

国泰金鑫股票型证券投资基金
(原金鑫证券投资基金转型)

2014 年年度报告

2014 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一五年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2015 年 3 月 24 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，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。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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。

本基金系原封闭式基金金鑫证券投资基金转型而来。金鑫基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2014 年 7 月 11 日起至 2014 年 8 月 11 日 17:00 止，议案内容包括金鑫证券投资基金由封闭式转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。本次会议议案于 2014 年 8 月 12 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。自 2014 年 9 月 15 日起，原《金鑫证券投资基金基金合同》终止，《国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“国泰金鑫股票型证券投资基金”。

本报告中，原金鑫证券投资基金报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日止，国泰金鑫股票型证券投资基金报告期自 2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）起至 2014 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
§ 2 基金简介.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	9
3.1 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	9
3.1.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.1.2 基金净值表现.....	10
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
3.2 金鑫证券投资基金.....	12
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	12
3.2.2 基金净值表现.....	13
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况.....	15
§ 4 管理人报告.....	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
§ 5 托管人报告.....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
§ 6 审计报告.....	21
6.1 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	21
6.2 金鑫证券投资基金.....	22
§ 7 年度财务报表.....	24
7.1 金鑫证券投资基金.....	24
7.1.1 资产负债表.....	24
7.1.2 利润表.....	26
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.1.4 报表附注.....	29
7.2 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	54
7.2.1 资产负债表.....	54
7.2.2 利润表.....	56

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	58
7.2.4 报表附注.....	59
§ 8 投资组合报告	81
8.1 金鑫证券投资基金.....	81
8.1.1 期末基金资产组合情况.....	81
8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	81
8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	82
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	85
8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	85
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	86
8.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	86
8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	86
8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	86
8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	86
8.1.12 投资组合报告附注.....	87
8.2 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	87
8.2.1 期末基金资产组合情况.....	87
8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	88
8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	89
8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	90
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	91
8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	92
8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	92
8.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	92
8.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	92
8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	92
8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	93
8.2.12 投资组合报告附注.....	93
§ 9 基金份额持有人信息	94
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	94
9.1.1 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	94
9.1.2 金鑫证券投资基金.....	94
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	95
9.3 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	95
9.3.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	95
9.3.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	95
9.4 金鑫证券投资基金.....	96
9.4.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	96
9.4.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	96
§ 10 开放式基金份额变动	96
§ 11 重大事件揭示	96
11.1 基金份额持有人大会决议.....	96
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.....	97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	97

11.4 基金投资策略的改变.....	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	97
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.....	98
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	98
11.7.1 国泰金鑫股票型证券投资基金.....	98
11.7.2 金鑫证券投资基金.....	99
11.8 其他重大事件.....	101
§ 12 备查文件目录.....	103
12.1 备查文件目录.....	103
12.2 存放地点.....	103
12.3 查阅方式.....	103

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

国泰金鑫股票型证券投资基金	
基金名称	国泰金鑫股票型证券投资基金
基金简称	国泰金鑫股票
基金主代码	519606
交易代码	519606
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 15 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
报告期末基金份额总额	1,533,716,730.64 份
基金合同存续期	不定期
金鑫证券投资基金	
基金名称	金鑫证券投资基金
基金简称	国泰金鑫封闭
基金主代码	500011
交易代码	500011
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 10 月 21 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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期	至 2014 年 9 月 14 日止
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999 年 11 月 26 日

2.2 基金产品说明

国泰金鑫股票型证券投资基金	
投资目标	有效控制投资组合风险，以积极与稳健并重的投资原则，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>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、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将从中观角度出发，捕捉新政策背景下出现的行业投资机会，进行行业资产配置，并辅以个股强化策略。选择成长型股票是本基金投资策略的核心，本基金将以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手选择具有长期可持续成长能力的股票。</p> <p>3、固定收益品种投资策略</p> <p>由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。另外，本基金在中小企业私募债的投资中，将利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合 Z-Score、KMV 等数量分析模型，测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异，根据自上而下的宏观经济及行业特性分析，从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异，结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。</p>

	<p>5、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p>
业绩比较基准	90%×沪深 300 指数收益率+ 10%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
金鑫证券投资基金	
投资目标	本基金是以具有良好成长性的国企股为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资组合由股票投资和债券投资两部分组成，其中股票投资部分主要包括稳定成长型国企股和快速成长型国企股。</p> <p>稳定成长型股票的判断标准为：成长性来自于企业自身主营业务的增长潜力，具体表现为企业主营业务的行业地位和市场地位突出，主营业务的增长是公司利润长期持续增长的主要源泉，有产品、技术、销售渠道、特许权等方面的竞争优势等特点。</p> <p>快速成长型股票的判断标准为：成长性来自于因企业的重大实质性变化而带来的公司业绩的高速增长潜力。本基金的快速成长国企股部分将侧重于具有资产重组题材股票的投资。</p> <p>在遵循以上投资组合目标和范围的基础上，基金管理人将根据具体情况变化，适时调整投资组合。</p>
业绩比较基准	无。
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

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	林海中	田青

负责人	联系电话	021-31081600转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	010-67595096
传真		021-31081800	010-66275853
注册地址		上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200082	100033
法定代表人		陈勇胜	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 国泰金鑫股票型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	223,558,835.54
本期利润	274,998,904.35
加权平均基金份额本期利润	0.0964
本期加权平均净值利润率	9.03%
本期基金份额净值增长率	12.32%
3.1.1.2 期末数据和指标	2014 年末
期末可供分配利润	117,262,929.99
期末可供分配基金份额利润	0.0765
期末基金资产净值	1,787,086,488.90
期末基金份额净值	1.165
3.1.1.3 累计期末指标	2014 年末
基金份额累计净值增长率	12.32%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、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）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（3）本基金合同生效日为 2014 年 9 月 15 日，截止至 2014 年 12 月 31 日不满一年。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.13%	1.25%	39.46%	1.48%	-26.33%	-0.23%
自基金转型起至今	12.32%	1.22%	40.22%	1.41%	-27.90%	-0.19%

3.1.2.2 自基金转型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

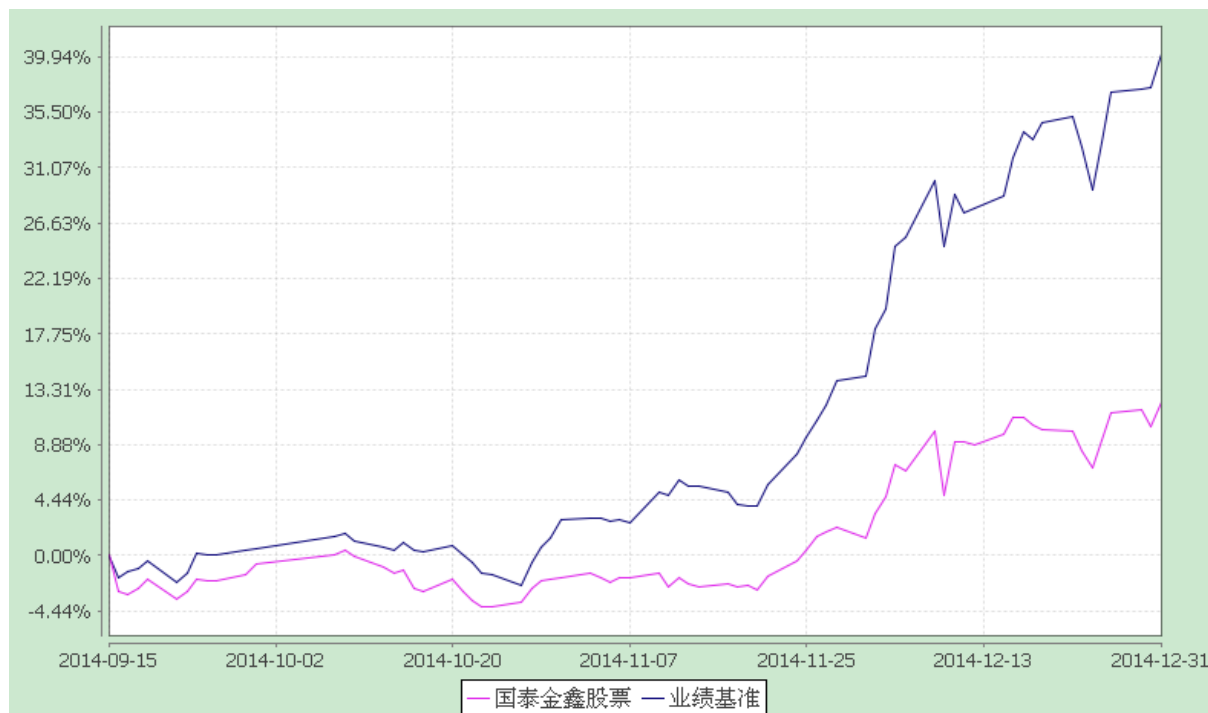
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 9 月 15 日至 2014 年 12 月 31 日)

