国泰金鹰增长证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30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:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰金鹰增长股票
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
报告期末基金份额总额	1,996,971,967.11份
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:①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;②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;③公司主营业务收入或利润增长较快;④财务状况趋于良性,具有合理的现金流状况;⑤公司管理层敬业负责,经营规范,具有敬畏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期望增长性为核心,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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日–2013年6月30日)
1.本期已实现收益	82,848,895.51
2.本期利润	–25,924,719.95
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0125
4.期末基金资产净值	1,721,644,144.98
5.期末基金份额净值	0.862

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 本报告期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

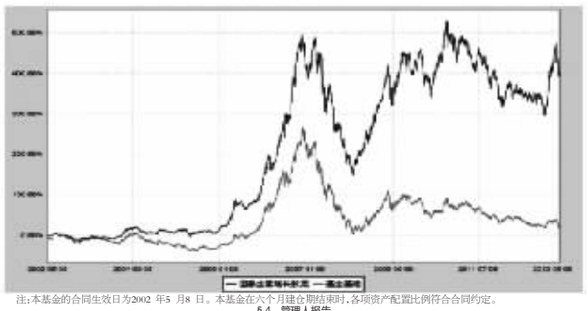
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–2.05%	1.45%	–11.52%	1.20%	9.47%	0.25%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

国泰金鹰增长证券投资基金

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2013年6月30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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张玮	本基金的基金经理、国泰中小盘成长股票(LOF)、国泰成长优选股票的基金经理、公司投资总监兼研究部总监	2008–5–17	–	13	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月起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月兼任国泰金鹰新闭的基金经理,2009年10月起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月起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月起任研究部总监。2011年6月至2012年2月兼任公司投资副总监,2012年2月起兼任公司投资总监。

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遵规守信情况的说明

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,本基金不发生损害基金份额持有人利益的行为,投资运作符合法律法规和基金合同的规定,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所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 公平交易专项说明

4.3.1 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,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,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。

4.3.2 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所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 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

国内宏观经济在二季度相对偏弱的走势,叠加了美国QE的退出预期,使得中国股市在二季末表现相对疲软。特别是与过往经济周期相关的投资拉动型行业,受到了明显的压力。同时,由于央行货币市场短期预期的调整,使得临近二季度末的货币市场出现了历史上较为罕见的紧张状况。几个因素的叠加,使得上证综指在六月底创出了近4年多以来的新低,最终二季度上证综指实现了11.51%的较大跌幅。而新兴产业、成长股的代表创业板指数则在一季度大涨21.38%的情况下,继续大幅上涨16.76%,如此大的结构性差异在A股历史上较为罕见。

从本基金二季度的操作情况来看,正如我们在一季度报告中判断,宏观经济仍然处于弱复苏当中,因此,我们把资产更多地配置了与转型、消费等相关的行业与个股,增持了受益于经济结构转型的消费电子、食品饮料等行业,同时减持了受经济与政策影响较大的化工、家电等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2013年第二季度的净值增长率为–2.05%,同期业绩比较基准收益率为–11.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前时点观察未来的宏观经济走势,我们认为宏观经济仍然将继续处于弱复苏局面。随着新一届政府不断深化改革,旧的增长模式在未来将受到较大的挑战,政府将把更多的精力投放在市场效率改善、民生、生活环境等的提高。过去投资人比较注重GDP增速的预判,未来我们将看重GDP的质量与效率。在未来的投资方向上,我们也将更多地侧重有利于经济结构转型的方向。

对于证券市场,目前市场主体对经济的增速预期已经有所调降,我们认为近期不大具备形成大的趋势性行情的条件,但未来一段时间内结构性行情仍将存在。我们将继续重点配置符合经济转型、技术创新、品牌消费等的方向与行业。短期来看这些行业中估值相对较高,我们将保持适度谨慎,仔细甄别,耐心寻找更好的买入时机。

在追求收益的同时,更加注重风险评估和风险控制,为持有人创造稳健向好的中长期业绩回报将是我们不变的目标。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	1,533,704,221.05	86.74
	其中:股票	1,533,704,221.05	86.74
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	131,973,567.84	7.46
	其中:债券	131,973,567.84	7.46
	资产支持证券	–	–
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	97,436,721.54	5.51
7	其他各项资产	5,096,181.88	0.29
8	合计	1,768,210,692.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
C	制造业	781,323,969.36	45.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,845,356.32	1.68
E	建筑业	264,330,874.76	15.35
F	批发和零售业	122,485,243.65	7.11
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	22,579.60	0.00
J	金融业	–	–
K	房地产业	48,927,942.05	2.84
L	租赁和商务服务业	217,390,061.60	12.63
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	12,671,963.20	0.74
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	57,704,286.51	3.35
S	综合	1,944.00	0.00
	合计	1,533,704,221.05	89.08

