国泰金马稳健回报证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰金马稳健混合
基金主代码	020005
交易代码	020005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月18日
报告期末基金份额总额	5,408,892,996.87份
投资目标	通过股票、债券资产和现金类资产的合理配置,高度适应中国宏观经济的发展变化。紧盯不同时期对中国GDP增长具有重大贡献或因GDP的高速增长而获得较大受益的行业和上市公司,最大程度地分享中国宏观经济的成长成果,为基金持有人谋求稳健增长的长期回报。
投资策略	本基金采取定性与定量分析相结合的方式,通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险;通过对不同时期与GDP增长密切相关的投资、消费、进出口等因素的深层研究,准确预期并把握对GDP增长贡献度大及受GDP增长拉动受益度大的重点行业及上市公司;通过个股选择,挖掘具有成长潜力且被当前市场低估的重点上市公司。在债券投资方面,主要基于长期利率趋势以及中短期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资管理。基金组合投资的基本范围:股票资产40%~95%;债券资产55%~0;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准=60%×[上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均]+40%×[上证国债指数]
风险收益特征	本基金属于中低风险的平衡型基金产品,基金的预期收益高于债券型基金,风险程度低于激进的股票型基金。
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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	92,200,970.63
2.本期利润	254,055,614.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0459
4.期末基金资产净值	3,959,321,013.56
5.期末基金份额净值	0.732

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

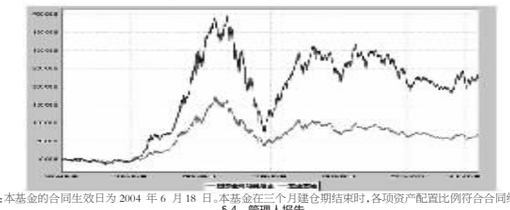
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.55%	1.17%	6.41%	0.68%	0.14%	0.49%

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

国泰金马稳健回报证券投资基金

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

(2004年6月18日至2013年9月30日)



注:本基金的合同生效日为2004年6月18日。本基金在三个月建仓期结束时,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		
程洲	本基金的基金经理、国泰金泰平衡混合(原国泰金泰封闭)的基金经理	2008-4-3	-	13	硕士研究生,CFA。曾任职于申银万国证券研究所,2004年4月加盟国泰基金管理有限公司,历任高级策略分析师、基金经理助理;2008年4月起任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理,2009年12月至2012年12月23日兼任金泰证券投资基金的基金经理,2010年2月至2011年12月兼任国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的基金经理,2012年12月24日起兼任国泰金泰平衡混合型证券投资基金的基金经理。

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》、《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,本基金未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

2013年三季度A股市场出现稳步回升的走势,上证综指在经历了六月下旬"钱荒"的冲击后逐步恢复,相比之下,创业板指数的回升则非常强劲,三季度单季度涨幅高达35%。分行业看,信息服务、商业零售、信息设备等行业涨幅靠前,而金融、地产、有色、煤炭等所谓代表旧经济的行业继续被市场抛弃。

本基金在三季度初就提升了股票资产配置比例,但增持的方向依然是银行与地产,现在组合中继续超配房地产行业,但市场对调控的担心、对流动性收紧的担心、对房价泡沫的担心持续压制了房地产股的表现,而本基金认为这些都应该已充分反映在目前房地产股极差的股价表现和极低的估值水平之中,期待中的长效调控机制可能会是房地产估值修复的契机,因为一个长效机制不可能只有打压,肯定是有保有压地全方位地促进房地产市场健康发展,调控政策的明朗会有助于降低市场的扭曲。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2013年第三季度的净值增长率为6.55%,同期业绩比较基准收益率为6.41%。

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2013年四季度,本基金认为,自九月份以来的经济复苏可能并不强劲,但四季度很快又开始新一轮下滑的概率也很低,所以经济整体是平稳的。而十一届三中全会对改革的蓝图是值得期待的,经济转型不会仅仅是一些新兴产业,传统产业的升级换代也蕴含着量变的能活可能是改革和经济转型的重头戏。从投资方向看,继续看好业绩增长确定和估值较低的大盘蓝筹股在四季度价值回归的机会,银行、地产、电力和交通运输等行业会有相对较好的表现,与改革相关的一些主题应该也会有一定的表现机会。