国泰金鑫股票型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 9 月 15 日至 2014 年 12 月 31 日)



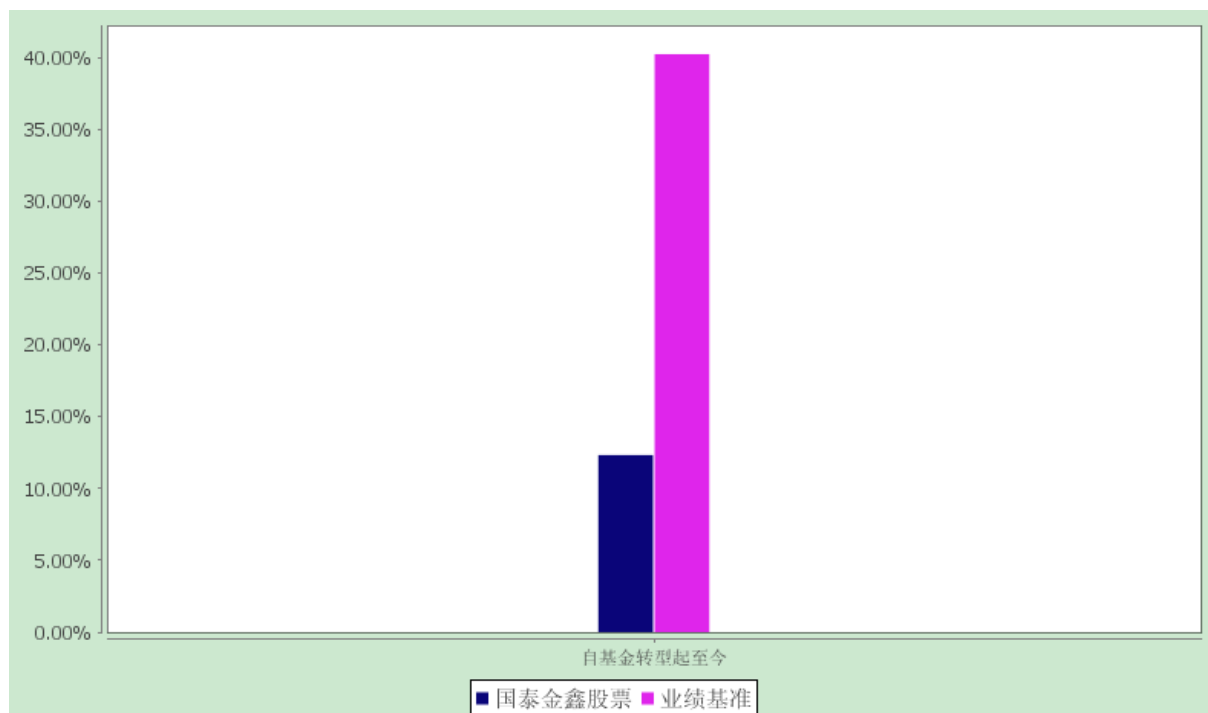
注：（1）本基金的合同生效日为 2014 年 9 月 15 日，截至 2014 年 12 月 31 日，本基金运作时间不满一年；

（2）本基金的建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

3.1.2.3 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

国泰金鑫股票型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金合同于 2014 年 9 月 15 日生效，截止至 2014 年 12 月 31 日未满一年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立至今(2014 年 9 月 15 日至 2014 年 12 月 31 日) 尚未进行利润分配。

3.2 金鑫证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	2014 年 1.1-2014 年 9.14	2013 年	2012 年
本期已实现收益	93,382,930.85	696,722,833.01	-117,120,485.82
本期利润	-134,405,675.70	1,083,516,459.80	235,815,518.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0448	0.3612	0.0786
本期加权平均净值利润率	-3.81%	28.56%	8.25%
本期基金份额净值增长率	-3.32%	35.46%	8.36%
3.2.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	-83,841,490.27	450,075,579.69	-246,647,253.32

期末可供分配基金份额利润	-0.0279	0.1500	-0.0822
期末基金资产净值	3,376,630,777.14	4,138,336,453.65	3,054,819,993.85
期末基金份额净值	1.1255	1.3794	1.0183
3.2.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	369.55%	385.69%	258.55%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、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）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）本报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日（合同失效前日）止。

3.2.2. 基金净值表现

3.2.2.1 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2014.7.1-2014.9.14	4.25%	1.59%	-	-	-	-
2014.4.1-2014.9.14	2.44%	1.92%	-	-	-	-
2014.1.1-2014.9.14	-3.32%	1.94%	-	-	-	-
2012.1.1-2014.9.14	41.91%	2.15%	-	-	-	-
2010.1.1-2014.9.14	15.40%	2.18%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	369.55%	2.56%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

3.2.2.2 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

金鑫证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(1999 年 10 月 21 日至 2014 年 9 月 14 日)

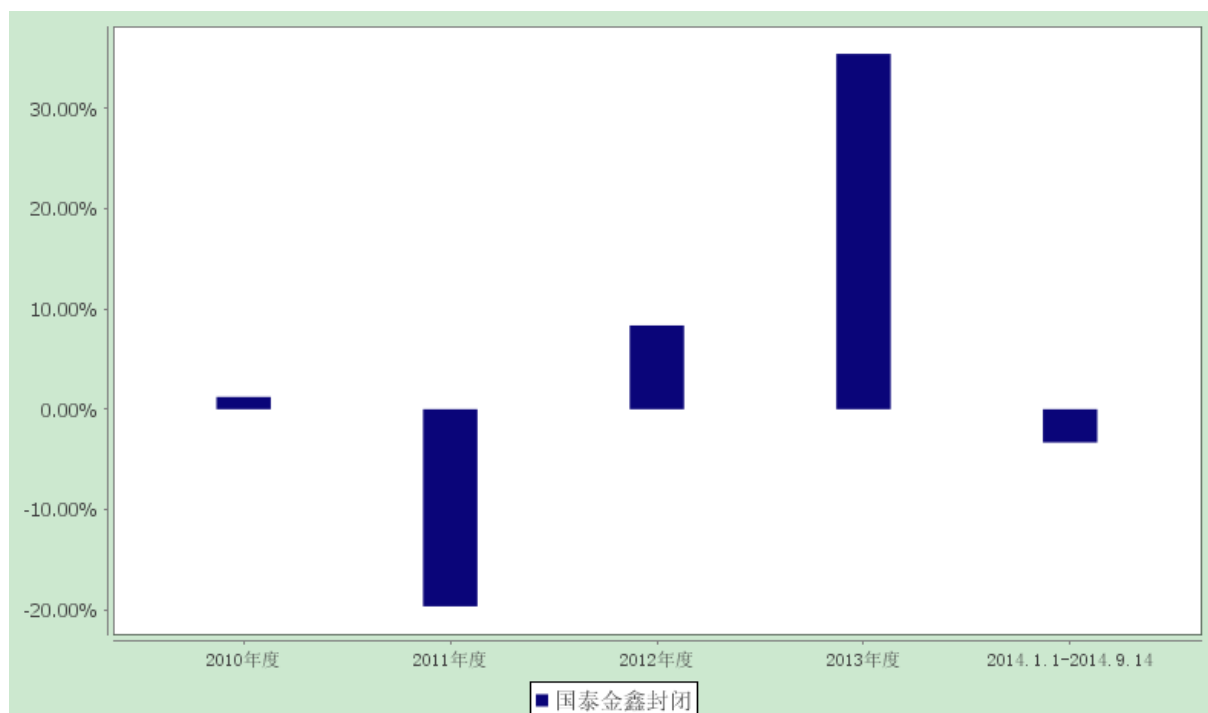


注：本基金的合同生效日为 1999 年 10 月 21 日。本基金自基金合同生效之日起三个月内，各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的规定。