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	3,987,300	166,270,410.00	9.66
2	600660	福耀玻璃	20,048,791	144,150,807.29	8.37
3	300147	香雪制药	7,684,383	128,943,946.74	7.49
4	600335	国机汽车	10,604,783	122,485,243.65	7.11
5	002140	东华科技	4,861,052	120,602,700.12	7.01
6	600572	康恩贝	8,005,877	88,785,175.93	5.16
7	601117	中国化学	9,201,368	87,597,023.36	5.09
8	300043	星辉车模	8,221,361	87,475,281.04	5.08
9	002022	科华生物	3,543,849	52,484,403.69	3.05
10	601888	中国国旅	1,750,673	51,119,651.60	2.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,910,000.00	2.90
2	央行票据	–	–
3	金融债券	19,761,000.00	1.15
	其中:政策性金融债	19,761,000.00	1.15
4	企业债券	41,379,000.00	2.40
5	企业短期融资券	20,122,000.00	1.17
6	中期票据	–	–
7	可转债	801,567.84	0.05
8	其他	–	–
9	合计	131,973,567.84	7.67

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	019307	13国债07	500,000	49,910,000.00	2.90
2	112051	11报喜02	300,000	31,290,000.00	1.82
3	041253042	12深茂业CP002	200,000	20,122,000.00	1.17
4	1180113	11晋南债02	100,000	10,089,000.00	0.59
5	110221	11国开21	100,000	9,930,000.00	0.58

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和掘益明细

本基金本报告期未持有股指期货

5.8.2 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	392,990.20
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,201,119.18
5	应收申购款	2,502,072.50
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,096,181.88

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110016	川投转债	677,688.00	0.04
2	125887	中鼎转债	123,879.84	0.01

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600335	国机汽车	122,485,243.65	7.11	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,143,653,958.51
本报告期基金总申购份额	116,295,163.73
减:本报告期基金总赎回份额	262,977,155.13
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	1,996,971,967.11

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于同意设立国泰金鹰增长证券投资基金的批复

2、国泰金鹰增长证券投资基金合同

3、国泰金鹰增长证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

7.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼。

7.3 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)38569000、400-888-8688

客户投诉电话:(021)38569000

公司网址:http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的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2013年7月16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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰金鼎价值混合
基金主代码	519021
交易代码	519021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月11日
报告期末基金份额总额	3,942,030,270.46份
投资目标	本基金为价值精选混合型基金,以量化指标分析为基础,在严密的风险控制前提下,不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	A.大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策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、债券及现金类资产的配置比例。 B.股票资产投资策略 本基金以量化分析为基础,从上市公司的基本面分析入手,建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和α值,运用组合优化模型,积极创建并持续优化基金的股票组合,在有效控制组合总体风险的前提下,谋求超额收益。 C.债券资产投资策略 本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日–2013年6月30日)
1.本期已实现收益	77,881,471.21
2.本期利润	16,958,622.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042
4.期末基金资产净值	2,525,181,562.95
5.期末基金份额净值	0.641

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 本报告期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

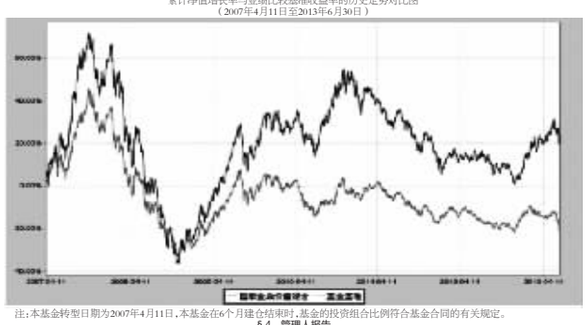
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	0.63%	1.21%	–7.28%	0.78%	7.91%	0.43%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

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

(2007年4月11日至2013年6月30日)



注:本基金转型日期为2007年4月11日,本基金在6个月建仓结束时,基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓时锋	本基金的基金经理、国泰区位优势股票的基金经理	2008–4–3	–	13	硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、社保111组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理。2008年4月起任国泰金鼎价值混合的基金经理。2009年5月起兼任国泰区位优势股票的基金经理。

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遵规守信情况的说明

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,本基金不发生损害基金份额持有人利益的行为,投资运作符合法律法规和基金合同的规定,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所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 公平交易专项说明

4.3.1 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,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,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。

4.3.2 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所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 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

