全额单位, 人民币元



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

朱性、作明正中已进出了2017年 长签发。 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2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、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

里人四碘。 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。 基金的过住业绩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仔细阅读本基金的招募说

7及共史朝。 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

基金简称			田本仙	新达克100(ODII-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
基金管理人			田幸	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	1.80			49,622,120.00%
基金合同存续期				不定期
基金份额上市的证券	· 交易所		上海证券交易所	
上市日期			2013年5月15日	
2.2 基金产品	i说明		•	
投资目标	紧密	跟踪标的指数,追	自求限踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金主要工程完全推到原理。即使国际的指数的成份使用或是其权重构建 基金管理设置的。并根据的有效或份更其材度的完全的不同问题。但因特殊信化(加坡的投长) 牌或的数字生变更或份数化准由于自由液晶是发生变化。或的核心可行力。市场流动也不足等)等级本基 理人无法规则的结构的成分或是有上河间面部。在企业使用大场之后之时代化、完全能使原则是是 在正常市场的成长,未基金的风险的制度的最近来的划损指离离效的特别不是近近地。有限的经常不 18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间 2 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间,18 年间 2 年间,18 年间 2 年间,18 年间		变动进行相应调整。但因特殊情况(如成份股长期) 成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金? 理分,市场流动性不足等)导致本基金? 现路偏寡弯的绝对值不超过0.2%。年限路误差不超3	
业绩比较基准	纳斯	达克100指数(Na	asdaq-100 Index),	
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 要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益 证。		音樂型基金与货币市场基金。本基金为指數型基金、 以及标的指數所代表的股票市场相似的风险收益。		
2.3 基金管理	人和基金托管	人		
Ą	頭目 一		基金管理人	基金托管人
名称			田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
	100 OF 100 OF		021-310816000€	010-67595096
信息披露负责人	联系电话		021-3108100089	010-07393090

		电子即相		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境外资产托管人					
	項目			境外资产托管人		
名称		英文		State Street Bank and Trust Company		
	41.85	中文		美国道富银行		

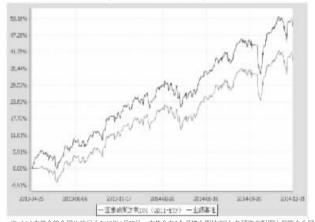
主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 3.1 主要会计数据和财务指

		金额单位:人民币
3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年4月25日(基金合同生效日)至2013年12 月31日
本期已实现收益	8,001,336.25	3,192,790.50
本期利润	12,726,486.36	9,847,685.04
加权平均基金份额本期利润	0.2030	0.1236
本期基金份額净值增长率	17.15%	17.80%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份額利润	0.1952	0.0541
期末基金资产净值	68,471,088.70	59,621,428.29
期末基金份額净值	1.380	1.178

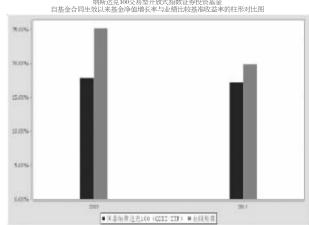
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入.投资收益.其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益; (2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用.计人费用后实际收益水平要低于所列数

注:同期业绩比较基准以人民币计价。 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金 自基金合同生效以来基金份额案1分单值增长率与3级比较基金的变革历史走势对比图 (2015年4月5日至2014年12月3日



(2)同期业绩比较基准以人民币计价。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较纯期兑克100交易型开放式指数证券投资基金自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的住形对比图



注:(1)2013年计算期间为本基金的合同生效日2013年4月25日至2013年12月31日,未按整个自然年度进行折

(2)本基金在3个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。 (3)同期业绩比较基准以人民币计价。

本基金成立于2013年4月25日,截止至本报告期末未进行利润分配。

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及基金经营用的经验
国泰基金管理看限公司成立于1998年3月5日,是经中国证监会证监基字119981等文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.4亿元人民币、公司注册按本为 1.6年 末在北京和深圳设有分公司。截至2014年12月31日,本基金管理人共管理49只开放式证券投资基金。国泰金惠增长证券投资基金。国泰金老高到证券投资基金(国泰五日上基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金。国泰金惠增长证券投资基金。国泰金老周券让资基金。1018年20年发生金。第金金规中本值信合证券投资基金。国泰金老自新政长投票基金(包括24年基金,分别为国泰金之行业精选证券投资基金。国泰金老周等企业分投资基金。1018年20年发生金。4年 10180年发投资基金,国泰金基金等型而来,国泰金全自新政长投票或证券投资基金。国泰金和价值混合型证券投资基金。国泰金和价值混合型证券投资基金。1018年20年发生金转型而来,国泰公司企业务投资基金。1018年20年发生金转型而来,国泰纳斯达克106指数证券投资基金。1018年20年发生金转型分量。2016年20年发生金、1018年20年发生全、1018年20年发