3.2.2.3 自基金合同生效以来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

金鑫证券投资基金

自基金合同生效以来过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：（1）2014 年图示的指标计算期间为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日；

(2) 本基金根据基金合同无业绩比较基准。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	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
2014年	0.2091	627,300,000.81	-	627,300,000.81	-
2013年	-	-	-	-	-
2012年	-	-	-	-	-
合计	0.2091	627,300,000.81	-	627,300,000.81	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 1.1 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 2014 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 49 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资

基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王航	本基金的基金经理（原国泰金鑫封闭）、国泰事件驱动股票、国泰国策驱动混合、国泰金龙行业混合、国泰金马稳健混合的基金经理，权益投资总监	2014-09-15	-	14 年	硕士研究生，CFA。曾任职于南方证券有限公司；2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司；历任社保 111 组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金经理助理、国泰金马稳健混合的基金经理助理、国泰金牛创新股票的基金经理助理；2008 年 5 月至 2012 年 1 月任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2010 年 4 月至 2014 年 9 月兼任金鑫证券投资基金的基金经理，

					2011 年 8 月起兼任国泰事件驱动策略股票型证券投资基金的基金经理，2013 年 9 月起兼任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2014 年 2 月起兼任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 3 月起兼任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2014 年 9 月起兼任国泰金鑫股票型证券投资基金（原金鑫证券投资基金）的基金经理。2013 年 9 月至 2014 年 3 月任投资副总监，2014 年 3 月起任权益投资总监。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观

性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与基金管理人旗下国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金发生一次同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金为以完全复制为目标的指数基金，本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年市场先抑后扬，7 月之后在大盘蓝筹股带领下市场大幅上涨，上证指数全年上涨超过 50%。宏观基本面与股市冰火两重天，经济走势疲弱，12 月中采制造业 PMI 为 50.1%，创 2014 年年内最低，新订单、购进价格、原材料库存、就业处于底部回落趋势。本基金全年维持高股票仓位，重点配置金融、汽车、机械等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自 2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日的净值增长率为 12.32%，同期业绩比较基准为 40.22%。金鑫证券投资基金自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日（基金合同失效日）的净值增长率为-3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年，在实体经济疲软、依靠内生动力难以有效复苏的背景下，政策走向和改革进展仍是左右资本市场起落的关键因素。我们认为财政支持与金融宽松政策将会继续，不排除政策加码的可能性；2015 年是全面深化改革的关键之年，一些重大改革措施有望陆续出台，对打破行业垄断、国企增效的预期将提升市场整体的风险偏好。由于去年四季度市场上涨过快，加上两融推波助澜势必引发监管层关注，相关监管政策的出台无疑会加大市场震荡幅度，但左右市场走势的几个关键因素并未发生改变，因此我们乐观看待 2015 年市场走势。从中期角度看，在流动性持续宽松以及国企改革加快推进的大背景下，低估值的大盘蓝筹股仍有估值提升空间，但在货币政策进一步宽松之前的等待阶段，估值修复行情将从金融、地产、建筑等大盘蓝筹品种转向中大盘的白马成长股，我们看好低估值、业绩增速稳定的家电、汽车、食品饮料、医药板块中的龙头品种；由于原油等大宗原材料价格大幅下跌，加上国内压缩产能，部分中游行业毛利率出现企稳改善迹象，本身估值较低，如果受到例如国企改革等事件性因素驱动，将是较好的配置时机；投资主题方面，安全、信息化、环保这些社会经济发展所遇到的瓶颈因素仍是本基金 2015 年关注的重点；互联网对传统行业的渗透

正在加速进行，互联网之于目前中国的意义不仅仅是渠道或者平台，更是在改革过程中，促进各行各业打破垄断、推进市场化的重要手段，理应引起足够重视。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

- 1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。
- 2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。
- 3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的

利润。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、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的复核,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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 国泰金鑫股票型证券投资基金

普华永道中天审字(2015)第 21568 号

国泰金鑫股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的国泰金鑫股票型证券投资基金(以下简称“国泰金鑫股票基金”)的财务报表,包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是国泰金鑫股票基金的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责

任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.1.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.1.3 审计意见

我们认为，上述国泰金鑫股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国泰金鑫股票基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

汪棣 魏佳亮

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

6.2 金鑫证券投资基金

金鑫证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金鑫证券投资基金(以下简称“基金金鑫”)的财务报表,包括 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.2.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金金鑫的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.2.3 审计意见

我们认为,上述基金金鑫的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了基金金鑫 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

汪棣 魏佳亮

§ 7 年度财务报表

7.1 金鑫证券投资基金

7.1.1 资产负债表

会计主体：金鑫证券投资基金

报告截止日：2014 年 9 月 14 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 9 月 14 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	151,513,412.53	154,820,156.66
结算备付金		1,128,768.79	5,246,830.60
存出保证金		656,447.70	529,382.93
交易性金融资产	7.4.7.2	3,210,155,898.98	4,010,464,927.62
其中：股票投资		2,524,375,488.98	3,114,979,927.62
基金投资		-	-
债券投资		685,780,410.00	895,485,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		34,345,704.85	-
应收利息	7.4.7.5	19,414,002.93	20,275,351.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	324,154.37	-
资产总计		3,417,538,390.15	4,191,336,648.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年9月14日	上年度末 2013年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		33,640,710.46	41,738,653.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,929,138.79	5,192,771.24
应付托管费		321,523.14	865,461.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,065,647.23	2,430,068.61
应交税费		2,423,239.69	2,423,239.69
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	527,353.70	350,000.00
负债合计		40,907,613.01	53,000,195.26
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.1 0	376,630,777.14	1,138,336,453.65
所有者权益合计		3,376,630,777.14	4,138,336,453.65
负债和所有者权益总计		3,417,538,390.15	4,191,336,648.91

注：报告截止日 2014 年 9 月 14 日（基金合同失效前日），基金份额净值 1.1255 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

7.1.2 利润表

会计主体：金鑫证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		-79,478,206.88	1,164,251,918.31
1. 利息收入		20,091,086.21	25,374,450.08
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	745,606.47	385,158.71
债券利息收入		19,144,154.59	24,913,229.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		201,325.15	76,061.57
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		128,219,192.56	751,983,209.63
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	100,634,312.90	730,524,787.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-792,209.93	1,837,921.63
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 4	-	-
股利收益	7.4.7.1 5	28,377,089.59	19,620,500.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 6	-227,788,606.55	386,793,626.79

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 7	120.90	100,631.81
减：二、费用		54,927,468.82	80,735,458.51
1. 管理人报酬		37,378,953.12	56,942,413.68
2. 托管费		6,229,825.52	9,490,402.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 8	9,345,795.86	12,667,901.69
5. 利息支出		32,131.96	1,227,191.48
其中：卖出回购金融资产支出		32,131.96	1,227,191.48
6. 其他费用	7.4.7.1 9	1,940,762.36	407,549.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-134,405,675.70	1,083,516,459.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-134,405,675.70	1,083,516,459.80

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鑫证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	1,138,336,453.65	4,138,336,453.65
二、本期经营活动产生	-	-134,405,675.70	-134,405,675.70

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-627,300,000.81	-627,300,000.81
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	376,630,777.14	3,376,630,777.14
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	54,819,993.85	3,054,819,993.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,083,516,459.80	1,083,516,459.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	0.00

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	1,138,336,453.65	4,138,336,453.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1.1 至 7.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈勇胜，主管会计工作负责人：张琼，会计机构负责人：王嘉浩

