

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告期末日期:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监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、完整性、及时性、承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:国泰金鼎价值精选

基金代码:619021

交易代码:619021

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2007年4月11日

报告期末基金资产总额:1,879,332,087.04元

投资目标:本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策、货币市场资金、证券市场走势的分析，预测宏观经济的走势，分析并评估未来一段时期的股票、债券市场相对收益，主动调整股票、债券在投资组合中的配置比例。

A.大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策、货币市场资金、证券市场走势的分析，预测宏观经济的走势，分析并评估未来一段时期的股票、债券市场相对收益，主动调整股票、债券在投资组合中的配置比例。

B.股票投资策略

本基金的股票投资策略以量化指标分析为基础，在严密的风险控制前提下，不断优化资产配置比例以实现基金的长期回报。

C.债券投资策略

本基金的债券投资策略以长期利率趋势分析为基础，结合中长期的经济周期、宏观经济及行业趋势等综合分析，通过债券置换和收益曲线匹配等方法，实施积极的债券投资管理。

业绩比较基准:65%以上的债券收益+35%以上的信用债收益+0%基准收益。

风险收益特征:本基金具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期:2015年10月1日-2015年12月31日

1.本期已实现收益:134,482,018.12

2.期初现金类资产余额:566,400,196.09

3.期末现金类资产余额:626,881,024.03

4.期末未分配利润:2,070,041,090.06

5.期末可供分配利润:1,101

注:1.本期已实现收益扣除非期初收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本报告期内为定期存款收入加上本期平均价值变动收益;

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.本期平均净值增长率偏差率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率偏差率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率偏差率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 36.26% 253% 11.01% 1.03% 24.75% 150%

3.2.2本基金平均净值增长率偏差率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 300188 美亚光电 3,100,000 197,170,000.00 7.19%

2 300357 我武生物 2,562,181 129,902,576.70 6.28%

3 300271 华宇软件 2,702,728 128,325,525.44 6.20%

4 002712 舒华体育 1,000,000 120,000,000.00 6.18%

5 300303 聚光科技 3,600,990 123,296,557.10 5.98%

6 300047 金利华电 899,940 97,644,360.00 4.72%

7 002426 旗滨股份 3,362,620 97,511,343.00 4.71%

8 000326 华联综超 5,800,226 94,433,830.00 4.57%

9 000892 *ST星美 4,106,000 84,650,350.00 4.10%

10 002072 旗滨股份 3,500,200 94,775,061.98 4.10%

5.4.报告期末按债券品种分类的证券投资组合

序号 债券代码 债券名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100000 国家债券 71,156,200.00 71,156,200.00 3.44%

2 000000 公行票据 - - -

3 000000 金债 - - -

4 000000 企债 - - -

5 000000 金债 - - -

6 000000 中票 - - -

7 000000 可交换 - - -

8 000000 回售存单 - - -

9 000000 其他 - - -

10 000000 合计 - - -

5.5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十五名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000909 云南旅游 11,616,428 147,051,314.48 7.56%

2 000661 格力电器 5,161,201 115,362,842.36 5.93%

3 600521 华海药业 3,133,024 79,547,479.36 4.09%

4 600030 中信证券 73,603,530.00 3.78%

5 002438 江苏舜天 2,385,543 66,580,503.13 3.42%

6 600223 鲁商置业 6,000,000 15,140,000.00 2.83%

7 600519 贵州茅台 248,518 54,224,142.42 2.79%

8 002008 申万宏源 2,000,000 51,789,000.00 2.66%

9 601318 中国平安 1,336,660 48,083,760.00 2.47%

10 600684 申能股份 1,990,537 43,611,424.74 2.44%

5.6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000269 云南旅游 11,616,428 147,051,314.48 7.56%

2 000661 格力电器 5,161,201 115,362,842.36 5.93%

3 600521 华海药业 3,133,024 79,547,479.36 4.09%

4 600030 中信证券 73,603,530.00 3.78%

5 002438 江苏舜天 2,385,543 66,580,503.13 3.42%

6 600223 鲁商置业 6,000,000 15,140,000.00 2.83%

7 600519 贵州茅台 248,518 54,224,142.42 2.79%

8 002008 申万宏源 2,000,000 51,789,000.00 2.66%

9 601318 中国平安 1,336,660 48,083,760.00 2.47%

10 600684 申能股份 1,990,537 43,611,424.74 2.44%

5.7.报告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

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000269 云南旅游 11,616,428 147,051,314.48 7.56%

2 000661 格力电器 5,161,201 115,362,842.36 5.93%

3 600521 华海药业 3,133,024 79,547,479.36 4.09%

4 600030 中信证券 73,603,530.00 3.78%

5 002438 江苏舜天 2,385,543 66,580,503.13 3.42%

6 600223 鲁商置业 6,000,000 15,140,000.00 2.83%

7 600519 贵州茅台 248,518 54,224,142.42 2.79%

8 002008 申万宏源 2,000,000 51,789,000.00 2.66%

9 601318 中国平安 1,336,660 48,083,760.00 2.47%

10 600684 申能股份 1,990,537 43,611,424.74 2.44%

5.8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气转债 19,890 2,738,264.30 0.14%

5.9.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

序号 金品种 金品种名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000269 云南旅游 11,616,428 147,051,314.48 7.56%

2 000661 格力电器 5,161,201 115,362,842.36 5.93%

3 600521 华海药业 3,133,024 79,547,479.36 4.09%

4 600030 中信证券 73,603,530.00 3.78%

5 002438 江苏舜天 2,385,543 66,580,503.13 3.42%

6 600223 鲁商置业 6,000,000 15,140,000.00 2.83%

7 600519 贵州茅台 248,518 54,224,142.42 2.79%

8 002008 申万宏源 2,000,000 51,789,000.00 2.66%

9 601318 中国平安 1,336,660 48,083,760.00 2.47%

10 600684 申能股份 1,990,537 43,611,424.74 2.44%

5.10.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及证券投资基金投资明细

序号 权证及证券投资基金代码 证券投资基金名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000269 云南旅游 11,616,428 147,051,314.48 7.56%

2 000661 格力电器 5,161,201 115,362,842.36 5.93%

3 600521 华海药业 3,133,024 79,547,479.36 4.09%

4 600030 中信证券 73,603,530.00 3.78%

5 002438 江苏舜天 2,385,543 66,580,503.13 3.42%

6 600223 鲁商置业 6,000,000 15,140,000.00 2.83%

7 600519 贵州茅台 248,518 54,224,142.42 2.79%

8 002008 申万宏源 2,000,000 51,789,000.00 2.66%

9 601318 中国平安 1,336,660 48,083,760.00 2.47%

10 600684 申能股份 1,990,537 43,611,424.74 2.44%

5.11.报告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

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000909 云南旅游 11,616,428 147,051,314.48 7.56%

2 000661 格力电器 5,161,201 115,362,842.36 5.93%

3 600521 华