

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:二〇〇九年三月三十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和合规性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认,并由董监高签署。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置、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。

基金销售机构承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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及其摘要。

本报告中的财务数据未经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:国泰基金泰
基金代码:500001
基金运作方式:契约型封闭式

基金合同生效日:1998年3月27日

报告期末基金份额总额:2,000,000,000份

基金合同存续期:至2013年3月26日止

基金上市的证券交易所:上海证券交易所

上市日期:1998年4月7日

2.2 基金产品说明

投资目标:本基金是平衡型基金,并以价值型和成长型股票为投资重点;投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下,追求长期稳定的收益。

本基金投资时,根据宏观经济环境及其对证券市场的影响,决定投资策略;根据政策的变化、利率的走势、法定存款在投资组合中的比例;根据对行业及地区经济发展状况的深入研究,决定股票投资重点,根据对上市公司的调研研究,确定具体的股票投资组合。

本基金的股票投资将以中长期投资为主,在充分研究的前提下,主要投资价值型和成长型股票中被低估的股票,以实现基金资产的稳定增值。

在股票投资组合中,将保留一定比例的短期投资,短期投资主要根据市场化、相对择优、灵活投资,在防范风险的前提下,增加基金收益。

为保证基金资产的流动性和收益性,在国债投资组合中,长期国债和短期国债将保持适当的比例。

在不违反《证券投资基金法》及配套规则等法律法规及基金合同有关约定的前提下,基金管理人可根据具体情况,对基金投资组合进行调整。

风险收益特征:承担中等风险、获取中等的超额收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

名称:丁昌云
姓名:落松云
信息披露负责人:电子邮件:kxh@lifund.com
客户服务电话:400-888-8688
传真:021-38561800

2.4 信息披露方式

基金年度报告公告的管理人互联网网址:<http://www.gtfund.com>

基金年度报告置地:上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2008年 2007年 2006年

本期实现收益 -648,755,238.04 3,795,204,105.55 783,456,462.04

本期利润 -2,557,847,870.11 4,006,807,730.89 2,231,718,432.12

加权平均基金份额本期利润 -1,2789 2,0034 1,1159

本期基金份额净值增长率 -47.93% 107.28% 114.00%

3.1.2 本期利润和指标

2008年 2007年 2006年

期初可供分配基金份额利润 -0.1789 1,9237 0.3161

本期基金资产净值 1,642,180,046.67 7,616,027,917.15 4,189,220,186.26

期末基金份额净值 0.8211 3,8080 2.0946

注:1)本产品已实现收益指基金本期利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额,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)所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将降低。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率(%) 份额净值增长率差值(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -5.95% 3.60% - -

过去六个月 -18.01% 3.20% - -

过去一年 -47.93% 3.49% - -

过去三年 138.99% 3.48% - -

过去五年 124.43% 3.04% - -

自基金合同生效起至今 276.86% 2.62% - -

注:本基金根据基金合同无业绩比较基准。

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

基金证券投资基金 累计份额净值增长率历史走势图 (1998年3月27日至2008年12月31日)

注:本基金的合同生效日为1998年3月27日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年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

项目 2008年1月1日至2008年12月31日 2007年1月1日至2007年12月31日

本期 -2,425,445,001.37 4,188,191,110.39

1.利息收入 37,426,764.47 46,717,576.42

其中:存款利息收入 2,508,811.87 3,526,838.97

债券利息收入 34,656,298.35 38,836,238.03

货币市场基金收益 - -

贷款利息收入 261,654.25 4,354,500.00

其他利息收入 - -

2.投资收益(损失以"-"填列) -553,743,046.69 3,929,839,105.23

其中:股票投资收益 -558,633,439.94 3,898,298,984.76

债券投资收益 3,963,490.60 -8,583,581.54

资产支持证券投资收益 - -

衍生工具收益 -10,320,954.12 13,862,425.73

股权投资收益 11,247,857.07 26,261,276.28

3.公允价值变动收益(损失以"-"填列) -1,909,172,632.07 211,603,630.34

其中:股票投资 43,912.92 30,798.40

债券投资 -13,402,868.74 -181,383,379.50

4.其他收入(损失以"-"填列) -50,247,064.41 -89,933,300.79

5.利息支出 -8,423,278.60 -14,988,883.60

6.费用支出 -64,122,693.94 -59,040,187.94

7.利润分配 -3,179,432.55 -15,278,409.16

8.其他费用 -6,430,399.24 -2,142,598.01

9.利得损失(填正) -2,557,847,870.11 4,006,807,730.89

注:1)本基金所持有的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.2 本期表现

会计主体:国泰证券投资基金

本报告期内:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度 每份基金 份额分红 现金形式发放总额 再投资形式发放总额 年度利润分配合计 备注

2008年 17,080 3,416,000,000.37 - 3,416,000,000.37 2007年度收益分配

2007年 2,900 580,000,000.00 - 580,000,000.00 2006年度收益分配

2006年 - - - -

合计 19,980 3,996,000,000.37 - 3,996,000,000.37

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的情况

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日,是经中国证监会证监基字[1998]5号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,公司注册地址上海,并在北京设有分公司。

截至2008年12月31日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:基金金泰、基金金鑫、基金金盛,以及4只开放式证券投资基金:国泰金鹏增长证券投资基金、国泰金龙债券型证券投资基金(包括货币型基金)、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(以下简称“国泰金鼎”)、国泰金泰货币市场基金,并稳健地回报投资者。

本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具等金融工具,并根据基金合同的约定,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.2 基金管理人对报告期内基金运作的总体评价

报告期内,基金管理人获得基金业协会颁发的“2008年度最佳基金公司”奖项,并荣获“2008年度最佳基金公司”、“2008年度最佳基金管理人”、“2008年度最佳基金经理”、“2008年度最佳基金团队”、“2008年度最佳基金经理”等五项大奖。

4.3 基金管理人对基金未来运作的展望

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.4 管理人对报告期内基金运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.5 管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.6 管理人对基金未来运作的展望

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.7 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.8 管理人对基金未来运作的展望

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.9 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.10 管理人对基金未来运作的展望

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.11 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.12 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.13 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.14 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

4.15 管理人对基金未来运作的说明

本基金在2009年将根据宏观经济形势,结合政策变化,适时调整投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。