

国泰金鹰增长混合型证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金鹰增长混合
基金主代码	020001
交易代码	020001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 5 月 8 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,617,750,515.11 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证基金资产安全前提下，主要通过投资增长型上市公司,分享中国经济增长成果，实现基金资产的中长期增值，同时确保基金资产必要的流动性，将投资风险控制在此较低的水平。
投资策略	资产配置和行业配置采用自上而下的方法；股票选择采用自下而上的方法。基金组合投资的基本范围：股票资产 60%-95%；债券资产 0%-35%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。其中中长期投资占股票投资比例的 80%以上；短期投资占股票投资比例不超过 20%。 股票投资方面,本基金重点投资于主营业务收入或利润具有良好增长潜力的增长型上市公司，从基本面分析入手选择增长型股票。具有以下全部和部分特点的公司将是本基金积极关注的对象： 公司所处的行业增长前景明朗，公司在该行业内具有一定的行业地位，或者具有明显竞争优势和实力，能充分把握行业发展的机遇； 经营业务中至少有一项突出的产品或服务，依靠商业模式和管理水平取胜； 公司主营业务收入或利润增长较快； 财务状况趋于良性，具有合理的现金流状况； 公司管理层敬业负责，经营规范，具有敏锐的商业触觉和创新精神。

	本基金通过对上市公司所处行业增长性及其在行业中的竞争地位、公司商业模式、核心竞争能力、企业资本扩张能力、战略重组等多方面的因素进行综合评估；以上市公司过去两年的主营业务收入和利润增长以及未来两至三年的预期增长性为核心，综合考察上市公司的增长性及其可靠性和可持续性。在此基础上本基金将进一步考量其股价所对应的市盈率、市净率等与市场（行业）平均水平，以及增长性相比是否合理，结合资本市场的具体情况，适时作出具体的投资决策。 债券投资方面，本基金可投资于国债、金融债和企业债等（包括可转换债），按照基金总体资产配置计划，以满足流动性需求为前提，提高基金的收益水平。 本基金将在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响水平、各品种的收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素。通过宏观经济分析、相对价值分析建立由不同类型、不同期限债券品种构成的组合。
业绩比较基准	本基金以上证 A 股指数作为衡量基金业绩的比较基准。
风险收益特征	本基金追求中性偏低的风险收益，通过组合投资于增长型股票，力争实现基金单位资产净值在大盘上涨时增幅不低于比较基准上涨幅度的 65%，大盘下跌时基金单位资产净值跌幅不高于比较基准跌幅的 60%；年度内基金单位资产净值的标准差小于比较基准的标准差。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	巴立康	汤嵩彦
	联系电话	021-31081600转	95559
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		(021)31089000 ,400-888-8688	95559
传真		021-31081800	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	976,148,974.02	244,640,606.73	247,075,176.61
本期利润	874,409,416.56	422,557,022.54	388,699,615.88
加权平均基金份额本期利润	0.5541	0.2294	0.1920
本期基金份额净值增长率	52.73%	23.36%	21.89%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.6320	0.1826	-0.0305
期末基金资产净值	2,640,121,696.29	1,922,876,621.51	1,727,832,197.04
期末基金份额净值	1.632	1.192	0.969

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	33.66%	1.83%	15.85%	1.57%	17.81%	0.26%
过去六个月	-1.29%	3.14%	-17.31%	2.61%	16.02%	0.53%
过去一年	52.73%	2.82%	9.29%	2.45%	43.44%	0.37%
过去三年	129.65%	1.98%	55.90%	1.69%	73.75%	0.29%