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

金鑫证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]第 29 号文批准，由国泰证券有限公司（后合并组建国泰君安证券股份有限公司）、上海爱建信托投资有限责任公司、浙江省国际信托投资有限责任公司（后更名为中投信托有限责任公司）和国泰基金管理有限公司四家发起人依照《金鑫证券投资基金基金契约》（后更名为《金鑫证券投资基金基金合同》）发起，并于 1999 年 10 月 21 日募集成立。本基金为契约型封闭式，存续期为 15 年，发行规模为 3,000,000,000 份基金份额。

本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字[1999]第 76 号文审核同意，于 1999 年 11 月 26 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字[1999]29 号文的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中股票投资部分主要投资于沪深两市中具有良好成长性的国企股。

本基金原发起人之一的国泰证券有限公司于 1999 年 8 月与原君安证券有限责任公司通过新设合并、增资扩股组建成立国泰君安证券股份有限公司。本基金原发起人之一的浙江省国际信托投资有限责任公司于 2007 年 3 月被中国建银投资有限责任公司收购原股东持有的全部股权，后经中国银行业监督管理委员会批准，于 2007 年 11 月更名为“中投信托有限责任公司”。国泰证券有限公司和浙江省国际信托投资有限责任公司作为本基金发起人的权利义务及持有的基金份额，由国泰君安证券股份有限公司和中投信托有限责任公司承接。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2015 年 3 月 26 日批准报出。

7.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金鑫证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日(基金合同失效前日)。

7.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生

金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.1.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.1.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债

券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.1.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.1.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.1.4.5.1会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.1.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.1.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 9 月 14 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	151,513,412.53	154,820,156.66
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	151,513,412.53	154,820,156.66

7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 9 月 14 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,065,863,150.57	2,524,375,488.98	458,512,338.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	254,528,591.00	255,759,410.00	1,230,819.00
	银行间市场	429,291,890.00	430,021,000.00	729,110.00
	合计	683,820,481.00	685,780,410.00	1,959,929.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,749,683,631.57	3,210,155,898.98	460,472,267.41
项目		上年度末 2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,423,155,311.75	3,114,979,927.62	691,824,615.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	729,264,340.00	727,844,000.00	-1,420,340.00
	银行间市场	169,784,401.91	167,641,000.00	-2,143,401.91
	合计	899,048,741.91	895,485,000.00	-3,563,741.91
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,322,204,053.66	4,010,464,927.62	688,260,873.96

7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.1.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年9月14日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	247,375.41	24,172.14
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	16,774.19	2,597.69
应收债券利息	19,147,456.91	20,248,319.25
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	2,396.42	262.02
合计	19,414,002.93	20,275,351.10

7.1.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年9月14日	上年度末 2013年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	324,154.37	-
合计	324,154.37	-

7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2014 年 9 月 14 日	2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,063,458.20	2,428,577.70
银行间市场应付交易费用	2,189.03	1,490.91
合计	2,065,647.23	2,430,068.61

7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2014 年 9 月 14 日	2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	-	-
预提信息披露费	140,820.58	-
预提上市年费	45,000.00	-
预提审计费	91,533.12	100,000.00
合计	527,353.70	350,000.00

7.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

注：按照《金鑫证券投资基金基金合同》的有关规定，在基金存续期间，各基金发起人持有的基金份额不得低于其认购份额的 50%。于 2014 年 9 月 14 日，基金发起人持有的非流通部分基金份额为 15,000,000.00 份(2013 年 12 月 31 日：同)。

7.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	450,075,579.69	688,260,873.96	1,138,336,453.65
本期利润	93,382,930.85	-227,788,606.55	-134,405,675.70
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-627,300,000.81	-	-627,300,000.81
本期末	-83,841,490.27	460,472,267.41	376,630,777.14

7.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
活期存款利息收入	700,813.05	313,194.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	38,241.31	63,628.92
其他	6,552.11	8,335.11
合计	745,606.47	385,158.71

7.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
卖出股票成交总额	3,213,932,660.69	4,263,146,619.84
减：卖出股票成本总额	3,113,298,347.79	3,532,621,832.52
买卖股票差价收入	100,634,312.90	730,524,787.32

7.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,084,983,528.15	863,918,115.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,054,927,571.76	839,759,756.61
减：应收利息总额	30,848,166.32	22,320,437.25
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-792,209.93	1,837,921.63

7.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	28,377,089.59	19,620,500.68
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	28,377,089.59	19,620,500.68

7.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
1. 交易性金融资产	-227,788,606.55	386,793,626.79
——股票投资	-233,312,277.46	392,626,821.54
——债券投资	5,523,670.91	-5,833,194.75
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-227,788,606.55	386,793,626.79

7.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	-	-
印花税手续费返还	-	-
证管费返还	-	100,631.81
其他	120.90	-
合计	120.90	100,631.81

7.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	9,319,488.36	12,624,701.69
银行间市场交易费用	26,307.50	43,200.00
合计	9,345,795.86	12,667,901.69

7.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
审计费用	91,533.12	100,000.00
信息披露费	140,820.58	200,000.00
上市年费	45,000.00	60,000.00
债券托管账户维护费	27,000.00	36,000.00

公告费	12,030.00	-
持有人名册查询费	1,000.00	2,000.00
银行划款手续费	13,233.03	9,149.31
分红手续费	1,557,745.63	-
持有人大会律师费用	50,000.00	-
持有人大会费用	2,000.00	-
上清所证书费	400.00	400.00
合计	1,940,762.36	407,549.31

7.1.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.1.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.1.4.8.2资产负债表日后事项

本基金于 2014 年 9 月 12 日进行终止上市权利登记，2014 年 9 月 15 日终止上市。原《金鑫证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同》于同一日起生效，同时本基金更名为国泰金鑫股票型证券投资基金。

7.1.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中国建银投资有限责任公司（“中国建投”）	基金管理人的控股股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金发起人
中投信托有限责任公司（“中投信托”，原名为“浙江省国际信托投资有限责任公司”）	基金发起人
上海爱建信托投资有限责任公司（“爱建信托”）	基金发起人
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
宏源证券股份有限公司（“宏源证券”）	基金代销机构、受中国建投控制的公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：1) 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2) 申万宏源集团股份有限公司（以下简称“申万宏源”）发行股份吸收合并宏源证券股份有限公司（以下简称“宏源证券”）的申请已获得中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1279号批复的核准。宏源证券股票（股票代码：000562）已自 2014 年 12 月 10 日开始连续停牌，并于 2015 年 1 月 26 日起在深圳证券交易所终止上市。在换股实施股权登记日（2015 年 1 月 23 日）收市后，宏源

证券股票实施换股转换成申万宏源 A 股股票，并于 2015 年 1 月 26 日在深圳证券交易所上市及挂牌交易。

7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年9月14日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	589,557,189.10	9.88%	104,375,764.04	1.27%
宏源证券	158,469,725.94	2.66%	267,841,030.32	3.27%

7.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年9月14日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
宏源证券	28,973,670.15	16.61%	-	-

7.1.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2014年1月1日至2014年9月14日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	536,730.82	9.88%	363,841.49	17.63%
宏源证券	144,269.94	2.66%	144,269.94	6.99%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	95,023.47	1.23%	-	-
宏源证券	243,842.04	3.16%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.1.4.10.2 关联方报酬

7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月 14日	2013年1月1日至2013年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	37,378,953.12	56,942,413.68
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提管理人报酬。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,229,825.52	9,490,402.35

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2014年1月1日至2014年9月14日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
建设银行	60,081,876.52	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年9月14日	2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
期间申购/买入总份额	-	-

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	0.25%	0.25%

7.1.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 9 月 14 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国泰君安	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
中投信托	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
爱建信托	7,500,000.00	0.25%	7,500,000.00	0.25%

7.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年9月14日		2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	151,513,412.53	700,813.05	154,820,156.66	313,194.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有在承销期参与关联方承销证券的情况。

7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.1.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2014-03-21	2014-03-24	2.091	627,300,000.81	-	627,300,000.81	-
合计			2.091	627,300,000.81	-	627,300,000.81	-

7.1.4.12 期末（2014 年 9 月 14 日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600637	百视通	2014-05-29	资产重组	31.99	2014-11-24	35.19	500,000.00	14,054,493.46	15,995,000.00	-

