

2012 年度报告摘要

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	600660	福建玻璃	1,000,000	8,770,000.00	8.66
2	600335	国机汽车	550,395	6,885,441.45	6.80
3	300488	蓝盾光电	245,283	5,641,500.00	5.57
4	002140	华信科技	256,178	5,501,792.44	5.40
5	300043	辉丰化学	296,627	4,879,519.05	4.82
6	600572	康思贝	449,956	4,387,071.00	4.33
7	000069	华侨城A	500,000	3,750,000.00	3.70
8	601888	中国国旅	130,000	3,564,600.00	3.52
9	300387	春晖股份	240,000	2,735,600.00	2.70
10	600408	中创东	180,000	2,500,000.00	2.46

注：投资者了解本基金投资所涉及的有关事项，应阅读关于本基金投资所持有品种的年度报告公告文、1报告期内前十大股票投资组合的重大变动。

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	002073	铁公鸡股份	8,820,388.60	8.71
2	600660	福耀玻璃	8,488,550.32	8.38
3	600335	国机汽车	7,963,427.79	7.86
4	000069	华侨城A	6,216,686.14	6.14
5	601118	中国平安	5,984,300.00	5.91

6	002271	东方雨虹	5,148,866.09	5.08
7	002140	东华科技	4,979,199.49	4.91
8	002430	杭氧股份	4,940,494.71	4.88
9	002567	唐人神	4,661,549.50	4.60
10	300088	蓝色光标	4,612,572.60	4.55
11	300043	星辉车模	4,596,843.29	4.54
12	600030	中信证券	4,488,866.88	4.43
13	002638	勤上光电	4,306,857.68	4.25
14	600572	康恩贝	4,090,616.93	4.04
15	002051	中国医药	4,077,140.28	4.02
16	600031	三一重工	4,055,664.09	4.00
17	600518	康美药业	4,000,731.48	3.95
18	300289	利德曼	3,988,305.00	3.94
19	600048	保利地产	3,920,864.03	3.87

20	000963	山东黄金	3,884,415.76	3.83
21	000285	上海临港	3,877,676.60	3.83
22	601601	中国铁建	3,850,225.33	3.80
23	600976	武汉燃气	3,765,183.41	3.72
24	601888	中国国航	3,704,791.11	3.66
25	000528	柳工	3,547,274.00	3.50
26	000669	顺丰科技	3,378,426.00	3.33
27	200134	大富科技	3,370,523.20	3.33
28	600382	天地科技	3,222,826.00	3.33
29	300241	瑞丰光电	3,134,202.00	3.09
30	002457	青龙管业	3,117,772.89	3.08
31	002662	京威股份	3,083,859.64	3.04
32	300147	雪雪国际	3,016,830.94	2.98
33	000968	现代石化	3,013,049.15	2.97
34	600925	高新张铜	2,987,212.33	2.97

35	002413	海源煤电	2,787,229.23	2.93
36	600837	海通证券	2,946,010.00	2.91
36	002306	湘鄂情	2,896,373.59	2.86
37	600085	同仁堂	2,794,524.60	2.76
38	000276	广发证券	2,504,287.00	2.47

39	002253	天瑞股份	2,442,583.00	2.41
40	300128	德管新材	2,428,829.94	2.40
41	600383	金地集团	2,309,530.00	2.28
42	600489	中金黄金	2,296,403.89	2.28
43	600547	山东黄金	2,215,975.11	2.19
44	002298	建研集团	2,102,945.39	2.08
45	601336	新华保险	2,101,973.80	2.07

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	002073	软控股份	7,382,149.31	7.29
2	002638	勤上光电	5,049,669.21	4.98
3	601318	中国平安	4,796,872.85	4.73
4	002051	中工国际	4,651,868.90	4.59
5	300289	利德曼	4,241,686.30	4.19
6	600976	武汉健民	3,954,562.90	3.90

7	002385	大北农	3,900,584.98	3.85
8	600030	中信证券	3,809,209.68	3.76
9	600031	三一重工	3,726,352.44	3.68
10	600518	康美药业	3,711,676.33	3.66
11	600048	保利地产	3,546,163.73	3.50
12	000983	西山煤电	3,336,991.89	3.29

13	002662	京威股份	3,232,587.11	3.19
14	002415	海康威视	3,073,838.07	3.03
15	601601	中国太保	3,070,803.32	3.03
16	000528	柳工	3,059,545.17	3.02

17	300134	大富科技	3,045,173.44	3.01
18	002271	东方雨虹	3,011,482.23	2.97
19	300241	瑞丰光电	2,991,339.03	2.95
20	000660	领丰科技	2,840,500.13	2.81

20	600067	同益新材	2,049,356.12	2.01
21	600085	同仁堂	2,790,434.08	2.75
22	002567	唐人神	2,770,901.00	2.73
23	000069	华侨城A	2,768,313.81	2.73
24	600582	天地科技	2,744,044.25	2.71

24	000382	天地股份	2,789,299.23	2.71
25	002353	杰瑞股份	2,725,371.49	2.69
26	002430	杭氧股份	2,696,402.75	2.66
27	300128	锦富新材	2,656,697.42	2.62
28	000069	张 江 药 房	2,627,046.19	2.60

28	000908	烽火电子	2,037,943.18	2.00
29	002457	青龙管业	2,625,169.80	2.59
30	600837	海通证券	2,609,258.48	2.58
31	002306	湘鄂情	2,488,731.14	2.46

注：卖出金额按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）计算，买入金额按照买入证券数量乘以买入均价。