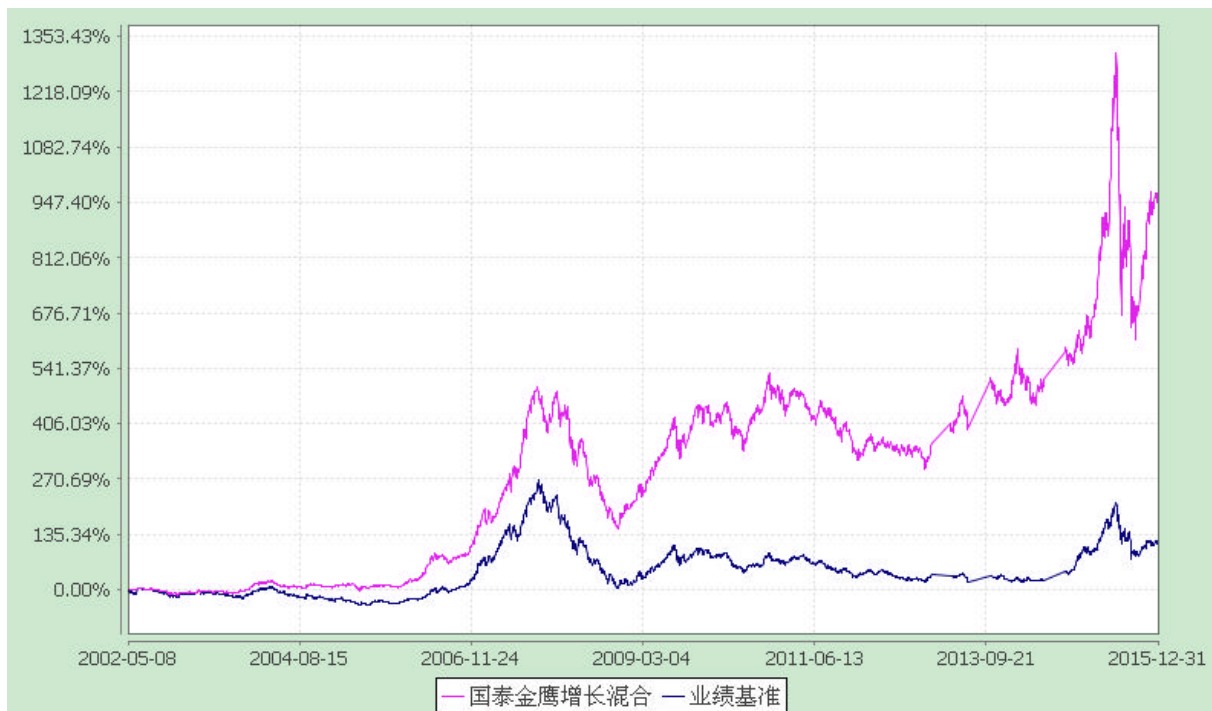
过去五年	82.60%	1.70%	25.99%	1.49%	56.61%	0.21%
自基金合同生效起至今	953.51%	1.53%	112.64%	1.67%	840.87%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金鹰增长混合型证券投资基金

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

(2002 年 5 月 8 日至 2015 年 12 月 31 日)

