（上接B230版）

金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。 本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。 金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者

(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。 金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.2.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.2.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.2.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.2.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.2.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.2.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

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40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《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37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。

7.2.4.5.2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、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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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征收范围,不征收营业税。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,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
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(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

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

7.2.4.8.1.1应支付关联方的佣金

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,603,786.51
其中:支付销售机构的客户维护费	1,437,399.83

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,逐日累计至每月月底,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 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,267,297.70

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

本基金本报告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

份额单位:份

项目	本期 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金合同生效日(2014年9月15日)持有的基金份额	7,500,000.00
期初持有的基金份额	–
期间申购/买入总份额	–
期间因拆分变动份额	642,298.00
减:期间赎回/卖出总份额	–
期末持有的基金份额	8,142,298.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.53%

注:国泰基金管理有限公司持有原基金金鑫份额为7,500,000.00份,2014年10月24日确权折算份额642,298.00份。

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 2014年9月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	182,257,498.23	1,056,241.73

注:本基金的活期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。

7.2.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末有在承销期间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(2014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

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600401	海润光伏	2014-09-16	2015-09-14	非公开发行	7.72	6.91	3,000,000.00	23,160,000.00	20,730,000.00	–

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.2.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.2.4.9.3.2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。

7.2.4.10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2014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工具中属于第一层级的余额为1,781,482,874.94 元,属于第二层级的余额为30,733,000.00元,无属于第三层级的余额。

(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股票和债券,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)、或属于非公开发行等情况,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将相关股票和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,确定相关股票和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 金鑫证券投资基金

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	2,524,375,488.98	73.87
	其中:股票	2,524,375,488.98	73.87
2	固定收益投资	685,780,410.00	20.07
	其中:债券	685,780,410.00	20.07
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	152,642,181.32	4.47
7	其他各项资产	54,740,309.85	1.60
8	合计	3,417,538,390.15	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	–	–
C	制造业	1,813,657,485.66	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,062,875.76	2.70
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	15,995,000.00	0.47
J	金融业	225,720,859.31	6.68
K	房地产业	111,833,169.85	3.31
L	租赁和商务服务业	112,140,000.00	3.32
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	130,836,098.40	3.87
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	23,130,000.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	2,524,375,488.98	74.76

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	600587	新华医疗	7,200,000	255,240,000.00	7.56
2	000625	长安汽车	13,300,000	182,875,000.00	5.42
3	600885	宏发股份	7,022,924	162,721,149.08	4.82
4	600401	海润光伏	14,715,268	146,564,069.28	4.34
5	002672	东江环保	3,759,658	130,836,098.40	3.87
6	600563	法拉电子	3,396,812	124,934,745.36	3.70
7	002400	省广股份	4,500,000	112,140,000.00	3.32
8	002353	杰瑞股份	2,531,922	106,112,851.02	3.14
9	300146	汤臣倍健	3,107,311	96,264,494.78	2.85
10	600900	长江电力	12,013,572	91,062,875.76	2.70

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	300024	机器人	123,868,130.99	2.99
2	002008	大族激光	118,690,225.57	2.87
3	600563	法拉电子	117,847,896.59	2.85
4	600406	国电南瑞	110,148,929.36	2.66
5	600401	海润光伏	108,644,702.76	2.63
6	002672	东江环保	107,927,232.22	2.61
7	002242	九阳股份	106,050,949.17	2.56
8	000625	长安汽车	104,146,323.23	2.52
9	600835	上海机电	102,784,364.51	2.48
10	600312	平高电气	93,908,747.40	2.27
11	300146	汤臣倍健	92,247,295.59	2.23
12	600000	浦发银行	91,411,242.85	2.21
13	300124	汇川技术	89,125,007.99	2.15
14	002614	蒙发利	82,332,779.12	1.99
15	600067	冠城大通	81,687,378.76	1.97
16	600900	长江电力	76,039,508.33	1.84
17	601318	中国平安	71,557,558.39	1.73
18	600703	三安光电	64,687,106.39	1.56
19	600196	复星医药	64,482,093.27	1.56
20	000919	金陵药业	62,962,166.70	1.52

