	
5	300271	华宇软件	139,739,347.36	
6	002385	大北农	128,669,446.94	
7	600518	康美药业	125,503,556.67	
8	000002	万科A	120,946,078.30	
9	600655	豫园商城	115,576,491.07	
10	000538	云南白药	114,545,038.76	
11	300012	华測检測	113,020,782.80	
12	600028	中国石化	105,980,882.61	
13	600511	国药股份	105,012,500.09	
14	000937	翼中能源	104,337,025.42	
15	600872	中炬高新	99,607,532.42	
16	601088	中国神华	97,470,826.29	
17	600559	老白干酒	87,905,020.70	
18	600502	安徽水利	82,738,092.87	
19	002551	尚荣医疗	80,234,461.22	
20	603288	海天味业	77,604,112.64	
21	600651	飞乐音响	74,854,824.63	
22	600900	长江电力	73,833,572.12	
23	601601	中国太保	73,330,493.34	
24	601699	潞安环能	71,500,438.75	
25	600348	阳泉煤业	70,670,293.33	
26	601288	农业银行	70,355,734.00	
27	600118	中国卫星	69,420,978.24	
28	601988	中国银行	69,132,580.30	
29	300055	万邦达	67,095,460.51	
30	600718	东软集团	64,286,722.92	
31	601668	中国建筑	63,781,037.47	
32	601006	大秦铁路	63,433,773.34	
33	600325	华发股份	62,302,388.03	
34	601012	隆基股份	60,895,967.06	
35	002296	辉煌科技	60,874,726.56	
36	603000	人民网	60,694,273.02	
37	002167	东方锆业	57,187,950.83	

注:买人金额按买人成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。 8.4.2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

772 15	取水(以)	取示右的	华州泉川头山並朝	例 66)
1	600518	康美药业	342,648,566.40	12.00
2	002551	尚荣医疗	250,409,224.04	8.77
3	000625	长安汽车	234,649,363.63	8.22
4	600276	恒瑞医药	226,510,411.74	7.93
5	000538	云南白药	213,004,637.97	7.46
6	600872	中炬高新	178,732,543.90	6.26
7	002229	鸿博股份	156,130,645.77	5.47
8	600887	伊利股份	152,225,104.24	5.33
9	601766	中国南车	149,689,258.33	5.24
10	300168	万达信息	149,172,197.71	5.22
11	600597	光明乳业	135,705,821.18	4.75
12	601299	中国北车	134,131,075.22	4.70
13	000002	万科A	119,111,293.73	4.17
14	600600	青岛啤酒	115,576,721.90	4.05
15	600028	中国石化	112,142,414.83	3.93
16	002216	三全食品	108,389,443.35	3.80
17	600511	国药股份	106,579,686.16	3.73
18	600325	华发股份	101,270,080.63	3.55
19	603288	海天味业	98,294,961.05	3.44
20	002507	涪陵榨菜	98,114,477.30	3.44
21	300182	捷成股份	90,111,094.93	3.16
22	601088	中国神华	89,534,082.69	3.14
23	300055	万邦达	88,320,726.02	3.09
24	600900	长江电力	75,658,085.03	2.65
25	600651	飞乐音响	74,376,577.65	2.60
26	300379	东方通	73,890,126.41	2.59
27	600348	阳泉煤业	70,630,078.97	2.47
28	601699	潞安环能	70,236,049.44	2.46
29	603000	人民网	64,961,391.77	2.28
30	601006	大秦铁路	62,371,286.20	2.18
31	600572	康恩贝	61,439,483.16	2.15
32	002296	辉煌科技	60,788,649.06	2.13
33	600880	博瑞传播	59,744,866.61	2.09

8.4.3买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

85期末	按债券品种分类的债券投资组合		
,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	× 04/2 HH 1 1/2 / 24/2 04/2 4/2/24/11		金额单位:人民币:
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	22,081,000.00	0.92
2	央行票据	=	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	=	=
4	企业债券	=	=
5	企业短期融资券	=	-
6	中期票据	=	=
7	可转债	22,383,743.54	0.93
8	非他	_	_

8.6期末按公允	价值占基金资产净	值比例大小排序的	前五名债券投资明纸	Ħ	
					金额单位:人民币元
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	165,700	22,356,244.00	0.93
2	019407	14国债07	100,000	10,070,000.00	0.42
3	140007	14附息国债07	100,000	10,007,000.00	0.41
4	019422	14国债22	20,000	2,004,000.00	0.08
5	128002	东华转债	170	27,499.54	0.00

8.7期未按公允价值占基金资产净值比例大小非名的前十名资产支持证券投资明纳 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 8.8 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贵金属投资明细

的倍值水平。 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。 8.11报告期末本基金投资的国德期货交易情况说明 8.11.1 本期国德期货投资政策

8.11 本期间信期货投资政策 根據本基金基金合同、本基金不能投资于国债期货。 8.12 投资组合报告附注 8.12 转货组合报告附注 8.12 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体(除"中国平安"公告其子公司连规情况外),没有被监管部门立案 调查或在报告编制间前一年受到公开通讯。处印的情况。 根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券"的(中国还靠监督理委员会行政处罚决定书》[2014]103号,决定对平安证券给予警告,没收需 联讯保养业务收入400万元,没收余销股票注法所得2.867万元,并处以440万元到款;同时对保养人韩长风、霍永涛给予警告, 24-2410人11万元可能,被增加条从中资格。