		任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明	
姓名	职务	任职日期	离任日期			
徐皓	本基金的基金经理。因 泰中小板3000成长TFP。 图泰中小板3000成长 TFP發烧。因等创造产 运 等的新达定1000指数的 基金经理	2014-11-04	-	8年	制计研究性,FNM,注册完全投资价值的 (国家一概)。包括联升中国工资的价值 (国家一概)。包括联升中国工资的一种 中1月相任上证30金量以各是对象公司 中1月相任上证30金量以各是对象公司 平1月相任上证30金量以各是对学政公司 现于核次内管理。中以该30金量以各是对象公司 证券价度的负责。在1000年间,是1000年间,是1000年间, 设置的规则。2000年度全是对是2004年间, 设置处理。但2000年代与第200年度, 设置处理。但2000年间,是1000年间, 1000年间, 1000年间	
崔涛	本基金的基金经理	2013-04-25	2014-11-04	11年	超上研究生,曾任职于Boloma Partners 使产管理会与《嘉德特代值的》、2009 用6月加入团章志盖世歷有股公司,任初 经股份值(能化研究)的》、从海市公司,任初 是现外市场投资研究。2011年5月至 2014年1月月但中的市场区域的股份 市场收益会路金金层规。2011年5月至 2014年1月日间联立务部总型的股份 第一次市场投资研究。2011年5月至 2014年1月日间联立务部总型制度 2012年5月至2014年1月第任团章大资 第二次市场经济市场投资研究。2014年1月第任团章大资 第二次市场经济市场经济市场经济市场经济市场经济市场经济市场经济市场经济市场经济市场经济	

注:1.此处的任职日期和源任日期均指公司决定生数之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。 2.证券从业的含义遵从行业协会(证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。 4.管理人对报告期内本基金运作遵规于信情充的说明 本报告期内、本基金管理人严格遵守(证券法)《证券投资基金法》(基金管理公司公平交易制度指导意 见》等有关法律法规的规定,严格遵守基金合同和招募说明书约定,本着诚实信用、勤勉尽责,最大限度保护投资

纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

人合法权益等原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作 合法合规,未发生损害基金份额持有人利益的行为,未发生内幕交易,操纵市场和不当关联交易及其他违规行 为,信息披露及时,准确,完张。本基金与本基金管理人所管即的其他基金资产,投资组合与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,精心管理和健全内控体系,有效保障投 停入的合法投资。

7、3个下对中,金亚百球小组体行组达定作,并迎过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系、有效保障投资人的合法权益。
4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.31公平交易制度和控制方法
本基金管理人根据相关法规要求、制定了《公平交易管理制度》、制度规范了公司各部门相关岗位职责、适用于公司所有投资品种的一级市场中期、二级市场交易等所有投资管理活动。包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。旨在规范交易行为、严禁利益输送、保证公平交易、保护投资者合法权益。
(一)公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策能是,提高投资决策的科学性和客观性、确保各投资组合享经公平的投资决策制会。建立公平交易的制度环境。
(二)公司制定投资授权制制,明确各投资决策主体的职责和权限划分,合理确定各投资组合经理的投资权限的提作需要经过严格的审批程序。
(三)公司制定投资授权机制,明确各投资决策主体的职责和权限划分,合理确定各投资组合经理的投资权限的遗传等

(三)公司对各投资组合信息进行有效的保密管理,不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔

(四)公司实行集中交易制度,严格隔离投资管理职能与交易执行职能,确保各投资组合享有公平的交易执 行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。 (五)公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,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。

区问交易。 (六)公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗 下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析,并评估是否符合公平交易原则。 (七)公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度,对交易过程进行定期检查,并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