买入股票的成本(成交)总额	227,370,271.43
卖出股票的收入(成交)总额	144,294,908.43

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。

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,001,600.00	3.05

3	其中：政策性金融债	4,001,600.00	3.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

6	中期票据			
7	可转换债			
8	其他			
9	合计		4,001,600.00	3.95

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	120305	12进出05	40,000	4,001,600.00	3.95

8.7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。

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

8.9投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	3,333.33
2	应付证券款	

3	应收股利	-
4	应收利息	105,243.26
5	应收申购款	65,878.10
6	其他应收款	-
7	坏账费用	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,454.69

8.9.4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。

8.9.5 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

份数单位：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

1,651	63,390.92	5,989,199.01	5.72%	98,669,215.52	94.28%
-------	-----------	--------------	-------	---------------	--------

9.2期末基金管理人从业的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	89,931.42	0.09%

注:1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含);

基金合同生效日(2012年3月20日)基金份额总额	409,286,744.50
本报告期基金总申购份额	4,047,973.79
减:本报告期基金总赎回份额	308,676,303.76
本报告期基金份额变动份额	

本报告期末基金份额总额	104,658,414.53
-------------	----------------

§11 重大事件揭示

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重大人事变动如下：
2012年8月22日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更的公告》，经本基金管理人第五届董事会第十五次会议审议通过，同意督察员李峰女士因工作需要离职，林海申先生出任公司督察长。
2012年11月13日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更的公告》，经本基金管理

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本基金自基金合同生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50,000.00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	股票交易金额	佣金
招商证券	1	1,000,000.00	10,000.00
光大证券	1	1,000,000.00	10,000.00
中信证券	1	1,000,000.00	10,000.00
国泰君安	1	1,000,000.00	10,000.00
华泰证券	1	1,000,000.00	10,000.00
中信建投	1	1,000,000.00	10,000.00
海通证券	1	1,000,000.00	10,000.00
银河证券	1	1,000,000.00	10,000.00
东方证券	1	1,000,000.00	10,000.00
兴业证券	1	1,000,000.00	10,000.00
安信证券	1	1,000,000.00	10,000.00
方正证券	1	1,000,000.00	10,000.00
申万宏源	1	1,000,000.00	10,000.00
国信证券	1	1,000,000.00	10,000.00
广发证券	1	1,000,000.00	10,000.00
西南证券	1	1,000,000.00	10,000.00
长江证券	1	1,000,000.00	10,000.00
信达证券	1	1,000,000.00	10,000.00
国联证券	1	1,000,000.00	10,000.00
浙商证券	1	1,000,000.00	10,000.00
东吴证券	1	1,000,000.00	10,000.00
渤海证券	1	1,000,000.00	10,000.00
山西证券	1	1,000,000.00	10,000.00
中原证券	1	1,000,000.00	10,000.00
恒泰证券	1	1,000,000.00	10,000.00
华创证券	1	1,000,000.00	10,000.00
华龙证券	1	1,000,000.00	10,000.00
国盛证券	1	1,000,000.00	10,000.00
华鑫证券	1	1,000,000.00	10,000.00
方正证券	1	1,000,000.00	10,000.00
光大证券	1	1,000,000.00	10,000.00
招商证券	1	1,000,000.00	10,000.00
中信证券	1	1,000,000.00	10,000.00
国泰君安	1	1,000,000.00	10,000.00
华泰证券	1	1,000,000.00	10,000.00
中信建投	1	1,000,000.00	10,000.00
海通证券	1	1,000,000.00	10,000.00
银河证券	1	1,000,000.00	10,000.00
东方证券	1	1,000,000.00	10,000.00
兴业证券	1	1,000,000.00	10,000.00
安信证券	1	1,000,000.00	10,000.00
方正证券	1	1,000,000.00	10,000.00
申万宏源	1	1,000,000.00	10,000.00
国信证券	1	1,000,000.00	10,000.00
广发证券	1	1,000,000.00	10,000.00
西南证券	1	1,000,000.00	10,000.00
长江证券	1	1,000,000.00	10,000.00
信达证券	1	1,000,000.00	10,000.00
国联证券	1	1,000,000.00	10,000.00
浙商证券	1	1,000,000.00	10,000.00
东吴证券	1	1,000,000.00	10,000.00
渤海证券	1	1,000,000.00	10,000.00
山西证券	1	1,000,000.00	10,000.00
中原证券	1	1,000,000.00	10,000.00
恒泰证券	1	1,000,000.00	10,000.00
华创证券	1	1,000,000.00	10,000.00
华龙证券	1	1,000,000.00	10,000.00
国盛证券	1	1,000,000.00	10,000.00
华鑫证券	1	1,000,000.00	10,000.00

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	
德邦证券	1	230,349,621.45	61.98%	194,956.52	61.13%	

国元证券	1	250,347,021.40	61.20%	124,200.02	61.12%	
国元证券	1	117,284,623.11	31.56%	102,091.79	32.01%	-
东海证券	1	24,030,935.30	6.47%	21,878.36	6.86%	-

注：基金租用席位的选择标准是：
 ①实力雄厚，信誉良好；

2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营处于稳定;

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) 公司具有较较强的研究能力,能及时、全面、定期提供具有相当质量的大于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究资料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

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

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

德邦证券	-	-	10,000,000.00	0.82%	-	-
国元证券	-	-	1,158,000,000.00	95.39%	-	-
东海证券	-	-	46,000,000.00	3.79%	-	-