注：本基金截至 2014 年 9 月 14 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.1.4.13 金融工具风险及管理

7.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资本增值和投资收益的最大化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相

应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2014 年 9 月 12 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.28% (2013 年 12 月 31 日：1.17%)。

7.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 9 月 12 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年9月14日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	151,513,412.53	-	-	-	151,513,412.53
结算备付金	1,128,768.79	-	-	-	1,128,768.79
存出保证金	656,447.70	-	-	-	656,447.70
交易性金融资产	666,489,062.00	9,934,000.00	9,357,348.00	2,524,375,488.98	3,210,155,898.98
应收证券清算款	-	-	-	34,345,704.85	34,345,704.85
应收利息	-	-	-	19,414,002.93	19,414,002.93
其他收入	-	-	-	324,154.37	324,154.37
资产总计	819,787,691.02	9,934,000.00	9,357,348.00	2,578,459,351.13	3,417,538,390.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	33,640,710.46	33,640,710.46
应付管理人报酬	-	-	-	1,929,138.79	1,929,138.79
应付托管费	-	-	-	321,523.14	321,523.14
应付交易费用	-	-	-	2,065,647.23	2,065,647.23
应交税费	-	-	-	2,423,239.69	2,423,239.69
其他负债	-	-	-	527,353.70	527,353.70
负债总计	-	-	-	40,907,613.01	40,907,613.01

利率敏感度缺口	819,787,691.02	9,934,000.00	9,357,348.00	2,537,551,738.12	3,376,630,777.14
上年度末 2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	154,820,156.66	-	-	-	154,820,156.66
结算备付金	5,246,830.60	-	-	-	5,246,830.60
存出保证金	529,382.93	-	-	-	529,382.93
交易性金融资产	837,338,000.00	58,147,000.00	-	3,114,979,927.62	4,010,464,927.62
应收利息	-	-	-	20,275,351.10	20,275,351.10
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	997,934,370.19	58,147,000.00	-	3,135,255,278.72	4,191,336,648.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	41,738,653.84	41,738,653.84
应付管理人报酬	-	-	-	5,192,771.24	5,192,771.24
应付托管费	-	-	-	865,461.88	865,461.88
应付交易费用	-	-	-	2,430,068.61	2,430,068.61
应交税费	-	-	-	2,423,239.69	2,423,239.69
其他负债	-	-	-	350,000.00	350,000.00
负债总计	-	-	-	53,000,195.26	53,000,195.26
利率敏感度缺口	997,934,370.19	58,147,000.00	-	3,082,255,083.46	4,138,336,453.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率外的其他市场变量不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	1. 市场利率上升 25 个基点	减少约 49	减少约 86
	2. 市场利率下降 25 个基点	增加约 49	增加约 87

7.1.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 9 月 14 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,524,375,488.98	74.76	3,114,979,927.62	75.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	2,524,375,488.98	74.76	3,114,979,927.62	75.27

7.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 11,260	增加约 9,363
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 11,260	减少约 9,363

7.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 9 月 14 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为 2,764,139,898.98 元，属于第二层级的余额为 446,016,000.00 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 3,644,997,445.72 元，第二层级 365,467,481.9 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.2 国泰金鑫股票型证券投资基金

7.2.1 资产负债表

会计主体：国泰金鑫股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	182,257,498.23
结算备付金		1,393,434.94
存出保证金		591,956.08

交易性金融资产	7.4.7.2	1,812,215,874.94
其中：股票投资		1,746,207,874.94
基金投资		-
债券投资		66,008,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		38,632,470.63
应收利息	7.4.7.5	1,533,269.06
应收股利		-
应收申购款		24,014,364.80
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,060,638,868.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		267,262,165.34
应付管理人报酬		2,737,929.92
应付托管费		456,321.65
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	2,685,309.64
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	410,653.23
负债合计		273,552,379.78
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	1,412,639,464.84
未分配利润	7.4.7.1 0	374,447,024.06
所有者权益合计		1,787,086,488.90
负债和所有者权益总计		2,060,638,868.68

注：（1）报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.165 元，基金份额总额 1,533,716,730.64 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日。

7.2.2 利润表

会计主体：国泰金鑫股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		296,441,392.17
1. 利息收入		5,221,300.68
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	1,071,065.11
债券利息收入		4,086,796.11
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		63,439.46
其他利息收入		-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		235,805,355.05
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	233,364,101.99
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.1 3	2,489,911.66
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.1 4	-
股利收益	7.4.7.1 5	-48,658.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 6	51,440,068.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 7	3,974,667.63
减：二、费用		21,442,487.82
1. 管理人报酬		13,603,786.51
2. 托管费		2,267,297.70
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.1 8	5,066,401.19
5. 利息支出		2,888.82
其中：卖出回购金融资产支出		2,888.82
6. 其他费用	7.4.7.1 9	502,113.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		274,998,904.35

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		274,998,904.35

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金鑫股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	376,630,777.14	3,376,630,777.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	274,998,904.35	274,998,904.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,587,360,535.16	-277,182,657.43	-1,864,543,192.59
其中：1. 基金申购款	1,150,476,236.57	107,923,390.22	1,258,399,626.79
2. 基金赎回款	-2,737,836,771.73	-385,106,047.65	-3,122,942,819.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,412,639,464.84	374,447,024.06	1,787,086,488.90

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：陈勇胜，主管会计工作负责人：张琼，会计机构负责人：王嘉浩

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

国泰金鑫股票型证券投资基金是根据原金鑫证券投资基金(以下简称“基金金鑫”)基金份额持有人大会 2014 年 8 月 12 日决议通过的《关于金鑫证券投资基金转型有关事项的议案》，由原基金金鑫转型而来。原基金金鑫存续期限至 2014 年 9 月 15 日止。自 2014 年 9 月 15 日起，原基金金鑫更名为国泰金鑫股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《金鑫证券投资基金基金合同》失效的同时《国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同》生效，本基金存续期限不定。原基金金鑫于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,787,086,488.90 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据基金金鑫份额持有人大会后续安排，本基金自 2014 年 9 月 22 日起至 2014 年 10 月 17 日止开放集中申购。集中申购共募集不包括认购资金利息人民币 1,171,265,664.91 元，折合基金份额 1,171,265,664.91 份，认购资金产生的利息人民币 507,646.75 元，折合基金份额 507,646.75 份，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2014)第 336 号验资报告予以验证。国泰基金管理有限公司以 2014 年 10 月 22 日为拆分基准日，对本基金进行了份额拆分。拆分基准日拆分前基金份额净值为 1.086 元，精确到小数点后 9 位为 1.085639720 元。国泰基金管理有限公司按照 1:1.085639720 的比例拆分。拆分后当日基金份额净值调整为 1.000 元，拆分后基金份额计算结果保留至整数位，所产生的误差归入基金资产。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：90%×沪深 300 指数收益率+ 10%×中证综

合债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2015 年 3 月 26 日批准报出。

7.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《金鑫股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日止的财务状况以及 2014 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的持

有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- (2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;

或者

(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易

日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投

资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税

[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	182,257,498.23
定期存款	-
其他存款	-
合计	182,257,498.23

7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,234,817,234.72	1,746,207,874.94	511,390,640.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	55,657,704.00	56,005,000.00
	银行间市场	9,828,600.00	10,003,000.00
	合计	65,486,304.00	66,008,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,300,303,538.72	1,812,215,874.94	511,912,336.22

7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.2.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
	应收活期存款利息
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	690.04
应收债券利息	1,507,341.92
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	293.04
合计	1,533,269.06

7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,683,718.39
银行间市场应付交易费用	1,591.25
合计	2,685,309.64

7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	30,653.23
预提费用	130,000.00
合计	410,653.23

7.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年9月15日(基金合同生效日) 至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
2014 年 10 月 22 日基金份额折算调整	256,919,160.00	-
2014 年 10 月 22 日未领取红利份额折算调整(若有)	564,031.00	519,537.92
2014 年 10 月 22 日集中申购募集资金本金及利息	1,171,773,311.66	1,079,339,020.36
2014 年 10 月 22 日基金拆分和集中申购完成后	4,429,256,502.66	4,079,858,558.28
本期申购	76,674,865.84	70,617,678.29
本期赎回(以“-”号填列)	-2,972,214,637.86	-2,737,836,771.73
本期末	1,533,716,730.64	1,412,639,464.84