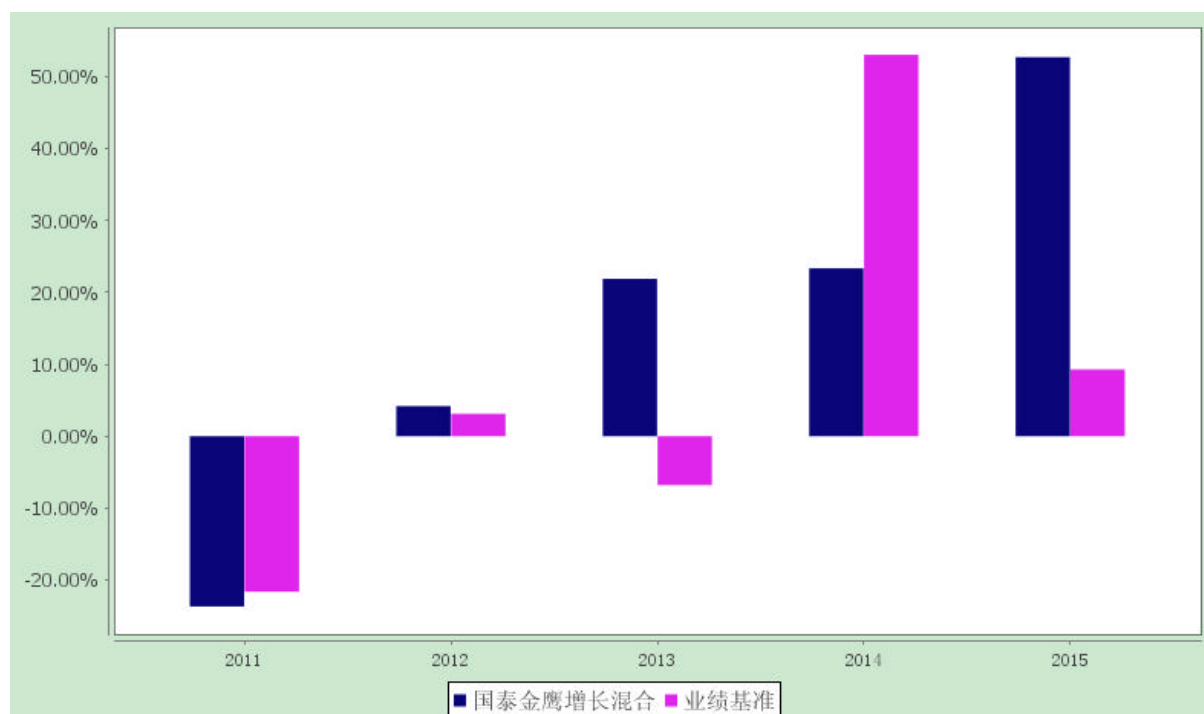


注：本基金的合同生效日为 2002 年 5 月 8 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 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

国泰金鹰增长混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 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
2015 年	1.380	99,166,665.22	121,662,200.49	220,828,865.71	-
2014 年	0.030	2,526,579.21	3,129,291.47	5,655,870.68	-
2013 年	-	-	-	-	-
合计	1.410	101,693,244.43	124,791,491.96	226,484,736.39	-

§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 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 58 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、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)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、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、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(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、国泰价值经典混合型证券投资基金(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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、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、国泰估值优势混合型证券投资基金(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)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金(由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来)、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金。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		
周伟锋	本基金的基金经理 (原国泰金鹰增长股票) 国泰价值经典混合 (LOF) (原国泰价值经典股票 (LOF)) 国泰新经济灵活配置混合、国泰互联网+股票的基金经理	2015-05-11	-	8 年	硕士研究生。曾任中国航天科技集团西安航天发动机厂技术员, 2008 年 7 月加盟国泰基金, 历任研究员, 高级研究员, 2012 年 1 月至 2013 年 6 月任国泰金鹰增长证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理, 2013 年 6 月至 2014 年 7 月任国泰中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理, 2014 年 3 月起兼任国泰价值经典混合型证券投资基金 (LOF) (原国泰价值经典股票型证券投资基金 (LOF)) 的基金经理, 2015 年 1 月起兼任国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 5 月起兼任国泰金鹰增长混合型证券投资基金 (原国泰金鹰增长证券投资基金) 的基金经理, 2015 年 8 月起兼任国泰互联网+股票型证券投资基金的基金经理。
张玮	本基金的基金经理	2008-05-17	2015-05-11	16 年	硕士研究生。2000 年 11 月至 2004 年 6 月就职于申银万国证券研究所, 任行业研究员。2004 年 7 月至 2007 年 3 月就职于银河基金管理有限公司, 历任高级研究员、基金经理。2007 年 3 月加入国泰基金管理有限公司, 任国泰金鹰增长基金的基金经理助理, 2008 年 5 月至 2015 年 5 月担任国泰金鹰增长证券投资基金的基金经理, 2009 年 4 月至 2009 年 10 月兼任国泰金盛封闭的基金经理, 2009 年 10 月至 2015 年 5 月兼任

					国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，2012 年 3 月至 2015 年 5 月兼任国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理。2010 年 7 月至 2011 年 6 月任研究部副总监，2011 年 6 月至 2014 年 3 月任研究部总监。2011 年 6 月至 2012 年 2 月兼任公司投资副总监，2012 年 2 月至 2014 年 3 月兼任公司投资总监，2014 年 3 月至 2015 年 5 月任权益投资总监。
--	--	--	--	--	---

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，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

2015 年，证券市场巨幅震荡：上半年在强烈的改革预期、货币宽松和加杠杆的共同作用下，市场风险偏好显著上升，股票价格大幅上涨，市场估值由结构性偏高转向整体偏高；市场快速上涨，但经济和企业的基本面并未出现能与之相匹配的正向变化，市场系统性风险逐渐积累，最终在去杠杆、改革预期回落、人民币贬值、宏观经济持续偏弱等因素的共同作用下，出现暴跌。

从本基金全年的操作看，由于一季度末我们开始预计市场可能会由结构性泡沫转向整体性泡沫，因此在二季度逐渐降低了资产配置的比例。虽然后来市场下跌的剧烈程度超出了我们的预期，但一方面我们提前降低了仓位，并在市场暴跌的过程中一直保持较低仓位；另一方面我们的资产配置方向主要集中在有估值安全边际的优秀企业，并未参与疯狂的主题性炒作，从而一定程度上规避了市场暴跌的风险，并取得了相对较好的投资业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2015 年度净值增长率为 52.73%，同期业绩比较基准为 9.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过三轮恐慌式暴跌，市场整体估值已经下降到相对合理的位置，甚至出现了结构性低估的现象。随着市场的持续下跌，长期价值型投资者开始进场。我们认为当前的市场环境是布局未来的最佳时机，是专业投资者的主战场。

