

国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年十月二十六日

§1 重要提示
基金管理人董事会及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

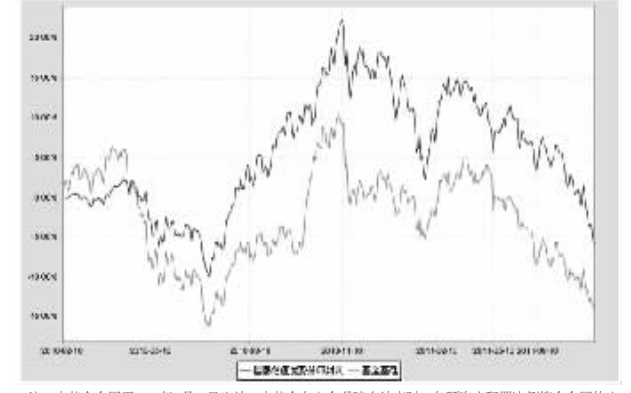
Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

§2 基金产品概况
基金的投资目标：坚持价值投资的理念，力争在有效控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.



§3 主要财务指标和基金净值表现
注：① 本期已实现收益指按本期利息收入、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。

§4 管理人报告
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

广发聚祥保本混合型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年十月二十六日

§1 重要提示
基金管理人董事会及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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

§2 基金产品概况
基金的投资目标：在力争保本周期到期时本金安全的前提下，严格控制风险，谋求基金资产的稳定增值。

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

§3 主要财务指标和基金净值表现
注：1. 本期已实现收益指按本期利息收入、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。

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.



§4 管理人报告
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

§3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内，本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

面对这种系统性风险，我们选择了继续持有，报告期权益资产未作任何投资。2011年第三季度债券市场整体表现良好，物价继续高位盘整，紧缩节奏继续，债市收益普遍上升。

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Ratio)

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Ratio)

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Ratio)

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Ratio)

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Ratio)

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), etc.

§7 备查文件目录
7.1 备查文件目录
7.2 存放地点
7.3 查阅方式