

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：二〇一二年三月二十九日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会对本报告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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金经理签发。

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2012年3月26日核本报告中的财务数据、净值表现、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

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，应阅读年度报告全文。

本报告的财务资料经审计，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2011年1月1日起至2011年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称 国泰金鼎价值混合

基金代码 519021

交易代码 519021

基金运作方式 约定期开放型

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

报告期基金总资产 6,512,081,012.74元

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 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，不断超越业績比较基准的稳定的回报率。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的大宗资产定价方法将通过宏观经济运行、国家财政和货币政策、国家产业政策以及货币市场资金环境、证券市场资金的分布、行业研究与业务部门均具有丰富的专业分析、会计算评估等专业基金行业经验及专业能力。基金经理认为如认为评估有被低估或有失充份的情况下，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何利益的重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金已于2011年实施利润分配1,753,663,245.34元。

截止本报告期末，本基金利润未进行分配为-95,506,359.96元。

## § 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法规情况说明

本基金的债券投资操作将通过长期利率趋势分析为基础，结合中期的经济周期、宏观经济方向及收益率曲线变化，通过债券置换和收益曲线配置方法，实现债券的投资管理。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人严格按照有关规定、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份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实现利润总额为1,753,663,245.34元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的准确、真实、完整、及时情况的说明

本托管人已复核审查了本报告中的财务数据、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，确认本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

## § 6 审计报告

本基金2011年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登录于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

7.7 年度财务报告表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

3.1 主要会计数据和财务指标 金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标：2011年 2010年 2009年

本期实现收益 704,505,991.04 421,928,655.34 90,517,824.22

本期利润 -1,120,230,064.85 543,437,249.82 3,609,886,112.69

加权平均基金份额本期利润 -0.2442 0.0966 0.5628

本期基金份额净增长率 -23.76% 10.11% 84.39%

3.1.2 期末数据和指标：2011年末 2010年末 2009年末

期末可供分配基金份额利润 -0.0147 0.1195 0.0601

期末基金资产净值 3,364,355,120.50 5,673,165,040.76 6,242,946,284.26

期末基金份额净值 0.593 1.101 1.016

注：①本期实现收益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入、减去公允价值变动收益(利得扣除相关费用后的余额)，本期利润为本期公允价值变动收益；②本期可供基金份额指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

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(%) 增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -3.32% 0.95% -3.94% 0.80% 0.62% 0.15%

过去六个月 -14.67% 0.93% -12.91% 0.80% -1.76% 0.13%

过去一年 -23.76% 0.93% -13.17% 0.75% -10.59% 0.18%

过去三年 54.80% 1.24% 18.61% 0.99% 36.19% 0.25%

自基金合同生效起至今 13.14% 1.61% -16.58% 1.29% 29.72% 0.32%

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

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图

2007年4月11日至2011年12月31日

注：本基金转型日期为2007年4月11日，本基金基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

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

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱状图对比

注：2007年计算期间为基金转型日2007年4月11日至2007年12月31日，未按整个自然年度进行折算。

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10份基金份额 现金分红金额 再投股形式发放总金额 年度利润的分配合计 备注

2011年 2.690 1,287,817,251.61 465,846,029.73 1,753,663,245.34

2010年 0.160 62,196,265.05 34,018,814.06 96,271,083.11

2009年 2.000 881,272,296.24 355,285,386.20 1,236,557,682.44

合计 4.850 2,231,385,776.90 3,006,233,994.00 5,095,206,492.00

注：本基金的基金管理人于2011年1月11日公告以2010年12月31日分配收益基准日的基金净值为基准，向截至2011年1月10日在本基金登记机构登记在册的全体基金份额持有人，按每10份基金份额派发红利1.68元。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

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[9995]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1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至2011年1月31日，本基金的基金管理人中国证监会证监基字[9995]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1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至2011年1月31日，本基金管理人中国证监会证监基字[9995]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1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至2011年1月31日，本基金管理人中国证监会证监基字[9995]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1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。