首先，我们预计未来三年企业盈利可能会出现好转。中国经济低迷的时间已经比较长，导致去库存和去产能的现象逐渐出现，市场本身存在周期性好转的内生性需求；中国经济体量足够庞大，结构足够复杂，人均生活水平仍远低于西方发达经济体，仍然存在规模足够大的市场需求未被满足，经济体的抗风险能力较强，经济腾挪的空间仍较大；新一届政府正在稳步推进的经济转型和制度变革将逐步发挥作用。其次，我们预计中央仍将营造较宽松的货币政策环境。最后，供给侧改革的持续推进可能会成为风险偏好改善的催化剂。

因此我们认为在当前的市场环境中，不必过于悲观，反而应该积极行动，通过更加严格的标准，发挥专业优势，精选个股，寻找适合长期投资的优秀标的。我们将持续关注处于改革和转型方向上

的部分行业，这些行业存在持续较快增长的迹象，一些具有良好成长性的优秀企业已经出现被低估的现象，市场结构性机会明显。我们将持续关注和挖掘未来处于良好发展期的新能源与智能汽车产业、现代农业、智能制造产业、云计算和大数据应用、互联网情景下的新型消费服务和企业服务等相关行业和企业带来的长期投资机会。

一如既往地，为持有人创造稳健良好的中长期业绩回报是我们永远不变的目标。在追求收益的同时，我们将持续关注风险与价值的匹配度，做好风险控制。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人根据本基金基金合同和相关法律法规的规定已于 2015 年 1 月 23 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 1.330 元、2015 年 9 月 25 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.05 元。

截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 1,022,371,181.18 元，可供分配的份额利润为 0.6320 元。本基金管理人根据本基金基金合同和相关法律法规的规定已于 2016 年 1 月 19 日进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 2.50 元，于 3 月 21 日宣告 2016 年第 2 次分红，每 10 份基金份额派发红利 2.88 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

2015 年度，基金托管人在国泰金鹰增长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券

投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年度，国泰基金管理有限公司在国泰金鹰增长混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 2 次收益分配，分配金额为 220,828,865.71 元，符合基金合同的规定。

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

2015 年度，由国泰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国泰金鹰增长混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 许康玮 胡逸嵘签字出具了普华永道中天审字(2016)第 20785 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰金鹰增长混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：	-	-
银行存款	377,526,341.06	84,916,193.39
结算备付金	7,029,533.95	2,830,668.55
存出保证金	1,390,522.75	564,805.41

交易性金融资产	2,191,315,466.35	1,843,474,515.47
其中：股票投资	2,031,068,466.35	1,774,883,894.07
基金投资	-	-
债券投资	160,247,000.00	68,590,621.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,398,033.60	1,419,739.45
应收股利	-	-
应收申购款	110,743,289.02	14,250,706.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,690,403,186.73	1,947,456,628.46
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	40,117,744.96	8,867,763.97
应付赎回款	1,789,261.58	10,010,310.28
应付管理人报酬	3,217,150.77	2,564,033.55
应付托管费	536,191.81	427,338.91
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,216,167.26	2,595,133.97
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	404,974.06	115,426.27
负债合计	50,281,490.44	24,580,006.95
所有者权益：	-	-
实收基金	1,617,750,515.11	1,613,101,876.95
未分配利润	1,022,371,181.18	309,774,744.56
所有者权益合计	2,640,121,696.29	1,922,876,621.51
负债和所有者权益总计	2,690,403,186.73	1,947,456,628.46

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.632 元，基金份额总额 1,617,750,515.11 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰金鹰增长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	936,423,455.72	468,007,801.36
1.利息收入	7,130,475.72	3,230,638.44
其中：存款利息收入	1,755,296.28	1,245,621.16
债券利息收入	5,277,918.96	1,746,279.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	97,260.48	238,737.49
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,029,361,809.71	285,692,291.86
其中：股票投资收益	1,015,800,329.05	265,373,229.44
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-2,430,027.62	401,056.62
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	15,991,508.28	19,918,005.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-101,739,557.46	177,916,415.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,670,727.75	1,168,455.25
减：二、费用	62,014,039.16	45,450,778.82
1.管理人报酬	34,484,797.68	30,225,606.88
2.托管费	5,747,466.40	5,037,601.14
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	21,227,920.40	9,643,403.30
5.利息支出	12,833.68	-
其中：卖出回购金融资产支出	12,833.68	-
6.其他费用	541,021.00	544,167.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	874,409,416.56	422,557,022.54
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	874,409,416.56	422,557,022.54