联市保存证的较大。2017年10月1.1. 设定公本建设。空压证明与4807月1.1. 开发以4407月10级。11007月10月11年,并分别处以30万元10万亩、据增证券从业资格。 并分别处以30万元10页、据增证券从业资格。 本基金股票地。而后进行了投资、开进行了持续的跟踪研究。 本基金股票地。而后进行了投资、开进行了持续的跟踪研究。 请信况发生后,本基金管理人就中国平安子公司受处罚即件进行了及时分析和研究,认为平安证券存在的进规问题对公司经管成果和现金统量水产生重大的实现管理,对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪

r.。 8.12.2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。 8.12.3期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	746,856
2	应收证券清算款	8,589,650
3	应收股利	
4	应收利息	717,53
5	应收申购款	593,229
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	10,647,280

8.12.5期末前十名股票中存在流通支限的情况。 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通支限的情况。 \$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

						份额甲位:	
		持有人结构					
持有人户数(户)	户均持有的基金份 獅	机构投资	E		个人投资者	ŕ	
		持有份額	占总份额比例	持有	分额	占总份额比例	
137,406	21,648.31	172,361,613.11	5.79%	2,80	2,246,252.00	94.21%	
9.2期末基金管理人的	从业人员持有本基金的	情况				<u> </u>	
I	项目	持有优	分额总数(分)		占基金总	份额比例	
基金管理人所有从业人员持	持有本基金			0.00		0.00%	
9.3期末基金管理人的	从业人员持有本开放式	基金份额总量区间的	情况				
项目		持有	有基金份额总量的额	效量区间 伢	份)		
木八司宣保答理 / 月 北久	お客和部分部門名						

§ 10开放式基金份额变动	
	单位:份
基金合同生效日(2007年4月11日)基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份額总額	3,909,649,699.80
本报告期基金总申购份额	156,800,214.18
减:本报告期基金总赎回份额	1,091,842,048.87
本报告期基金拆分变动份额	-
木招生期期支非全位新台類	2 074 607 965 11

§ 11軍大事件揭示 11.1基金份额持有人大会决议

111基金价额持有人大会决议 报告期内、本基企无金价额持有人大会决议。 112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; 2014年9月24日,本基金管理人变力了【写表基金管理有限公司副总经理离任公告》,经本基金管理人第六届董事会第十 议审议通过,李志坚先生不再担任公司副总经理。

冷点议审议通过。李志愿先生不再担任公司副总经理。 2014年12月13日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司总经理变更公告》。经本基金管理人第六届董事会第十三 次会议审议通过。金旭女士不再担任公司总经理。2014年12月11日起由公司董事长陈勇胜先生代在总经理。 报告期内基金托管人里大人事变动如下; 本基金托管人2014年2月7日发布任安通知。解聘开东中国建设银行投资托管业务都总经理助理职务。本基金托管人2014 年11月03日发布公告,聘任赵艰甫为中国建设银行投资托管业务都总经理。

17.13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。

报告期内,本基金提供审计服务的会计师事务所无边聘情况。报告期皮,为本基金提供审计服务的会计师事务所无边聘情况。报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所无边聘情况。报告期皮,为本基金提供审计服务的会计师事务所无边聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为100,000

金额单位:人民币元

报告期内、为本基金提供审计服务的会计师事务所无政聘情况。报告年度应支付给聘目前的审计机构上提供审计服务的年限为年 116 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进行股票投资及佣金支付情况

	WHM-	股票交易		应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元 数量	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	备注
华泰证券	1	-	-	-	-	本期增加
中投证券	1	=	-	-	-	本期减少
广发证券	1	=	-	-	-	-
上海证券	1	1,521,393,723.42	12.71%	1,385,073.64	12.80%	-
长江证券	1	1,512,505,527.01	12.64%	1,376,983.71	12.72%	-
安信证券	1	1,436,553,197.07	12.00%	1,307,831.64	12.09%	-
东方证券	2	1,388,816,642.77	11.60%	1,264,379.18	11.68%	-
国泰君安	2	1,364,107,797.98	11.40%	1,241,887.18	11.48%	-
海通证券	1	1,268,139,478.34	10.60%	1,154,511.49	10.67%	-
华宝证券	1	1,146,866,061.44	9.58%	1,044,107.56	9.65%	-
宏源证券	2	746,241,132.17	6.24%	679,380.01	6.28%	-
招商证券	1	630,369,039.00	5.27%	573,889.30	5.30%	-
东兴证券	1	372,016,074.76	3.11%	264,279.59	2.44%	-
民族证券	1	309,048,322.82	2.58%	281,354.47	2.60%	-
rh 6Hmill	1	271 760 924 40	2 270	247 410 02	2 200	

中银国际 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;

]提出租用证券公司交易席位的调整意见(包括调整名单及调整原因等),并经公司批准。 11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成 交总额的比例	成交金額	占当期回购成交 总额的比例	成交金額	占当期权证成交 总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	=	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	80,000,000.00	32.13%	=	-
长江证券	20,586,811.00	30.12%	-	-	=	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	=	-
国泰君安	-	-	-	-	=	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	1	-
宏源证券	47,758,068.68	69.88%	69,000,000.00	27.71%	=	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	100,000,000.00	40.16%	=.	-