注：1. 原基金金鑫于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 3,376,630,777.14 元，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

2. 本基金自 2014 年 9 月 22 日至 2014 年 10 月 17 日止期间开放集中申购，共募集有效净认购资金 1,171,265,664.91 元。根据《国泰金鑫股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金集中申购期内申购资金产生的利息收入 507,646.75 元，折算为 507,646.75 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《国泰金鑫股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2014 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2014 年 10 月 27 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自 2014 年 10 月 28 日起开始办理。

4. 根据《国泰金鑫股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司确定 2014 年 10 月 22 日为本基金的基金份额拆分日。当日基金资产净值为 3,256,919,160.49 元，拆分前基金份额总额为 3,000,000,000.00 份，拆分前基金份额净值为 1.086 元。根据基金份额拆分公式，基金份额折算比例为 1: 1.085639720，拆分后基金份额总额为 3,256,919,160.00 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述拆分比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于 2014 年 10 月 24 日进行了变更登记。

7.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-83,841,490.27	460,472,267.41	376,630,777.14
本期利润	223,558,835.54	51,440,068.81	274,998,904.35
本期基金份额交易产生的变动数	-22,454,415.28	-254,728,242.15	-277,182,657.43
其中：基金申购款	-18,705,394.70	126,628,784.92	107,923,390.22
基金赎回款	-3,749,020.58	-381,357,027.07	-385,106,047.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,262,929.99	257,184,094.07	374,447,024.06

7.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,056,241.73
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	11,884.04
其他	2,939.34
合计	1,071,065.11

7.2.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,028,129,141.63
减：卖出股票成本总额	1,794,765,039.64
买卖股票差价收入	233,364,101.99

7.2.4.7.13 债券投资收益

7.2.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	642,550,999.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	618,334,177.00
减：应收利息总额	21,726,911.10
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,489,911.66

7.2.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.2.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.2.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	-48,658.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	-48,658.60

注：股利收益为红利税冲回。

7.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	51,440,068.81
——股票投资	52,878,301.81
——债券投资	-1,438,233.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	51,440,068.81

7.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
基金赎回费收入	3,969,667.63
上市年费减免收入	5,000.00
合计	3,974,667.63

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
交易所市场交易费用	5,065,776.19
银行间市场交易费用	625.00
合计	5,066,401.19

7.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
审计费用	38,466.88
信息披露费	119,179.42
银行汇划费用	11,312.93
债券账户服务费	9,000.00
分红费用	324,154.37
合计	502,113.60

7.2.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.2.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.2.4.8.2资产负债表日后事项

截至 2015 年 3 月 26 日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.2.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.2.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.2.4.10.2关联方报酬

7.2.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,603,786.51
其中：支付销售机构的客户维护费	1,437,399.83

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.2.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,267,297.70

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日
基金合同生效日（2014年9月15日）持有的基金份额	7,500,000.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	642,298.00
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	8,142,298.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.53%

注：国泰基金管理有限公司持有原基金金鑫份额为 7,500,000.00 份，2014 年 10 月 24 日确权折算份额 642,298.00 份。

7.2.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年9月15日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	182,257,498.23	1,056,241.73

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.2.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600401	海润光伏	2014-09-16	2015-09-14	非公开发	7.72	6.91	3,000,000.	23,160,000	20,730,000	-

				行			00	.00	.00
--	--	--	--	---	--	--	----	-----	-----

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.2.4.13 金融工具风险及管理

7.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金有效控制投资组合风险，以积极与稳健并重的投资原则，谋求基金资产长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受范围内。

7.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

7.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投

资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所交易，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	182,257,498.23	-	-	-	182,257,498.23
结算备付金	1,393,434.94	-	-	-	1,393,434.94
存出保证金	591,956.08	-	-	-	591,956.08
交易性金融资产	56,005,000.00	10,003,000.00	-	1,746,207,874.94	1,812,215,874.94
应收证券清算款	-	-	-	38,632,470.63	38,632,470.63
应收利息	-	-	-	1,533,269.06	1,533,269.06
应收申购款	20,028,644.27	-	-	3,985,720.53	24,014,364.80
资产总计	260,276,533.52	10,003,000.00	-	1,790,359,335.16	2,060,638,868.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	267,262,165.34	267,262,165.34
应付管理人报酬	-	-	-	2,737,929.92	2,737,929.92
应付托管费	-	-	-	456,321.65	456,321.65
应付交易费用	-	-	-	2,685,309.64	2,685,309.64
其他负债	-	-	-	410,653.23	410,653.23
负债总计	-	-	-	273,552,379.78	273,552,379.78
利率敏感度缺口	260,276,533.52	10,003,000.00	-	1,516,806,955.38	1,787,086,488.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.69%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.2.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合资产配置比例：股票资产占基金资产的 80%-95%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,746,207,874.94	97.71
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	1,746,207,874.94	97.71

7.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外其他市场变量不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)
		本期末 2014 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 5,724
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 5,724

7.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为 1,781,482,874.94 元，属于第二层级的余额为 30,733,000.00 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对

于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 金鑫证券投资基金

8.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,524,375,488.98	73.87
	其中：股票	2,524,375,488.98	73.87
2	固定收益投资	685,780,410.00	20.07
	其中：债券	685,780,410.00	20.07
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	152,642,181.32	4.47
7	其他各项资产	54,740,309.85	1.60
8	合计	3,417,538,390.15	100.00

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,813,657,485.66	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,062,875.76	2.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,995,000.00	0.47
J	金融业	225,720,859.31	6.68
K	房地产业	111,833,169.85	3.31
L	租赁和商务服务业	112,140,000.00	3.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	130,836,098.40	3.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,130,000.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,524,375,488.98	74.76

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600587	新华医疗	7,200,000	255,240,000.00	7.56
2	000625	长安汽车	13,300,000	182,875,000.00	5.42

3	600885	宏发股份	7,022,924	162,721,149.08	4.82
4	600401	海润光伏	14,715,268	146,564,069.28	4.34
5	002672	东江环保	3,759,658	130,836,098.40	3.87
6	600563	法拉电子	3,396,812	124,934,745.36	3.70
7	002400	省广股份	4,500,000	112,140,000.00	3.32
8	002353	杰瑞股份	2,531,922	106,112,851.02	3.14
9	300146	汤臣倍健	3,107,311	96,264,494.78	2.85
10	600900	长江电力	12,013,572	91,062,875.76	2.70
11	600312	平高电气	6,427,673	89,537,484.89	2.65
12	002008	大族激光	4,245,650	83,129,827.00	2.46
13	300024	机器人	2,187,939	79,159,633.02	2.34
14	601318	中国平安	1,799,985	77,183,356.80	2.29
15	002614	蒙发利	3,847,343	68,867,439.70	2.04
16	600067	冠城大通	9,960,575	62,851,228.25	1.86
17	601601	中国太保	3,000,000	59,130,000.00	1.75
18	600109	国金证券	2,328,428	53,856,539.64	1.59
19	000970	中科三环	3,277,018	53,087,691.60	1.57
20	000002	万 科 A	5,188,765	48,981,941.60	1.45
21	600525	长园集团	3,990,256	48,760,928.32	1.44
22	600887	伊利股份	1,800,000	47,466,000.00	1.41
23	002444	巨星科技	3,811,327	46,688,755.75	1.38
24	002415	海康威视	2,123,890	42,371,605.50	1.25
25	002179	中航光电	1,647,699	41,653,830.72	1.23
26	000039	中集集团	2,423,056	38,478,129.28	1.14
27	601166	兴业银行	3,428,251	35,550,962.87	1.05
28	300127	银河磁体	2,257,402	33,499,845.68	0.99
29	002023	海特高新	1,287,420	29,623,534.20	0.88
30	600763	通策医疗	500,000	23,130,000.00	0.69
31	002108	沧州明珠	1,299,992	22,866,859.28	0.68
32	600637	百视通	500,000	15,995,000.00	0.47
33	600686	金龙汽车	1,228,001	13,753,611.20	0.41