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金鹰增长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,613,101,876.95	309,774,744.56	1,922,876,621.51

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	874,409,416.56	874,409,416.56
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）	4,648,638.16	59,015,885.77	63,664,523.93
其中：1.基金申购款	1,492,852,133.71	795,372,808.01	2,288,224,941.72
2.基金赎回款	-1,488,203,495.55	-736,356,922.24	-2,224,560,417.79
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）	-	-220,828,865.71	-220,828,865.71
五、期末所有者权益（基金净值）	1,617,750,515.11	1,022,371,181.18	2,640,121,696.29
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 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）	1,782,261,879.59	-54,429,682.55	1,727,832,197.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	422,557,022.54	422,557,022.54
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）	-169,160,002.64	-52,696,724.75	-221,856,727.39
其中：1.基金申购款	1,268,254,925.81	125,227,914.51	1,393,482,840.32
2.基金赎回款	-1,437,414,928.45	-177,924,639.26	-1,615,339,567.71
四、本期向基金份额持	-	-5,655,870.68	-5,655,870.68

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）	1,613,101,876.95	309,774,744.56	1,922,876,621.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张峰，主管会计工作负责人：李辉，会计机构负责人：倪莹

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰金鹰增长混合型证券投资基金(原名为国泰金鹰增长证券投资基金,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[2002]第 12 号《关于同意国泰金鹰增长证券投资基金设立的批复》核准,由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《国泰金鹰增长证券投资基金基金契约》(后更名为《国泰金鹰增长证券投资基金基金合同》)发起,并于 2002 年 5 月 8 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,226,366,461.68 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 29 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》《关于实施 公开募集证券投资基金运作管理办法 有关问题的规定》及《国泰金鹰增长证券投资基金基金合同》,国泰金鹰增长证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日起更名为国泰金鹰增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《国泰金鹰增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括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,其中投资重点是利润或收入具有良好增长潜力的增长型上市公司,这部分投资比例将不低于本基金股票资产的 80%。根据最新公布的《国泰金鹰增长混合型证券投资基金更新招募说明书》,本基金投资组合的基本范围为股票资产 60%-95%;债券资产 0%-35%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的业绩比较基准为上证 A 股指

数。

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 2016 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰金鹰增长混合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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致，会计估计较最近一期年度报告有变更。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》、财税[2015]101 号《关于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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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。

7.4.7 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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)	基金销售机构、受基金管理人的控股股

	东（中国建投）控制的公司
--	--------------

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.本报告期内，申银万国证券股份有限公司吸收合并了基金管理人原关联方宏源证券股份有限公司，并更名为申万宏源集团股份有限公司（以下简称“申万宏源”）。申万宏源为基金管理人控股股东中国建投的控股子公司。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014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
申万宏源	5,396,808,457.28	39.29%	-	-

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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
申万宏源	4,963,314.48	39.31%	2,045,297.04	48.52%

关联方名称	上年度可比期间			
	2014年1月1日至2014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
申万宏源	-	-	-	-

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,484,797.68	30,225,606.88
其中：支付销售机构的客户维护费	3,011,191.73	3,986,135.63

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,747,466.40	5,037,601.14

注：支付基金托管人交通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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
交通银行	377,526,341.06	1,599,544.93	84,916,193.39	1,107,640.31

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2015 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末及上年度末均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
----------	----------	----------	----------	------------	----------	---------	--------------	------------	------------	----

						盘单 价				
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	17.19	-	-	5,000,000.00	17,452,323.99	85,950,000.00	
600271	航天信息	2015-10-12	重大事项	71.46	-	-	220,713.00	11,786,708.00	15,772,150.98	
600420	现代制药	2015-10-21	重大事项	41.76	2016-03-23	33.44	1,498,646.00	52,236,864.87	62,583,456.96	
300025	华星创业	2015-11-26	重大事项	28.28	-	-	2,700,000.00	67,345,432.17	76,356,000.00	

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 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的影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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资产中属于