14、25年10年3月制度的执行情况 43、2公平交易制度的执行情况 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定,通过严约内部风险控制制度和流程。对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制,确保公平对待所管理的所有基

金和投资组合、切实防范利益输送行为。 (一)本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析 根据证据会公平交易指导意见、我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的 交易价差分析,我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下,且大部分溢价率均值通过95%置信度下 等378545866

交易价差分析,我们及现于从是一个的人。 等于的的检验。 (二)扩展时间窗口下的价差分析 本基金管理人选取下=环IT=5作为扩展时间窗口,将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均, 并以此为依据,进行基金或组合间在扩展时间窗口中的间向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对 (样本数≥90),溢价率均值大部分在1%数量级及以下。 (三)基金或组合间模拟溢价金额分析。 对于不能通过溢价率均值为零的。检验的基金组合配对,对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对,已要求基金经理对价差作出了解释,根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和 和达输送的行为。

利益输送的行为。
4.3.异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内,未发现
本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.管理人对报告期内基金的投资资格和业绩表现的说明
4.4.馆是人对报告期内基金的投资资格和业绩表现的说明
20.4年等现严密变差形区震荡上行。但表动加大,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、标普、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。9%大幅上最小较大量度量和保险者的级为量。

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应基金、本基金重绝了下必要的主动操作、减少了交易冲击成本,并通过精细
作为完全跟踪标的指数的被应基金、本基金重绝了下必要的主动操作、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宜基本一致。
本报告期内如统一以美元资产计价计算本基金目为跟踪误差为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。2%,年限据误差不超过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年净值增长率为17.15%。同期业绩让实基准收益率为19.84%。
4.6亩理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展型
签过早初的震荡调整以后,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
盈利推动广场步上行。从基本面的角度,并没有太多不协同发来。各项经济数据均显示。在美联储强力的货币政
策刺数下,美国经济已经走上了稳健复苏的轨道、按下来市场最关注的就是美联储将同时、以何种方式退出超级
策划的政策、从历史表现者,结束或的线上处,但周期时,往往会引发市场的规划分离。因此而强。级慢
的退出这场史无前例的宽松、避免对经济和市场造成中击,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会议态度及指锋的变化。
美股上涨过程是不畅情化经验、恢复信心、长期稳健向上的过程、未来美股涨跌艉最极心的决定因素是美国
经济数据以及全球资本流向,取决于美国实体经济复态是各得到验证。后《医时代的资本回流、完美的基本面以及
美国以外的关经济体产级产级发生。一是股利美企业等分,和于几年代,这家体者大部分对美元都
将走弱、基本面良好以及低速能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,构成发现,基本面良好以及低速能环境对股票市场的股为有利,并且是对接受自身投资未被免费。有从有报告期内基金的位置,未完全等分,拥有革命性技术的公司,建议投资者积极配置国塞纳斯达克100
(QDII-EIT 513100),并充分享受一级市场交易的便对。
4倍增见人对报告期内基金的是自由普密至前的总织由债法,或员任基金依据,风号任息的实验,有是现代

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4. / 在建入对报告期外各金水间对加口可比别处别 截止本报告期末. 根据本基金基金合同。相样关注律注规的规定,本基金无应分配但尚未实施的利润。 8.5 任管人报告 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 本报告期,中国建设银行股份有限人司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、 托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的 少多。

7.1 管的风机疾他可失规定,不存在测查整金功确行有人构验的计划,完全必称公司地域计了整金允良八处尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信。净值计算,利润分配等情况的说明
本报告期,本托管人按照国家有关规定。基金合同、托管协议和其他有关规定、对本基金的基金资产净值计算,基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金纷额特有人利益的行为。
本报告期内本基金未进行收益分配。
5.3 托管人对本年度报告中的财务指标,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,误导性除还或者重大遗漏。
8.6 审计报告
本报告期的基金财务会计报告经普华永道中云会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。
8.7年度财务报表