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	002400	省广股份	201,594,041.10	4.87
2	600597	光明乳业	191,110,438.46	4.62
3	600000	浦发银行	173,262,704.93	4.19
4	300124	汇川技术	147,756,936.82	3.57
5	600887	伊利股份	136,340,730.61	3.29
6	600587	新华医疗	132,949,634.53	3.21
7	600827	百联股份	129,278,439.65	3.12
8	600637	百视通	120,160,320.64	2.90
9	000625	长安汽车	119,814,684.44	2.90
10	002353	杰瑞股份	119,641,209.00	2.89
11	600835	上海机电	119,045,874.48	2.88
12	002024	苏宁云商	96,933,678.29	2.34
13	600196	复星医药	95,971,044.07	2.32
14	002242	九阳股份	90,145,591.20	2.18
15	600406	国电南瑞	82,586,061.44	2.00
16	600073	上海梅林	76,569,711.60	1.85
17	300024	机器人	74,224,584.13	1.79
18	600837	海通证券	74,209,794.32	1.79
19	600583	海油工程	67,427,528.57	1.63
20	300182	捷成股份	66,168,586.97	1.60

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

序号	2,756,006,186.61
卖出股票的收入(成交)总额	3,213,932,660.69

注:买入股票成本、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,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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	246,402,062.00	7.30
2	央行票据	–	–
3	金融债券	430,021,000.00	12.74
	其中:政策性金融债	430,021,000.00	12.74
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	9,357,348.00	0.28
8	其他	–	–
9	合计	685,780,410.00	20.31

8.1.6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细

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	019322	13国债22	1,603,100	160,342,062.00	4.75
2	130243	13国开43	1,000,000	100,060,000.00	2.96
3	090417	09农发17	800,000	79,904,000.00	2.37
4	090311	09进出11	800,000	79,896,000.00	2.37
5	130428	13农发28	700,000	70,070,000.00	2.08

8.1.7期末按公允价值占基金资产净值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。

8.1.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.9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

本基金本报告期末未持有权证。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

8.1.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1 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。

8.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.1.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.1.12.3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	656,447.70
2	应收证券清算款	34,345,704.85
3	应收股利	–
4	应收利息	19,414,002.93
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	324,154.37
8	其他	–
9	合计	54,740,309.85

8.1.12.4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。

8.1.12.5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。

8.2 国泰金鑫股票型证券投资基金

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	1,746,207,874.94	84.74
	其中:股票	1,746,207,874.94	84.74
2	固定收益投资	66,008,000.00	3.20
	其中:债券	66,008,000.00	3.20
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	183,650,933.17	8.91
7	其他各项资产	64,772,060.57	3.14
8	合计	2,060,638,868.68	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	834,736,031.20	46.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,388,889.98	5.28
E	建筑业	20,173,836.00	1.13
F	批发和零售业	42,419,514.87	2.37
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	–	–
J	金融业	402,637,126.27	22.53
K	房地产业	192,718,975.14	10.78
L	租赁和商务服务业	97,515,000.00	5.46
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	51,606,131.04	2.89
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	10,012,370.44	0.56
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,746,207,874.94	97.71

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	000625	长安汽车	10,592,684	174,037,798.12	9.74
2	600587	新华医疗	5,315,700	166,540,881.00	9.32
3	601318	中国平安	2,153,782	160,909,053.22	9.00
4	601601	中国太保	3,859,389	124,658,264.70	6.98
5	002400	省广股份	4,500,000	97,515,000.00	5.46
6	600900	长江电力	8,846,194	94,388,889.98	5.28
7	000786	北新建材	3,508,531	88,695,663.68	4.96
8	000002	万 科A	4,540,769	63,116,689.10	3.53
9	002470	金正大	2,181,656	58,686,546.40	3.28
10	600067	冠城大通	7,032,272	56,961,403.20	3.19