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300024	机器人	123,868,130.99	2.99
2	002008	大族激光	118,690,225.57	2.87
3	600563	法拉电子	117,847,896.59	2.85
4	600406	国电南瑞	110,148,929.36	2.66

5	600401	海润光伏	108,644,702.76	2.63
6	002672	东江环保	107,927,232.22	2.61
7	002242	九阳股份	106,050,949.17	2.56
8	000625	长安汽车	104,146,323.23	2.52
9	600835	上海机电	102,784,364.51	2.48
10	600312	平高电气	93,908,747.40	2.27
11	300146	汤臣倍健	92,247,295.59	2.23
12	600000	浦发银行	91,411,242.85	2.21
13	300124	汇川技术	89,125,007.99	2.15
14	002614	蒙发利	82,332,779.12	1.99
15	600067	冠城大通	81,687,378.76	1.97
16	600900	长江电力	76,039,508.33	1.84
17	601318	中国平安	71,557,558.39	1.73
18	600703	三安光电	64,687,106.39	1.56
19	600196	复星医药	64,482,093.27	1.56
20	000919	金陵药业	62,962,166.70	1.52

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.1.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002400	省广股份	201,594,041.10	4.87
2	600597	光明乳业	191,110,438.46	4.62
3	600000	浦发银行	173,262,704.93	4.19
4	300124	汇川技术	147,756,936.82	3.57
5	600887	伊利股份	136,340,730.61	3.29
6	600587	新华医疗	132,949,634.53	3.21
7	600827	百联股份	129,278,439.65	3.12
8	600637	百视通	120,160,320.64	2.90
9	000625	长安汽车	119,814,684.44	2.90
10	002353	杰瑞股份	119,641,209.00	2.89
11	600835	上海机电	119,045,874.48	2.88
12	002024	苏宁云商	96,933,678.29	2.34
13	600196	复星医药	95,971,044.07	2.32
14	002242	九阳股份	90,145,591.20	2.18
15	600406	国电南瑞	82,586,061.44	2.00
16	600073	上海梅林	76,569,711.60	1.85
17	300024	机器人	74,224,584.13	1.79

18	600837	海通证券	74,209,794.32	1.79
19	600583	海油工程	67,427,528.57	1.63
20	300182	捷成股份	66,168,586.97	1.60

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,756,006,186.61
卖出股票的收入（成交）总额	3,213,932,660.69

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。

8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	246,402,062.00	7.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	430,021,000.00	12.74
	其中：政策性金融债	430,021,000.00	12.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,357,348.00	0.28
8	其他	-	-
9	合计	685,780,410.00	20.31

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	019322	13 国债 22	1,603,100	160,342,062.00	4.75
2	130243	13 国开 43	1,000,000	100,060,000.00	2.96
3	090417	09 农发 17	800,000	79,904,000.00	2.37
4	090311	09 进出 11	800,000	79,896,000.00	2.37
5	130428	13 农发 28	700,000	70,070,000.00	2.08

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.1.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.1.12.3 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	656,447.70
2	应收证券清算款	34,345,704.85
3	应收股利	-
4	应收利息	19,414,002.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	324,154.37
8	其他	-
9	合计	54,740,309.85

8.1.12.4 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。

8.1.12.5 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情况。

8.2 国泰金鑫股票型证券投资基金

8.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	1,746,207,874.94	84.74
	其中：股票	1,746,207,874.94	84.74
2	固定收益投资	66,008,000.00	3.20
	其中：债券	66,008,000.00	3.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	183,650,933.17	8.91
7	其他各项资产	64,772,060.57	3.14
8	合计	2,060,638,868.68	100.00

8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	834,736,031.20	46.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,388,889.98	5.28
E	建筑业	20,173,836.00	1.13
F	批发和零售业	42,419,514.87	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	402,637,126.27	22.53
K	房地产业	192,718,975.14	10.78
L	租赁和商务服务业	97,515,000.00	5.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	51,606,131.04	2.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,012,370.44	0.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,746,207,874.94	97.71

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000625	长安汽车	10,592,684	174,037,798.12	9.74
2	600587	新华医疗	5,315,700	166,540,881.00	9.32
3	601318	中国平安	2,153,782	160,909,053.22	9.00
4	601601	中国太保	3,859,389	124,658,264.70	6.98
5	002400	省广股份	4,500,000	97,515,000.00	5.46
6	600900	长江电力	8,846,194	94,388,889.98	5.28
7	000786	北新建材	3,508,531	88,695,663.68	4.96
8	000002	万科A	4,540,769	63,116,689.10	3.53
9	002470	金正大	2,181,656	58,686,546.40	3.28
10	600067	冠城大通	7,032,272	56,961,403.20	3.19
11	002588	史丹利	1,446,150	56,327,542.50	3.15
12	601166	兴业银行	3,317,213	54,734,014.50	3.06
13	002672	东江环保	1,485,496	51,606,131.04	2.89
14	002415	海康威视	2,306,090	51,587,233.30	2.89
15	600657	信达地产	5,962,624	48,655,011.84	2.72
16	600511	国药股份	1,368,813	42,419,514.87	2.37
17	300024	机器人	1,058,667	41,700,893.13	2.33
18	601628	中国人寿	1,203,879	41,112,467.85	2.30
19	000401	冀东水泥	2,937,451	38,392,484.57	2.15
20	600031	三一重工	3,621,421	36,141,781.58	2.02

21	000039	中集集团	1,517,535	33,218,841.15	1.86
22	000024	招商地产	908,900	23,985,871.00	1.34
23	600388	龙净环保	642,100	22,473,500.00	1.26
24	600521	华海药业	1,476,486	21,468,106.44	1.20
25	600837	海通证券	882,100	21,223,326.00	1.19
26	600401	海润光伏	3,000,000	20,730,000.00	1.16
27	601800	中国交建	1,452,400	20,173,836.00	1.13
28	600887	伊利股份	632,091	18,096,765.33	1.01
29	600763	通策医疗	208,678	10,012,370.44	0.56
30	002271	东方雨虹	199,100	6,637,994.00	0.37

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	601009	南京银行	88,540,248.70	4.95
2	000786	北新建材	85,485,252.41	4.78
3	002470	金正大	62,353,979.00	3.49
4	002497	雅化集团	53,633,940.40	3.00
5	002444	巨星科技	51,643,102.84	2.89
6	002588	史丹利	50,037,118.54	2.80
7	600511	国药股份	48,070,621.64	2.69
8	600657	信达地产	45,059,295.66	2.52
9	000401	冀东水泥	42,064,054.75	2.35
10	600521	华海药业	40,377,244.49	2.26
11	002179	中航光电	33,370,323.82	1.87
12	002672	东江环保	31,723,959.74	1.78
13	601601	中国太保	29,679,494.02	1.66
14	601628	中国人寿	25,572,572.14	1.43
15	600031	三一重工	25,047,259.82	1.40
16	600388	龙净环保	23,852,871.39	1.33
17	600401	海润光伏	23,160,000.00	1.30
18	601318	中国平安	20,449,391.85	1.14
19	000024	招商地产	18,256,631.47	1.02
20	002572	索菲亚	13,473,770.81	0.75

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	600885	宏发股份	143,289,781.20	8.02
2	600401	海润光伏	127,199,293.83	7.12
3	601009	南京银行	123,260,905.58	6.90
4	002672	东江环保	106,195,278.35	5.94
5	600563	法拉电子	102,892,681.82	5.76
6	600312	平高电气	96,895,940.05	5.42
7	600109	国金证券	95,265,517.86	5.33
8	002444	巨星科技	95,258,608.65	5.33
9	002353	杰瑞股份	90,037,296.21	5.04
10	300146	汤臣倍健	86,419,117.89	4.84
11	002179	中航光电	75,649,509.64	4.23
12	002008	大族激光	72,887,798.59	4.08
13	600587	新华医疗	69,333,808.20	3.88
14	002614	蒙发利	61,886,304.64	3.46
15	000625	长安汽车	60,321,850.18	3.38
16	000970	中科三环	51,717,975.53	2.89
17	600525	长园集团	50,932,256.96	2.85
18	002497	雅化集团	50,877,026.94	2.85
19	300024	机器人	46,696,713.66	2.61
20	002023	海特高新	31,721,139.39	1.78