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
řř:	_	
B 行存款	5,363,692.38	5,298,438.5
占算备付金	-	
子出保证金	_	
と 易性 金融资产	63,749,462.89	55,093,133.4
中:股票投资	62,020,202.89	55,093,133.4
5金投资	1,729,260.00	21,000,000
青券投资		
货产支持证券投资	_	
行生金融资产	_	
天人返售金融资产	_	
正收证券清算款	_	60,943.2
应收利息	1,140.75	709.9
豆收股利	22,101.03	30,908.9
T收申购款	22,101.05	30,900.9
EUX 中央級 兼延所得税资产	-	
t 他资产	-	
		CO 101 101 0
bec 2000年	69,136,397.05 本期末	60,484,134.0 上年度末
负债和所有者权益	李明末 2014年12月31日	上平及木 2013年12月31日
负债:	-	
豆期借款	-	
と 易性金融负债	-	
了生金融负债	-	
以出回购金融资产款	-	
立付证券清算款	485,713.90	713,229.3
拉付赎回款	-	
立付管理人报酬	35,925.74	28,504.3
位付托管费	11,975.24	9,501.4
立付銷售服务费	-	
立付交易费用	-	
立交税费	-	
並付利息	-	
位付利润	-	
 整延所得税负债	-	
其他负债	131,693.47	111,470.6
负债合计	665,308.35	862,705.7
所有者权益:	_	
以收基金	49,622,120.00	50,622,120.0
and property and	18,848,968.70	8,999,308.2
た分配利润	68,471,088.70	59,621,428.2
下分配 門洞 所有者权益合计 负债和所有者权益总计	69,136,397.05	60,484,134.0

本报告期;2014年1月1日至2014年12月31日 单位:人民币			
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4月25日(基金合同生效日)至2013年 12月31日	
一、收入	14,068,143.29	10,913,453.27	
1.利息收入	32,339.98	187,565.18	
其中:存款利息收入	32,339.98	187,565.18	
债券利息收人	-	-	
资产支持证券利息收入	-	-	
买人返售金融资产收入	-	-	
其他利息收入	-	-	
2.投资收益(损失以"-"填列)	9,177,645.45	3,300,494.44	
其中:股票投资收益	8,004,425.39	2,251,657.24	
基金投资收益	194,368.06	560,218.76	
责券投资收益	-	-	
资产支持证券投资收益	-	-	
衍生工具收益	-	-	
及利收益	978,852.00	488,618.44	
.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,725,150.11	6,654,894.54	
1.汇兑收益(损失以"-"号填列)	238,022.29	403,646.88	
.其他收入(损失以"-"号填列)	-105,014.54	366,852.23	
成:二、费用	1,341,656.93	1,065,768.23	
. 管理人报酬	475,392.61	340,666.53	
托管费	158,464.11	113,555.57	
.销售服务费	-	-	
.交易费用	31,328.03	59,897.95	
.利息支出	-	-	
其中:卖出回购金融资产支出	-	-	
其他费用	676,472.18	551,648.18	
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	12,726,486.36	9,847,685.04	
咸:所得税费用	-	-	
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	12,726,486.36	9,847,685.04	

			m-1/4/11/
項目		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(基金净值)	50,622,120.00	8,999,308.29	59,621,428.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动 数(本期利润)	=	12,726,486.36	12,726,486.36
三、本期基金份額交易产生的基金净值 变动数(净值减少以""号填列)	-1,000,000.00	-2,876,825.95	-3,876,825.95
其中:1.基金申购款	43,000,000.00	9,865,233.41	52,865,233.41
.基金赎回款	-44,000,000.00	-12,742,059.36	-56,742,059.36
四、本期向基金份額持有人分配利润产 生的基金净值变动(净值减少以"-"号填 利)	=	=	=
五、期末所有者权益(基金净值)	49,622,120.00	18,848,968.70	68,471,088.70
項目	2013年4	上年度可比期间 月25日(基金合同生效日)至2013年1	2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)	267,622,120.00	=	267,622,120.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动 改(本期利润)	=	9,847,685.04	9,847,685.04
三、本期基金份額交易产生的基金净值 度动数(净值减少以""号填列)	-217,000,000.00	-848,376.75	-217,848,376.75
其中:1.基金申购款	24,000,000.00	2,310,129.76	26,310,129.76
基金赎回款	-241,000,000.00	-3,158,506.51	-244,158,506.51
9、本期向基金份額持有人分配利润产 生的基金净值变动(净值减少以"-"号填 利)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	50,622,120.00	8,999,308.29	59,621,428.29

报表附注为财务报表的组成部分。 本报告页码(序号)从7.1至7.4,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