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	601009	南京银行	88,540,248.70	4.95
2	000786	北新建材	85,485,252.41	4.78
3	002470	金正大	62,353,979.00	3.49
4	002497	雅化集团	53,633,940.40	3.00
5	002444	巨星科技	51,643,102.84	2.89
6	002588	史丹利	50,037,118.54	2.80
7	600511	国药股份	48,070,621.64	2.69
8	600657	信达地产	45,059,295.66	2.52
9	000401	冀东水泥	42,064,054.75	2.35
10	600521	华海药业	40,377,244.49	2.26
11	002179	中航光电	33,370,323.82	1.87
12	002672	东江环保	31,723,959.74	1.78
13	601601	中国太保	29,679,494.02	1.66
14	601628	中国人寿	25,572,572.14	1.43
15	600031	三一重工	25,047,259.82	1.40
16	600388	龙净环保	23,852,871.39	1.33
17	600401	海润光伏	23,160,000.00	1.30
18	601318	中国平安	20,449,391.85	1.14
19	000024	招商地产	18,256,631.47	1.02
20	002572	索菲亚	13,473,770.81	0.75

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	600885	宏发股份	143,289,781.20	8.02
2	600401	海润光伏	127,199,293.83	7.12
3	601009	南京银行	123,260,905.58	6.90
4	002672	东江环保	106,195,278.35	5.94
5	600563	法拉电子	102,892,681.82	5.76
6	600312	平高电气	96,895,940.05	5.42
7	600109	国金证券	95,265,517.86	5.33
8	002444	巨星科技	95,258,608.65	5.33
9	002353	杰瑞股份	90,037,296.21	5.04
10	300146	汤臣倍健	86,419,117.89	4.84
11	002179	中航光电	75,649,509.64	4.23
12	002008	大族激光	72,887,798.59	4.08
13	600587	新华医疗	69,333,808.20	3.88
14	002614	蒙发利	61,886,304.64	3.46
15	000625	长安汽车	60,321,850.18	3.38
16	000970	中科三环	51,717,975.53	2.89
17	600525	长园集团	50,932,256.96	2.85
18	002497	雅化集团	50,877,026.94	2.85
19	300024	机器人	46,696,713.66	2.61
20	002023	海特高新	31,721,139.39	1.78

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	963,719,123.79
卖出股票的收入(成交)总额	2,028,129,141.63

注:买入股票成本、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,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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	56,005,000.00	3.13
2	央行票据	–	–
3	金融债券	10,003,000.00	0.56
	其中:政策性金融债	10,003,000.00	0.56
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	66,008,000.00	3.69

8.2.6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细

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	019306	13国债06	460,000	46,000,000.00	2.57
2	019207	12国债07	100,000	10,005,000.00	0.56
3	110214	11国开14	100,000	10,003,000.00	0.56

8.2.7期末按公允价值占基金资产净值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。

8.2.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.2.9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

本基金本报告期末未持有权证。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.10.1 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。

8.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

8.2.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.11.1 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。

8.2.12 投资组合报告附注

8.12.1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"公告其子公司违规情况外),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。

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《中国证券监督管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,没收海联讯保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2,867万元,并处以440万元罚款;同时对保荐人韩长风、霍永涛给予警告,并分别处以30万元罚款,撤销证券从业资格。

本基金管理人此前投资中国平安股票时,严格执行了公司的投资决策流程,在充分调研的基础上,按规定将该股票纳入本基金股票池,而后进行了投资,并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后,本基金管理人就中国平安子公司受处罚事件进行了及时分析和研究,认为平安证券存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响,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研究。

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。

8.2.12.3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	591,956.08
2	应收证券清算款	38,632,470.63
3	应收股利	–
4	应收利息	1,533,269.06
5	应收申购款	24,014,364.80
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	64,772,060.57

8.2.12.4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 国泰金鑫股票型证券投资基金

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
46,473	33,002.32	662,543,132.76	43.20%	871,173,597.88	56.80%

9.1.2 金鑫证券投资基金

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
49,288	60,866.74	1,997,488,619.00	66.58%	1,002,511,381.00	33.42%

9.2期末上市基金前十名持有人

9.2.1金鑫证券投资基金

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(集团)公司	388,751,485.00	12.96%
2	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002沪	230,441,345.00	7.68%
3	中国人寿保险股份有限公司	179,291,632.00	5.98%
4	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	145,224,781.00	4.84%
5	中国太平洋保险(集团)股份有限公司-集团本级-自有资金-012G-ZY001沪	77,325,302.00	2.58%
6	伦敦市投资管理有限公司-客户资金	75,439,678.00	2.51%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	72,889,450.00	2.43%
8	中国太平洋财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品-013C-CT001沪	69,295,866.00	2.31%
9	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	63,324,888.00	2.11%
10	中国人寿保险股份有限公司	53,538,855.00	1.78%