第一层次的余额为 1,790,406,858.41 元，属于第二层次的余额为 400,908,607.94 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 1,718,890,515.47 元，第二层次 124,584,000.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次；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次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(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 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	2,031,068,466.35	75.49
	其中：股票	2,031,068,466.35	75.49
2	固定收益投资	160,247,000.00	5.96
	其中：债券	160,247,000.00	5.96
	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	384,555,875.01	14.29
7	其他各项资产	114,531,845.37	4.26
8	合计	2,690,403,186.73	100.00

8.2 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	1,492,689,455.40	56.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,956,000.00	0.98

E	建筑业	17,488,216.00	0.66
F	批发和零售业	177,284,860.45	6.72
G	交通运输、仓储和邮政业	20,618,496.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	113,743,067.30	4.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,388,000.00	0.77
L	租赁和商务服务业	28,401,065.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	35,200,299.20	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	99,299,007.00	3.76
S	综合	-	-
	合计	2,031,068,466.35	76.93

8.3 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

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	002588	史丹利	7,291,394	237,189,046.82	8.98
2	002594	比亚迪	2,080,000	133,952,000.00	5.07
3	002179	中航光电	3,000,000	113,880,000.00	4.31
4	002466	天齐锂业	800,000	112,600,000.00	4.26
5	603898	好莱客	3,280,095	111,457,628.10	4.22
6	603883	老百姓	1,400,010	99,358,709.70	3.76
7	300133	华策影视	3,333,300	99,299,007.00	3.76
8	300124	汇川技术	1,980,000	93,456,000.00	3.54
9	300043	互动娱乐	5,000,000	85,950,000.00	3.26
10	300025	华星创业	2,700,000	76,356,000.00	2.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002588	史丹利	202,648,836.54	10.54
2	002594	比亚迪	190,935,486.11	9.93
3	300124	汇川技术	168,454,497.24	8.76
4	300295	三六五网	166,200,250.89	8.64
5	603883	老百姓	142,530,024.71	7.41
6	600060	海信电器	139,607,801.65	7.26
7	600563	法拉电子	137,897,571.56	7.17
8	603898	好莱客	128,911,300.06	6.70
9	000793	华闻传媒	127,725,333.16	6.64
10	002108	沧州明珠	126,157,232.05	6.56
11	300133	华策影视	122,801,684.56	6.39
12	000100	TCL 集团	118,544,784.66	6.16
13	600079	人福医药	117,750,958.18	6.12
14	002179	中航光电	115,834,038.18	6.02
15	300070	碧水源	108,763,982.45	5.66
16	600223	鲁商置业	101,431,957.35	5.28
17	002104	恒宝股份	87,983,680.45	4.58
18	002436	兴森科技	85,921,335.29	4.47
19	600483	福能股份	84,323,879.72	4.39
20	000513	丽珠集团	84,159,886.32	4.38
21	600885	宏发股份	81,638,369.85	4.25
22	002466	天齐锂业	80,447,288.13	4.18
23	000069	华侨城 A	79,684,676.95	4.14
24	600366	宁波韵升	79,527,015.50	4.14
25	600198	大唐电信	76,700,870.23	3.99
26	300025	华星创业	74,828,033.48	3.89
27	300041	回天新材	72,920,110.21	3.79
28	601777	力帆股份	72,909,130.48	3.79
29	601799	星宇股份	70,848,165.35	3.68
30	002312	三泰控股	67,035,117.12	3.49
31	603939	益丰药房	61,147,199.11	3.18