7-4 基表特注
7-4 基金基本情况
纳斯达克10交易型开放式指数证券投资基金(简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国
监查")证监许可[2013]262号(关于核准纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金募集的批复)核准,由国
监查管理有限公司依照(中华人民共和国证券投资基金)和(纳斯达克100交易型开放式报数证券投资基金会会自同)公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定;首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币
7618,000,000万、迎舍等华永道中天会计师审多所有限公司等华永道中天验全2013第220号验资报告予以验证。
5时中国证监会备案。本基金基金合同于2013年4月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为267,622,
000份基金份额,其中认购资金利息折合,120,00份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,
金托管人为中国建设银行股份有股公司,境外资产托管人为道富银行3起。 treet Bank and Trust Company。经 海证券交易所(以下简称"上交所")上证基字[2013]118号文审批同意,本基金于2013年5月15日在上交所挂牌交为。

易。 根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金包括ETF)、依法发行或上市的其他股票、固定收益类资产、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但资本进行企业。 证监会的相关规定。本基金投资组合中标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。本基金的业绩比较基准为。标的指数为纳斯达克10018增(Navaprillo Index)。 f数(Nasdag-100 Index)。 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2015年3月26日批准报出。

742会计报表的编制基础

74.2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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》,各项具体 会计准则及相关规定以下合称"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粮废第3号 (年度报告审详年度报告》)、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《纳斯达克 100交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表明法74.4所列示的中国证监会发布的有关规定及

10交易要开放式指数证券投资基金 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。
7.4.3罐企业会计准则取其他有关规定的声明
本基金2014年度财务报表符合业会计准则的要求,真实,完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况
以及2014年度财务报表符合业会计准则的要求,真实,完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况
以及2014年度财务报表价值企业会计政策、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。
7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1会计政策更的说明
财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第4号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第5号——长期股权投资》、《企业会计推则第3号——专工车储》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》、要求除《企业会计准则第35号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第35号——金融工具列报》,自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。
7.4.5.2受计估计变更的说明
本基金本报告期未发生会计估计变更。
7.4.6亿项
本基金在本报告期未发生会计估计变更。
7.4.6亿项
和基金本报告期未发生会计估计变更。
7.4.6亿项
和基金本报告期未发生会计估计变更。
7.4.6亿项
和基金本报告期未发光的会员财税[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

7.46税项 根据财政部、国家税务总局财税[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 号关于企业所得稅若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作。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证收范围,不征收营业税。 (2) 自前基金取得的原自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和 法规执行。在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。 (3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和 法规执行。在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。 7.4.7关联方关系

7.1.750/03704	
关联方名称	与本基金的关系
泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
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
富银行(State Street Bank and Trust Company)	境外资产托管人
国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
国电力财务有限公司	基金管理人的股东
大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
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。 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易。 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交易。

		+111.700,117
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4月25日(基金合同生效日)至2013 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	475,392.61	340,666.53
其中:支付销售机构的客户维护费	-	=
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0.60%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: 口管理 k 招酬=前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年

7.4.8.2.2基金托管费	60% / 当牛人奴。	单位:人民币:
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4月25日(基金合同生效日)至2013 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	158,464.11	113,555.57
注,支付基金托管人中国建设银行的托管费	在费率计提 涿口累计至每日日	

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 0.20% / 当年天数。 7.48.3与英庆沙进行银行间则业市场的债券合回购交易 本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。 7.48.4名关联方投资本基金的情况 7.48.41股省期内基金管理人还用固有资金投资本基金的情况 本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金。 7.48.42根仓捐取决金基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。 本基金本报告期末决基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。 本基金本报告期末及上年度末均无联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:人民币元 本期 2014年1月1日至2014年12月31日

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管,按适用利率计息 7-48.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承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助朱有在承销期内参与关联方承销证券的
4.8.7其他关联交易事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。
7.4.9期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.91周认购新发,增度证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末无因认购新发,增度过券而于明末持有的流通受限证券。
4.4.9.期末持有的暂时停牌等流通受限股票。
7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.31银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
7.4.9.31银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未经行间市场债券正回购中作为抵押的债券。
4.4.3.2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

