

## 国泰金牛创新成长股票型证券投资基金

### 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

**基金管理人: 国泰基金管理有限公司**  
**基金托管人: 招商银行股份有限公司**  
**报告送出日期: 二〇一三年四月二十二日**

**1.1 重要提示**

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有风险,投资需谨慎。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。

本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	国泰金牛创新成长
基金代码	020010
交易代码	020010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年5月18日
报告期末基金份额总额	4,055,208,479.999份

投资目标: 本基金为成长型股票基金,主要投资于通过自主创新实现快速发展、具有高速增长潜力的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。

投资策略: 本基金将自上而下进行宏观和微观经济分析,在把握宏观经济运行趋势的基础上,结合中短期的经济周期,宏观政策方向及市场资金面等因素,通过收益和风险匹配的方法,在股票、债券、货币市场基金、股指期货等金融工具中进行资产配置,并动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	47,535,970.62	1.06
C	制造业	1,785,299,569.60	39.82
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	267,371,678.31	5.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	612,803,516.02	13.67
J	金融业	761,257,385.79	16.98
K	房地产业	83,603,260.27	1.91
L	租赁和商务服务业	303,256,640.75	6.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育、文化和体育业	-	-
Q	卫生和社会工作	119,561,011.90	2.67
R	文化、体育和娱乐业	74,358,958.29	1.66
S	综合	4,057,047,936.55	90.49

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002400	许继股份	6,657,665	303,256,640.75	6.76
2	600115	上海医药	3,813,849	267,427,091.88	5.96
3	600087	新华百货	5,806,361	217,873,424.72	4.86
4	601877	华鲁恒升	8,498,576	186,805,294.84	4.17
5	002063	景津装备	10,461,962	163,334,248.62	3.65
6	000313	国民汽车	11,451,728	148,539,912.00	3.31
7	600236	大华股份	2,079,084	144,496,316.00	3.22
8	600572	康恩迪	11,389,709	143,054,745.04	3.19
9	300168	万里石	7,106,018	142,830,961.60	3.19
10	601601	中国石化	7,476,040	136,736,771.60	3.05

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券名称	债券数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	100,444,640	100,444,640.00	0.23
2	央行票据	29,970,000.00	29,970,000.00	0.67
3	金融债券	40,068,000.00	40,068,000.00	0.89
4	企业债	40,068,000.00	40,068,000.00	0.89
5	中期票据	-	-	-
6	短期融资券	-	-	-
7	可转债	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	80,541,444.60	1.80

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001074	10央行票据74	300,000	29,970,000.00	0.67
2	120216	12国债16	200,000	20,004,000.00	0.45
3	010107	11国债07	100,000	10,503,444.60	0.23
4	110224	11国债24	100,000	10,060,000.00	0.22
5	120218	12国债18	100,000	10,004,000.00	0.22

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.11 报告期末本基金持有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**

本基金本报告期末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。

**5.12 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.13 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.14 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.15 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.16 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.17 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.18 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.19 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.20 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.21 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.22 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.23 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.24 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.25 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.26 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.27 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.28 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.29 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.30 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.31 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.32 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.33 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.34 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.35 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

## 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

### 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

**基金管理人: 国泰基金管理有限公司**  
**基金托管人: 招商银行股份有限公司**  
**报告送出日期: 二〇一三年四月二十二日**

**1.1 重要提示**

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有风险,投资需谨慎。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。

本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	国泰中小盘成长股票(LOF)场内简称: 国泰小盘
基金代码	160211
交易代码	160211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月19日
报告期末基金份额总额	828,092,411.87份

投资目标: 本基金主要投资于具有较高成长性且符合本基金的中小盘股票,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。

投资策略: 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济趋势的判断分析,评价各行业的相对投资价值,并结合行业景气度、行业生命周期、行业竞争格局等因素,选择具有较高成长性的行业进行投资。本基金将自上而下进行宏观和微观经济分析,在把握宏观经济运行趋势的基础上,结合中短期的经济周期,宏观政策方向及市场资金面等因素,通过收益和风险匹配的方法,在股票、债券、货币市场基金、股指期货等金融工具中进行资产配置,并动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300058	蓝色光标	2,600,407	80,698,695.60	10.09
2	600660	福耀玻璃	7,484,095	66,066,014.45	7.65
3	002140	东华科技	1,816,228	52,634,287.44	6.54
4	600335	国民汽车	4,000,449	51,891,011.53	6.53
5	300043	星辉车模	2,552,506	49,188,796.62	6.30
6	300147	香雪制药	1,900,000	44,366,000.00	4.24
7	600572	康恩迪	2,288,964	28,247,264.16	3.56
8	600818	康盛药业	681,786	22,484,576.72	2.81
9	000073	四川美丰	1,772,483	21,269,796.00	2.68
10	300035	方正富邦	864,871	19,200,136.20	2.42

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券名称	债券数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	-	-	-
4	企业债	-	-	-
5	中期票据	-	-	-
6	短期融资券	-	-	-
7	可转债	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	-	-

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120205	12国债05	300,000	29,970,000.00	3.78
2	120205	12国债05	100,000	16,004,800.00	2.02
3	125887	中期票据	800	106,246,422.00	13.36

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10 报告期末本基金持有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**

本基金本报告期末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。

**5.11 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.12 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.13 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.14 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.15 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.16 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.17 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.18 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.19 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.20 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.21 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.22 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.23 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.24 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.25 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.26 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.27 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.28 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.29 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.30 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.31 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.32 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.33 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.34 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.35 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.36 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.37 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

**5.38 基金管理人、基金托管人及基金销售机构基金业务资格批件和注册情况**

基金管理人: 国泰基金管理有限公司, 基金托管人: 招商银行股份有限公司。

## 国泰成长优选股票型证券投资基金

### 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

**基金管理人: 国泰基金管理有限公司**  
**基金托管人: 招商银行股份有限公司**  
**报告送出日期: 二〇一三年四月二十二日**

**1.1 重要提示**

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有风险,投资需谨慎。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。

本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	国泰成长优选股票
基金代码	020026
交易代码	020026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月20日
报告期末基金份额总额	62,978,166.79份

投资目标: 本基金为精选具有较高成长性和良好本质的优质企业,结合估值因素对投资组合进行积极管理,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。

投资策略: 本基金将自上而下进行宏观和微观经济分析,在把握宏观经济运行趋势的基础上,结合中短期的经济周期,宏观政策方向及市场资金面等因素,通过收益和风险匹配的方法,在股票、债券、货币市场基金、股指期货等金融工具中进行资产配置,并动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300058	蓝色光标	2,600,407	80,698,695.60	10.09
2	600660	福耀玻璃	7,484,095	66,066,014.45	7.65
3	002140	东华科技	1,816,228	52,634,287.44	6.54
4</					