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	963,719,123.79
卖出股票的收入（成交）总额	2,028,129,141.63

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。

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净
----	------	------	--------

			值比例(%)
1	国家债券	56,005,000.00	3.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,003,000.00	0.56
	其中：政策性金融债	10,003,000.00	0.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	66,008,000.00	3.69

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	019306	13 国债 06	460,000	46,000,000.00	2.57
2	019207	12 国债 07	100,000	10,005,000.00	0.56
3	110214	11 国开 14	100,000	10,003,000.00	0.56

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体(除“中国平安”公告其子公司违规情况外)，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。

根据 2014 年 12 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（2014）103 号，决定对平安证券给予警告，没收海联讯保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2,867 万元，并处以 440 万元罚款；同时对保荐人韩长风、霍永涛给予警告，并分别处以 30 万元罚款，撤销证券从业资格。

本基金管理人此前投资中国平安股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就中国平安子公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为平安证券存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

8.2.12.2 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。

8.2.12.3 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	591,956.08
2	应收证券清算款	38,632,470.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,533,269.06
5	应收申购款	24,014,364.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,772,060.57

8.2.12.4 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

9.1.1 国泰金鑫股票型证券投资基金

份额单位：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
46,473	33,002.32	662,543,132.76	43.20%	871,173,597.88	56.80%

9.1.2 金鑫证券投资基金

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	持有份额	占总份额

			比例		比例
49,288	60,866.74	1,997,488,619.00	66.58%	1,002,511,381.00	33.42%

9.2 期末上市基金前十名持有人

金鑫证券投资基金

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	388,751,485.00	12.96%
2	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002 沪	230,441,345.00	7.68%
3	中国人寿保险股份有限公司	179,291,632.00	5.98%
4	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	145,224,781.00	4.84%
5	中国太平洋保险(集团)股份有限公司-集团本级-自有资金-012G-ZY001 沪	77,325,302.00	2.58%
6	伦敦市投资管理有限公司-客户资金	75,439,678.00	2.51%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	72,889,450.00	2.43%
8	中国太平洋财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品-013C-CT001 沪	69,295,866.00	2.31%
9	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	63,324,888.00	2.11%
10	中国人寿保险股份有限公司	53,538,855.00	1.78%

9.3. 国泰金鑫股票型证券投资基金

9.3.1 期末基金管理人的从业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	0.00	0.00%

9.3.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 金鑫证券投资基金

9.4.1 期末基金管理人的从业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	0.00	0.00%

9.4.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年9月15日)基金份额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,249,012,208.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,972,214,637.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	256,919,160.00
本报告期期末基金份额总额	1,533,716,730.64

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

金鑫证券投资基金（以下简称“金鑫基金”，基金代码 500011）以通讯方式召开了基金份额持

有人大会，大会投票表决起止时间为自 2014 年 7 月 11 日起至 2014 年 8 月 11 日 17:00 止。参加本次大会投票表决的金鑫基金基金份额持有人及代理人所持基金份额共计 1,838,260,236 份，占权益登记日金鑫基金总份额 30 亿份的 61.28%，达到法定开会条件，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鑫证券投资基金基金合同》的有关规定。

本次大会审议了《关于金鑫证券投资基金转型有关事项的议案》(以下简称“本次会议议案”)，并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案进行表决，表决结果为：有效表决票所代表的基金份额为 1,838,260,236 份，其中，1,837,960,236 份基金份额同意，300,000 份基金份额反对，0 份基金份额弃权。同意本次会议议案的基金份额占参加本次大会投票表决的持有人及代理人所持基金份额总数的 99.98%，达到参加本次大会投票表决的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鑫证券投资基金基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。

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：

2014 年 9 月 24 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第六届董事会第十次会议审议通过，李志坚先生不再担任公司副总经理。

2014 年 12 月 13 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司总经理变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第十三次会议审议通过，金旭女士不再担任公司总经理。2014 年 12 月 11 日起由公司董事长陈勇胜先生代任总经理。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 130,000 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 国泰金鑫股票型证券投资基金

11.7.1.1 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		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	
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	901,006,442.13	30.35%	820,272.40	30.35%	-
中信建投	3	722,897,101.60	24.35%	658,126.84	24.35%	-
招商证券	3	707,481,489.41	23.83%	644,093.55	23.83%	-
中投证券	2	257,815,496.01	8.68%	234,715.69	8.68%	-
平安证券	3	207,727,244.71	7.00%	189,116.08	7.00%	-
上海证券	1	164,515,543.45	5.54%	149,776.75	5.54%	-
国泰君安	2	7,244,948.11	0.24%	6,596.01	0.24%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (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) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特

定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

11.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	10,490,480.00	100.00%	20,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

11.7.2 金鑫证券投资基金

11.7.2.1 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.2.1.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
民生证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	新增
华融证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	1,462,183,666.49	24.51%	1,331,171.50	24.51%	-
中信建投	3	878,898,655.45	14.73%	800,151.79	14.73%	-
上海证券	1	788,213,817.90	13.21%	717,593.57	13.21%	-
国泰君安	2	589,557,189.10	9.88%	536,730.82	9.88%	-
信达证券	1	533,913,611.88	8.95%	486,076.51	8.95%	-
银河证券	2	443,890,328.18	7.44%	404,118.45	7.44%	-
中投证券	2	343,738,984.08	5.76%	312,937.66	5.76%	-
东方证券	1	322,827,488.15	5.41%	293,901.51	5.41%	-
平安证券	3	276,770,235.28	4.64%	251,972.02	4.64%	-
中信证券	2	166,327,582.76	2.79%	151,423.96	2.79%	-
宏源证券	2	158,469,725.94	2.66%	144,269.94	2.66%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (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) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。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。

11.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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
民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	30,351,587.67	17.40%	-	-	-	-
中信建投	2,385,975.58	1.37%	80,000,000.00	100.00%	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	11,886,332.05	6.82%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	100,796,103.37	57.80%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	28,973,670.15	16.61%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司总部迁址公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-02-24
2	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-02-27
3	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-03-15
4	金鑫证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-03-15
5	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-05-28
6	国泰基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员及其他从业人员子公司兼职情况公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-06-06
7	关于以通讯方式召开金鑫证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-07-04
8	关于以通讯方式召开金鑫证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-07-07
9	关于以通讯方式召开金鑫证券投资基金基金	《中国证券报》、《上海	2014-07-08

	份额持有人大会的第二次提示性公告	证券报》	
10	金鑫证券投资基金停牌提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-07-10
11	关于以通讯方式召开金鑫证券投资基金基金份额持有人大会的第三次提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-07-15
12	金鑫证券投资基金基金份额持有人大会决议生效及相关事项的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-08-13
13	基金金鑫：复牌的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-08-18
14	金鑫证券投资基金终止上市公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-09-02
15	金鑫证券投资基金终止上市第一次提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-09-09
16	金鑫证券投资基金终止上市第二次提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2014-09-12
17	国泰金鑫股票型证券投资基金基金份额集中申购公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-09-15
18	国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-09-18
19	国泰基金管理有限公司副总经理离任公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-09-24
20	国泰金鑫股票型证券投资基金份额“确权”登记指引	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-10-23
21	关于原金鑫证券投资基金基金份额拆分结果公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-10-24
22	关于国泰金鑫股票型证券投资基金集中申购结果公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-10-24
23	国泰金鑫股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-10-24
24	国泰基金管理有限公司总经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2014-12-13

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于同意设立金鑫证券投资基金的批复
- 2、金鑫证券投资基金合同
- 3、金鑫证券投资基金托管协议
- 4、关于金鑫证券投资基金基金份额持有人大会的决议
- 5、国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同
- 6、国泰金鑫股票型证券投资基金托管协议
- 7、国泰金鑫股票型证券投资基金招募说明书
- 8、报告期内披露的各项公告
- 9、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日