二季度我国宏观经济减速迹象明显,钢铁、水泥和煤炭等工业品价格都出现明显回落,发电量增速也呈现出放缓的趋势,四月份的发电量增速为6.2%,五月份增速下降到4.1%。最新公布的六月份PMI为50.1%,比五月份回落0.7%,从近几年来看,今年六月份的PMI处于历史同期的最低水平,这表明当前经济仍延续疲弱的格局,中小企业的压力较大。受外汇、古就减少和整顿影子银行等综合因素的影响,六月份银行间市场资金紧张,随着央行陆续注入流动性,形势才逐步缓解。总体而言,二季度的经济运行体现出来来的经济发展速度不再是首要目标,而经济结构的转型、民生改善与生态环境的保护则受到特别重视,从而确保我国经济的长期可持续发展。

二季度A股市场呈熊态,上证综指大幅下跌11.51%。其中信息服务、电子、信息设备、医药生物和食品饮料等行业涨幅居前,而有色金属、黑色金属、采掘和交通运输等行业跌幅较大。

本基金在五月底降低了股票仓位,同时调整了组合结构,增加了电子和信息服务等行业的配置权重,减持了非银金融和公用事业等行业的配置权重,取得了较好效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2013年第二季度的净值增长率为0.63%,同期业绩比较基准收益率为–7.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前我国经济正处于结构转型的过程中,原有的经济增长模式受到挑战,而新的经济增长点还不明确,短期的经济减速所带来的阵痛难以避免。三季度我们将密切关注宏观经济的走势,房地产调控措施的变化,以及经济结构转型给新兴产业带来的变化。我们对于三季度的市场持谨慎乐观的态度,注重自下而上的个股选择,在有效控制风险的情况下,用积极的心态把握结构性的投资机会。本基金下一阶段将在股票仓位方面保持一定的灵活性,同时关注以下几个方面的投资机会:(1)具有核心竞争力,估值水平合理的优质消费品行业龙头;(2)行业地位突出,估值低的优质监管股;(3)未来市场空间广阔,成长性好的新兴产业龙头企业;(4)符合国家产业结构调整规划,在未来产业升级过程中受益的优势装备制造业。

本基金将一如既往的将守基金契约,在价值投资理念的指导下,精选个股,注重组合的流动性,力争在有效控制风险的情况下为投资者创造最大的价值。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,973,239,202.09	77.29
	其中:股票	1,973,239,202.09	77.29
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	192,412,353.60	7.54
	其中:债券	192,412,353.60	7.54
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	133,500,800.25	5.23
	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	250,178,003.56	9.80
7	其他各项资产	3,842,830.78	0.15
8	合计	2,553,173,190.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
C	制造业	1,209,930,675.13	47.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	121,270,020.76	4.80
F	批发和零售业	192,126,848.22	7.61
G	交通运输、仓储和邮政业	594,000.00	0.02
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	276,872,500.93	10.96
J	金融业	–	–
K	房地产业	148,521,512.85	5.88
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	23,923,644.20	0.95
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,973,239,202.09	78.14

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	600518	康美药业	12,227,500	235,134,825.00	9.31
2	000671	阳光城	12,533,461	148,521,512.85	5.88
3	600276	恒瑞医药	5,633,615	148,502,091.40	5.88
4	600887	伊利股份	4,501,722	140,813,864.16	5.58
5	300168	万达信息	5,058,029	136,516,202.71	5.41
6	000538	云南白药	1,500,000	126,015,000.00	4.99
7	600511	国药股份	8,765,466	125,696,782.44	4.98
8	300188	美亚柏科	5,006,652	81,808,693.68	3.24
9	002635	安洁科技	1,502,933	67,737,190.31	2.68
10	000049	德赛电池	1,107,420	66,445,200.00	2.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	112,821,000.00	4.47
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	19,900,000.00	0.79
6	中期票据	–	–
7	可转债	59,691,353.60	2.36
8	其他	–	–
9	合计	192,412,353.60	7.62

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	019219	12国债19	600,000	59,940,000.00	2.37
2	110015	石化转债	343,160	34,254,231.20	1.36
3	019307	13国债07	300,000	29,946,000.00	1.19
4	113003	重工转债	200,000	21,864,000.00	0.87
5	041354007	13亿利集CP001	200,000	19,900,000.00	0.79

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和掘益明细

本基金本报告期未持有股指期货。

5.8.2 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	896,388.46
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,503,744.67
5	应收申购款	442,697.65
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,842,830.78

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	34,254,231.20	1.36
2	113003	重工转债	21,864,000.00	0.87
3	113002	工行转债	2,187,600.00	0.09
4	113001	中行转债	1,385,522.40	0.05

5.9.5 报告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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	4,055,828,814.97
本报告期基金总申购份额	8,883,657.75
减:本报告期基金总赎回份额	122,682,202.26
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	3,942,030,270.46

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于核准金鼎证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复

2、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同

3、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

7.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼。

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。

7.3 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)38569000、400-888-8688

客户投诉电话:(021)38569000

公司网址:http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

国泰沪深300指数证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的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