(1) 公允价值 (a) 金融工具公允价值计量的方法

○ 金融工具公允价值计量的方法
 ○ 金融工具公允价值计量结果所属的层次,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;第一层次,相简单产或负债在活跃市场上未经调整的股价。
 第二层水,相简单产或负债的不可观察输入值。
 等等,层次,相关资产或负债的不可观察输入值。
 特殊的以公允价值计量的金融工具
 6 各层次金融工具公允价值
 于2014年1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次的余额为63,749,462,89元,无属于第二层次和第三层次的余额(2015年12月31日;第一层次55,093,133,42元,无属于第二层水和第三层次的余额。
 (a)公允价值所属层次间的重大变动对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停粮。交易不活跃,包括涨跌停时的交易不活跃,或属于非公开发行等情况,本基金不会于停粮日至交易恢复活跃日期间,交易不活跃,期间及限售期间将相关股票的公允价值列人第一层次;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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第二层次。

国第二层次还是第三层次。 (ii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额 平

无。 (0) 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)。 (d) 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

(3)除基金申购款和公允价值外,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

6.2州木仕合「国家(地区	S. / 证分中场的权益权页分中	金额单位:人民币
国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美田	62,020,202.89	90.58
습计	62,020,202.89	90.58
8.3期末按行业分类的权益	益投资组合	

		金额单位:人民币
行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	35,388,735.94	51.68
非必需消费品	11,939,548.88	17.44
保健	9,587,175.80	14.00
必需消费品	2,854,749.08	4.17
工业	1,489,193.26	2.17
电信服务	508,813.39	0.74
材料	251,986.54	0.37
습난	62 020 202 89	90.58

								- DE . 7 CP C 1 1 3 .
序号	公司名称 (英文)	公司名称(中 文)	证券代码	所在证券市 场	所属国家(地 区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
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	Facebook公司	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	纳斯达克	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	4,400	1,561,838.04	2.28

注:1,此处所用证券代码的类别是当地市场代码。 2.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。 8.5报告期内权益投资组合的重大变动 8.5.1累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

				金额单位:人民币
序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买人金额	占期初基金 资产净值比例(%)
1	APPLE INC	AAPL US	5,240,444.33	8.79
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	3,884,658.42	6.52
3	GOOGLE INC-CL C	GOOG US	2,904,073.99	4.87
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	2,097,532.48	3.52
5	INTEL CORP	INTC US	1,849,493.70	3.10
6	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,830,425.16	3.07
7	FACEBOOK INC-A	FB US	1,683,625.01	2.82
8	QUALCOMM INC	QCOM US	1,360,974.50	2.28
9	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	1,321,001.57	2.22
10	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	1,253,344.79	2.10
11	AMGEN INC	AMGN US	919,426.64	1.54
12	CELGENE CORP	CELG US	843,074.81	1.41
13	EBAY INC	EBAY US	812,630.15	1.36
14	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-	MDLZ US	622,002.72	1.04
15	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	583,443.49	0.98
16	STARBUCKS CORP	SBUX US	550,021.67	0.92
17	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	503,083.45	0.84
18	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ESRX US	467,793.58	0.78
19	TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	FOXA US	446,764.29	0.75
20	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	AAL US	445,048.61	0.75
	The second contract of the second of the second of	and the second second		

注:1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。 2.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。 8.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

ド号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比例(%)
1	APPLE INC	AAPL US	7,912,948.37	13.2
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	4,817,583.97	8.6
3	INTEL CORP	INTC US	2,337,624.64	3.9
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,953,070.16	3.2
5	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,932,953.05	3.2
6	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	1,767,863.90	2.9
7	QUALCOMM INC	QCOM US	1,567,561.82	2.0
8	FACEBOOK INC-A	FB US	1,460,864.43	2.4
9	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	1,430,307.87	2.0
10	GOOGLE INC-CL C	GOOG US	1,326,965.15	2.3
11	AMGEN INC	AMGN US	1,119,169.11	1.
12	GOOGLE INC-CL A	GOOGL US	1,005,633.39	1.
13	CELGENE CORP	CELG US	1,003,334.17	1.0
14	EBAY INC	EBAY US	909,630.48	1.:
15	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	775,377.79	1
16	STARBUCKS CORP	SBUX US	660,816.76	1.
17	TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	FOXA US	641,998.46	1.0
18	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	634,944.65	1.0
19	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ESRX US	606,166.55	1.0
20	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	580,659.56	0.9

