

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
报告送出日期:二〇一四年八月二十九日

1. 基金管理人的董事会、董事保证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。本公司承诺在公告三日内披露。

基金管理人:国泰基金管理有限公司根据其基金合同规定,于2014年3月26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,确认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,也不保证最低收益。

本基金的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明书及其更新。

本半年度报告摘要摘录了半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2. 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)

基金代码 160012

交易代码 上市契约开立方式

上市时间 2010年3月16日

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

期末基金总资产 129,734,922.01

基金份额净值 1.00

基金总资产/基金份额总额

基金总资产/上市的证券交易所

上市日期 2013年2月27日

2.2 基金产品说明

投资目标 保持价值投资的理念,力争在有效控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。

(一)产品配置

本基金的资产配置策略主要通过对宏观经济运行状况、国家财政货币政策、国家产业政策以及海外市场分析,重点考察股票估值水平,使用PE(市盈率)和风险收益比等指标评价股票的投资价值。

1. 资产配置(Fed model)

本基金采用资产配置模型,通过综合考虑宏观经济、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

2. 行业配置

本基金将根据宏观经济形势、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

3. 行业配置

本基金将根据宏观经济形势、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

(四)行业配置

本基金将根据宏观经济形势、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

(五)风险管理策略

本基金将根据宏观经济形势、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

4. 风险控制策略

本基金将根据宏观经济形势、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

5. 投资组合管理

本基金将根据宏观经济形势、国家政策和货币供应量、股票市场的估值水平、股票的风险收益比等指标,在资产配置中重视股票与债券的相对投资价值。

6. 半年度财务会计报告/未经审计

7. 托管人报告

8. 信息披露方式

9. 主要财务指标和基金净值表现

10. 基金管理人和基金托管人

11. 重要提示

12. 基金管理人及其基金经理的简介

13. 基金投资人的含义及基金的基本概念

14. 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

15. 管理人对报告期内本基金运作遵守信义义务情况的说明

16. 管理人对报告期内本基金运作公平对待不同客户的情况的说明

17. 管理人对报告期内本基金投资组合的重大变动的说明

18. 管理人对报告期内基金估值政策和程序的说明

19. 管理人对报告期内基金投资策略和运作安排的说明

20. 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

21. 管理人对基金资产净值的说明

22. 管理人对基金资产净值的说明

23. 管理人对基金资产净值的说明

24. 管理人对基金资产净值的说明

25. 管理人对基金资产净值的说明

26. 管理人对基金资产净值的说明

27. 管理人对基金资产净值的说明

28. 管理人对基金资产净值的说明

29. 管理人对基金资产净值的说明

30. 管理人对基金资产净值的说明

31. 管理人对基金资产净值的说明

32. 管理人对基金资产净值的说明

33. 管理人对基金资产净值的说明

34. 管理人对基金资产净值的说明

35. 管理人对基金资产净值的说明

36. 管理人对基金资产净值的说明

37. 管理人对基金资产净值的说明

38. 管理人对基金资产净值的说明

39. 管理人对基金资产净值的说明

40. 管理人对基金资产净值的说明

41. 管理人对基金资产净值的说明

42. 管理人对基金资产净值的说明

43. 管理人对基金资产净值的说明

44. 管理人对基金资产净值的说明

45. 管理人对基金资产净值的说明

46. 管理人对基金资产净值的说明

47. 管理人对基金资产净值的说明

48. 管理人对基金资产净值的说明

49. 管理人对基金资产净值的说明

50. 管理人对基金资产净值的说明

51. 管理人对基金资产净值的说明

52. 管理人对基金资产净值的说明

53. 管理人对基金资产净值的说明

54. 管理人对基金资产净值的说明

55. 管理人对基金资产净值的说明

56. 管理人对基金资产净值的说明

57. 管理人对基金资产净值的说明

58. 管理人对基金资产净值的说明

59. 管理人对基金资产净值的说明

60. 管理人对基金资产净值的说明

61. 管理人对基金资产净值的说明

62. 管理人对基金资产净值的说明

63. 所有者权益(基金净值)变动表

64. 投资组合报告

65. 基金份额持有人名册

66. 基金资产净值

67. 基金费用概览

68. 基金税项

69. 基金净值表现

70. 基金净值增长率

71. 基金净值增长率标准差

72. 基金过去三年净值增长率

73. 基金资产配置

74. 基金投资组合

75. 基金投资策略

76. 基金风险揭示

77. 基金收益与分配

78. 基金费用调整

79. 基金合同修改与补充

80. 基金托管协议

81. 基金份额折算

82. 基金转换

83. 基金上市

84. 基金募集

85. 基金销售

86. 基金募集期间的费用

87. 基金募集期间的费用

88. 基金募集期间的费用

89. 基金募集期间的费用

90. 基金募集期间的费用

91. 基金募集期间的费用

92. 基金募集期间的费用

93. 基金募集期间的费用

94. 基金募集期间的费用

95. 基金募集期间的费用

96. 基金募集期间的费用

97. 基金募集期间的费用

98. 基金募集期间的费用

99. 基金募集期间的费用

100. 基金募集期间的费用

101. 基金募集期间的费用

102. 基金募集期间的费用

103. 基金募集期间的费用

104. 基金募集期间的费用

105. 基金募集期间的费用

106. 基金募集期间的费用

107. 基金募集期间的费用

108. 基金募集期间的费用

109. 基金募集期间的费用

110. 基金募集期间的费用

111. 基金募集期间的费用

112. 基金募集期间的费用

113. 基金募集期间的费用

114. 基金募集期间的费用

115. 基金募集期间的费用

116. 基金募集期间的费用

117. 基金募集期间的费用

118. 基金募集期间的费用

119. 基金募集期间的费用

120. 基金募集期间的费用

121. 基金募集期间的费用

122. 基金募集期间的费用

123. 基金募集期间的费用

124. 基金募集期间的费用

125. 基金募集期间的费用

126. 基金募集期间的费用

127. 基金募集期间的费用