32	000625	长安汽车	60,759,769.03	3.16
33	000559	万向钱潮	60,667,361.90	3.16
34	002410	广联达	60,157,529.29	3.13
35	601988	中国银行	60,002,413.53	3.12
36	601985	中国核电	58,326,145.96	3.03
37	002454	松芝股份	58,206,534.46	3.03
38	600108	亚盛集团	55,167,189.35	2.87
39	603788	宁波高发	55,002,893.11	2.86
40	600805	悦达投资	54,304,929.19	2.82
41	600511	国药股份	53,938,028.41	2.81
42	300083	劲胜精密	53,271,482.04	2.77
43	600900	长江电力	53,240,000.00	2.77
44	300427	红相电力	52,419,487.64	2.73
45	600420	现代制药	52,236,864.87	2.72
46	002311	海大集团	51,888,296.74	2.70
47	300367	东方网力	51,680,622.52	2.69
48	002284	亚太股份	51,587,153.76	2.68
49	601318	中国平安	51,490,536.87	2.68
50	002117	东港股份	50,346,327.08	2.62
51	002539	新都化工	49,077,039.77	2.55
52	300292	吴通控股	48,368,989.83	2.52
53	600470	六国化工	45,847,476.13	2.38
54	601727	上海电气	45,280,948.70	2.35
55	002642	荣之联	44,531,564.99	2.32
56	002433	太安堂	44,191,798.49	2.30
57	600571	信雅达	43,684,343.22	2.27
58	600579	天华院	42,688,426.90	2.22
59	002674	兴业科技	42,221,314.17	2.20
60	002460	赣锋锂业	41,730,715.00	2.17
61	600270	外运发展	40,670,952.75	2.12
62	600884	杉杉股份	40,657,229.91	2.11
63	002766	索菱股份	40,404,795.82	2.10
64	600109	国金证券	40,385,804.49	2.10
65	601233	桐昆股份	39,911,903.00	2.08
66	600588	用友网络	39,614,520.70	2.06
67	000150	宜华健康	38,640,132.08	2.01

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。

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	300058	蓝色光标	254,953,572.61	13.26
2	300147	香雪制药	248,932,439.97	12.95
3	300043	互动娱乐	214,925,182.57	11.18
4	600660	福耀玻璃	207,874,157.21	10.81
5	600563	法拉电子	170,116,652.49	8.85
6	601318	中国平安	159,587,407.84	8.30
7	600335	国机汽车	141,254,055.25	7.35
8	002215	诺 普 信	135,732,005.54	7.06
9	000100	TCL 集团	125,503,665.66	6.53
10	600773	西藏城投	122,175,758.79	6.35
11	002108	沧州明珠	121,145,834.36	6.30
12	600060	海信电器	116,094,137.73	6.04
13	300070	碧水源	112,876,136.18	5.87
14	600079	人福医药	105,235,450.02	5.47
15	000793	华闻传媒	104,094,265.10	5.41
16	600223	鲁商置业	102,366,075.68	5.32
17	600198	大唐电信	101,567,808.07	5.28
18	000559	万向钱潮	94,560,732.86	4.92
19	600657	信达地产	94,138,815.13	4.90
20	002311	海大集团	92,195,177.03	4.79
21	002104	恒宝股份	92,006,093.20	4.78
22	600617	国新能源	90,878,133.64	4.73
23	600483	福能股份	87,644,685.08	4.56
24	002588	史丹利	86,291,074.97	4.49
25	300295	三六五网	83,319,059.22	4.33
26	002539	新都化工	80,775,845.99	4.20
27	002410	广联达	76,343,928.88	3.97
28	002470	金正大	72,531,846.99	3.77
29	600885	宏发股份	72,424,740.42	3.77
30	600388	龙净环保	72,228,789.82	3.76
31	002436	兴森科技	69,814,583.51	3.63
32	601985	中国核电	67,004,446.59	3.48
33	000513	丽珠集团	60,849,819.59	3.16
34	002433	太安堂	59,807,226.34	3.11
35	600031	三一重工	58,292,761.71	3.03
36	300041	回天新材	58,199,616.17	3.03
37	002594	比亚迪	58,187,172.44	3.03
38	601727	上海电气	57,778,256.81	3.00
39	600366	宁波韵升	57,648,530.00	3.00
40	002454	松芝股份	57,549,626.62	2.99
41	002117	东港股份	56,833,531.52	2.96

42	601988	中国银行	55,877,455.73	2.91
43	600900	长江电力	55,424,656.26	2.88
44	600108	亚盛集团	54,679,042.16	2.84
45	300367	东方网力	54,502,243.45	2.83
46	600401	*ST 海润	54,144,597.01	2.82
47	300203	聚光科技	53,884,601.40	2.80
48	601668	中国建筑	53,060,046.95	2.76
49	002312	三泰控股	52,337,307.46	2.72
50	600511	国药股份	52,022,224.58	2.71
51	002496	辉丰股份	51,664,959.75	2.69
52	600579	天华院	51,548,684.23	2.68
53	300364	中文在线	50,840,119.00	2.64
54	002766	索菱股份	50,629,571.23	2.63
55	600805	悦达投资	49,717,639.56	2.59
56	002642	荣之联	49,254,263.61	2.56
57	300124	汇川技术	48,793,614.60	2.54
58	603788	宁波高发	48,541,802.76	2.52
59	002466	天齐锂业	46,357,450.22	2.41
60	600470	六国化工	46,339,000.34	2.41
61	600109	国金证券	45,879,885.98	2.39
62	600588	用友网络	45,140,976.51	2.35
63	600571	信雅达	44,749,552.53	2.33
64	601233	桐昆股份	44,205,947.05	2.30
65	000069	华侨城 A	42,387,735.89	2.20
66	600270	外运发展	41,940,094.04	2.18
67	000625	长安汽车	41,600,677.10	2.16
68	300133	华策影视	38,805,942.17	2.02
69	002285	世联行	38,792,970.03	2.02
70	000150	宜华健康	38,616,107.11	2.01