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 国泰金鑫股票型证券投资基金

项目	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	0.00	0.00%

9.3.2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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4金鑫证券投资基金

9.4.1期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

9.4.2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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年9月15日)基金份额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,249,012,208.50
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,972,214,637.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	256,919,160.00
本报告期期末基金份额总额	1,533,716,730.64

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

金鑫证券投资基金(以下简称"金鑫基金",基金代码500011)以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会投票表决起止时间为自2014年7月11日起至2014年8月11日17:00止。参加本次大会投票表决的金鑫基金基金份额持有人及代理人所持基金份额共计1,838,260,236份,占权益登记日金鑫基金总份额30亿份的61.28%,达到法定开会条件,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鑫证券投资基金基金合同》的有关规定。

本次大会审议了《关于金鑫证券投资基金转型有关事项的议案》(以下简称"本次会议议案"),并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案进行表决,表决结果为:有效表决票所代表的基金份额为1,838,260,236份,其中,1,837,960,236份基金份额同意,300,000份基金份额反对,0份基金份额弃权。同意本次会议议案的基金份额占参加本次大会投票表决的持有人及代理人所持基金份额总数的99.98%,达到参加本次大会投票表决的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鑫证券投资基金基金合同》的有关规定,本次会议议案获得通过。

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:

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次会议审议通过,李志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11月03日发布公告,聘任赵观甫为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130,000元。

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、托管人托管业务部门及其相关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 国泰金鑫股票型证券投资基金

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	
中信证券	2	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	2	–	–	–	–	–
华融证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	2	–	–	–	–	–
宏源证券	2	–	–	–	–	–
国盛证券	2	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	901,006,442.13	30.35%	820,272.40	30.35%	–
中信建投	3	722,897,101.60	24.35%	658,126.84	24.35%	–
招商证券	3	707,481,489.41	23.83%	644,093.55	23.83%	–
中投证券	2	257,815,496.01	8.68%	234,715.69	8.68%	–
平安证券	3	207,727,244.71	7.00%	189,116.08	7.00%	–
上海证券	1	164,515,543.45	5.54%	149,776.75	5.54%	–
国泰君安	2	7,244,948.11	0.24%	6,596.01	0.24%	–

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:根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果,符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。

11.7.1.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

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	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	10,490,480.00	100.00%	20,000,000.00	100.00%	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
华融证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–

11.7.2 金鑫证券投资基金

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	
民生证券	2	–	–	–	–	–
国盛证券	2	–	–	–	–	新增
华融证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	3	1,462,183,666.49	24.51%	1,331,171.50	24.51%	–
中信建投	3	878,898,655.45	14.73%	800,151.79	14.73%	–
上海证券	1	788,213,817.90	13.21%	717,593.57	13.21%	–
国泰君安	2	589,557,189.10	9.88%	536,730.82	9.88%	–
信达证券	1	533,913,611.88	8.95%	486,076.51	8.95%	–
银河证券	2	443,890,328.18	7.44%	404,118.45	7.44%	–
中投证券	2	343,738,984.08	5.76%	312,937.66	5.76%	–
东方证券	1	322,827,488.15	5.41%	293,901.51	5.41%	–
平安证券	3	276,770,235.28	4.64%	251,972.02	4.64%	–
中信证券	2	166,327,582.76	2.79%	151,423.96	2.79%	–
宏源证券	2	158,469,725.94	2.66%	144,269.94	2.66%	–

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:根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果,符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。

11.7.2.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

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	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	30,351,587.67	17.40%	–	–	–	–
中信建投	2,385,975.58	1.37%	80,000,000.00	100.00%	–	–
银河证券	11,886,332.05	6.82%	–	–	–	–
东方证券	100,796,103.37	57.80%	–	–	–	–
宏源证券	28,973,670.15	16.61%	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–
华融证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–