任::1.1 u.X29/ 用:u.x7 (以=10;x2-y))定三地(加入(v=)。 2. 卖出金鄉按卖出成交金額(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。 8.5.3 収益投资的买人成本总额及卖出收入总额

注:买人股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列。 8.6周末被销等自用等级分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券。 8.7周末按公允价值占基金资产等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。 8.8周末按公允价值占基金资产等但比例大小排名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。 8.9周末按公允价值占基金资产等值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 未基金和报告批审主来按公公价值分基金资产等值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 大社会本报准组工来技会公局行生另

8.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

8.11.1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。 题页、XCTURINGUS。 8.11.2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。

8.11.3期末其他各项资产构成

8 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

	持有人结构								
持有人户数(户)		户均持有的基金份额		机构投资者			个人投资者		
			持有	持有份額		1	寺有份額	占总份额比例	
	1,443 34,388.16				40.10%		29,724,015.00	59.90%	
9.2期	末上市基金前十	-名持有人							
序号		持有人名称			持有份額(份)		占上市总位	分額比例	
1	田都证券有限责	任公司客户信用交易担任	呆证券账户		7,620	0,000.00		15.36%	
2	中	信证券股份有限公司			5,183	2,138.00		10.44%	
3	海通证券股份有	限公司客户信用交易担任	呆证券账户		2,210	0,901.00		4.46%	
4	长江证券-交行-长江证券超越理财量化精选集合资产管 理计划			1,297,389.00				2.61%	
5	中国银河证券股份	有限公司客户信用交易指	旦保证券账户	1,151,000.00			2.32%		
6	平安大华基金-平安银行-平安大华固定收益增强三号特 定客户资			914,710.00			1.849		
7		赵铮		855,000.00			1.729		
8		黄翠林		700,000.00			1.419		
9		彩霞		679,920.00			1.379		
10	蒋燕南			646,300.00			1.309		
9.3期	末基金管理人的	1从业人员持有本	基金的情况	Ī					
	I	英目		持有份	計額总数(份)		占基金总份:	順比例	
基金管理人所有从业人员持有本基金					1	0.00		0.009	
9.4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				

	单位:
基金合同生效日(2013年4月25日)基金份額总額	267,622,120.00
本报告期期初基金份额总额	50,622,120.00
本报告期基金总申购份额	43,000,000.00
减;本报告期基金总赎回份额	44,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	49,622,120.00

§ 11重大事件揭示

\$11里大事件揭示
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基土大人事变动加下。
2014年9月24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》,经本基金管理人第六届
董事会第十分公议审议通过,李吉坚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任

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任 总经理。 报告期内基金托管人重大人事变动如下, 本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金 托管人2014年1月6日及布公告,聘任起观甫方中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金 托管人2014年1月6日及布公告,聘任起观甫方中国建设银行投资托管业务部总经理。 11.3 涉及基金管理人,基金财产,基金好产业务的诉讼 报告期内,本基金投资策略的改变 报告期内,本基金投资策略的改变 报告期内,本基金投资策略的改变 报告期的,本基金投资策略方改变。 11.5 苏金进行审计的会计师事务所情况 本基金自基金仓司年效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。报告年度应支付给聘任会计师 事务所的报酬为2000元,目前的审计机场已提供审计服务的年限为2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定和各支情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况11.7.1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
	交易单元	股票交易		应支付该券商		
券商名称	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
Goldman Sachs International	1	53,710,643.18	59.80%	19,309.88	63.91%	-
Morgan Stanley & Dept. Co. International ple	1	36,106,820.34	40.20%	10,906.04	36.09%	-
Knight Capital Group	1	-	-	-	-	-

注:基金租用席位的选择标准是:
(1)资力健厚,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报告,以及丰富全面的信息服务,能根据基金投资的转定要求,提供专门研究报告。
选择程序是:根据对各证券公司提供的各项投资,研究服务情况的考评结果,将合交易席位租用标准的,由 公司投研业务部门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

							歪铡	毕业:人民印
	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
券商名称	成交金額	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	成交金額	占当期基金成 交总额的比例
Goldman Sachs International	-	-	-	-	-	-	2,809, 552.36	53.17%
Morgan Stanley & Co. International ple	-	-	-	-	-	-	2,474, 702.73	46.83%
E . I . O . I . I . O								