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。

8.4.3 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	6,544,705,969.74
卖出股票的收入（成交）总额	7,203,198,023.22

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。

8.5 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	120,213,000.00	4.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,034,000.00	1.52
	其中：政策性金融债	40,034,000.00	1.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	160,247,000.00	6.07

8.6 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	019509	15 国债 09	500,000	50,110,000.00	1.90
2	150015	15 付息国债 15	500,000	50,055,000.00	1.90
3	150215	15 国开 15	300,000	30,039,000.00	1.14
4	019506	15 国债 06	200,000	20,048,000.00	0.76
5	110225	11 国开 25	100,000	9,995,000.00	0.38

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.12 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。

8.12.3 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	1,390,522.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,398,033.60

5	应收申购款	110,743,289.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,531,845.37

8.12.4 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可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300043	互动娱乐	85,950,000.00	3.26	重大事项
2	300025	华星创业	76,356,000.00	2.89	重大事项

§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
40,858	39,594.46	951,490,820.82	58.82%	666,259,694.29	41.18%

9.2 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	249,429.76	0.02%

9.3 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(2002 年 5 月 8 日)基金份额总额	2,226,366,461.68
本报告期期初基金份额总额	1,613,101,876.95
本报告期基金总申购份额	1,492,852,133.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,488,203,495.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,617,750,515.11

§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：

2015 年 8 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司总经理任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第十七次会议审议通过，聘任张峰先生担任公司总经理。

2015 年 8 月 14 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十八次会议审议通过，贺燕萍女士不再担任公司副总经理。

2015 年 8 月 22 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经国泰基金管理有限公司第六届董事会第二十次会议审议通过，唐建光先生担任公司董事长、法定代表人，陈勇胜先生不再担任相关职务。

2015 年 9 月 1 日 本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经国泰基金管理有限公司第六届董事会第二十一次会议审议通过，林海先生不再担任公司督察长，由巴立康先生代任相关职务。

2015 年 12 月 10 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理任职公告》，经国泰基金管理有限公司第六届董事会第二十二次会议审议通过，聘任陈星德先生担任公司副总经理。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内,交通银行股份有限公司(以下简称“本行”)因工作需要,刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁,任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

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,本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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 100,000 元,目前的审计机构提供审计服务的年限为 14 年。

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		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	
广州证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	5,396,808,457.28	39.29%	4,963,314.48	39.31%	-
兴业证券	1	1,790,643,451.64	13.04%	1,648,690.09	13.06%	-
中银国际	1	1,626,207,742.45	11.84%	1,504,550.24	11.92%	-
信达证券	1	1,569,001,163.34	11.42%	1,428,752.59	11.32%	-
平安证券	1	911,861,693.71	6.64%	831,560.18	6.59%	-
中金公司	1	834,516,495.16	6.08%	763,998.69	6.05%	-
银河证券	1	812,097,699.95	5.91%	756,295.41	5.99%	-

国泰君安	2	793,387,791.13	5.78%	729,625.11	5.78%	-
------	---	----------------	-------	------------	-------	---

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。

11.7.2 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
中银国际	260,744,474.94	57.84%	-	-	-	-
信达证券	-	-	228,000,000.00	77.82%	-	-
平安证券	124,222,382.56	27.55%	65,000,000.00	22.18%	-	-
银河证券	65,853,153.45	14.61%	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》《关于实施 公开募集证券投资基金运作管理办法 有关问题的规定》及《国泰金鹰增长证券投资基金基金合同》的约定，本基金自 2015 年 8 月 8 日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由“国泰金鹰增长证券投资基金”

修改为“国泰金鹰增长混合型证券投资基金”基金合同部分条款相应修订。具体请查阅本公司于 2015 年 7 月 23 日披露的《关于修订国泰金鹰增长证券投资基金基金合同的公告》。