§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	3,500,472,041.64	87.54
	其中:股票	3,500,472,041.64	87.54
2	固定收益投资	130,601,000.00	3.27
	其中:债券	130,601,000.00	3.27
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	57,000,148.50	1.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	305,627,994.92	7.64
6	其他各项资产	5,076,540.99	0.13
7	合计	3,998,777,726.05	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	1,562,135,875.80	39.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	100,790,038.24	2.55
E	建筑业	58,396,523.52	1.47
F	批发和零售业	35,656,552.40	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	49,017,862.48	1.24
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	436,921,405.94	11.04
K	房地产业	1,175,392,467.78	29.69
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	82,161,315.48	2.08
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,500,472,041.64	88.41

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	002250	联化科技	15,000,000	360,450,000.00	9.10
2	000895	双汇发展	5,750,000	267,087,500.00	6.75
3	600036	招商银行	20,215,553	220,753,838.76	5.58
4	000024	招商地产	8,807,607	211,382,568.00	5.34
5	000002	万科A	21,726,496	198,362,908.48	5.01
6	000656	金科股份	16,296,623	182,196,245.14	4.60
7	601877	正泰电器	7,937,011	177,550,936.07	4.48
8	002152	广电运通	10,649,930	170,398,880.00	4.30
9	002004	华邦颐桂	9,394,970	166,290,969.00	4.20
10	600048	保利地产	16,812,143	166,103,972.84	4.20

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,644,000.00	0.50
	其中:政策性金融债	19,644,000.00	0.50
4	企业债券	110,957,000.00	2.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	130,601,000.00	3.30

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	122186	12力帆02	500,000	50,690,000.00	1.28
2	1280211	12内江投资债	500,000	50,085,000.00	1.26
3	1080082	10杨浦投债02	100,000	10,182,000.00	0.26
4	110240	11国开40	100,000	9,896,000.00	0.25
5	110225	11国开25	100,000	9,748,000.00	0.25

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名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

5.8.1 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。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	871,993.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,016,064.18
4	应收利息	1,107,357.37
5	应收申购款	81,125.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,076,540.99

5.10.4 报告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。

5.10.5 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	002004	华邦颐桂	166,290,969.00	4.20	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	5,614,880,066.16
本报告期基金总申购份额	11,859,704.38
减:本报告期基金总赎回份额	217,846,773.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,408,892,996.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、关于同意设立国泰金马权健回报证券投资基金的批复

2、国泰金马稳健回报证券投资基金合同

3、国泰金马稳健回报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

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§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。

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7月1日起至9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	3,766,009,480.63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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	137,489,976.57
2.本期利润	433,218,897.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.1119
4.期末基金资产净值	2,832,806,348.91
5.期末基金份额净值	0.752

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

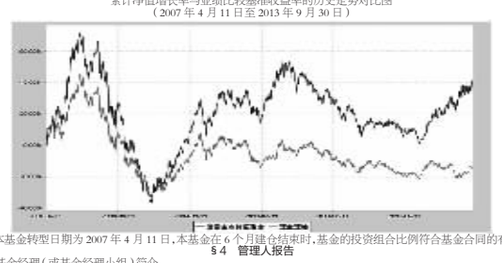
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.32%	1.34%	6.56%	0.74%	10.76%	0.60%

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9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、国泰估值优势股票(LOF)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精选证券投资基金的基金经理,2009年5月起兼任国泰区位优势股票型证券投资基金的基金经理,2013年9月起兼任国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)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,本基金未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

进入三季度后,我国的宏观调控政策在稳增长方面较上半年有所增强,在棚户区改造、促进信息消费、铁路和城市基础设施投资以及政府向社会购买公共服务等综合措施的拉动下,三季度我国宏观经济初步显现出温和复苏的迹象,从工业增加值的同比增速来看,在六月份下探到8.9%触底后,七月份和八月份持续反弹,分别达到9.7%和10.4%。从PMI指标来看,也呈现出温和复苏的态势,三季度的三个月分别为50.3%、51.0%和51.1%,未来复苏的持续性还需要观察。三季度A股市场呈现出触底回升的走势,市场两极分化进一步加剧,上证综指上涨9.88%,其中信息服务、商业贸易、信息设备和交通运输等行业涨幅较大,而食品饮料、建筑建材、金融服务和采掘等行业涨幅落后。

本基金在三季度增加了组合的股票仓位,同时对组合的结构进行了较大幅度的调整和优化,减持了房地产和电子等行业,增持了食品饮料等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2013年第三季度的净值增长率为17.32%,同期业绩比较基准收益率为6.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然目前我国宏观经济呈现出温和复苏的迹象,但是复苏的基础并不稳固,未来依然存在较大的不确定性,而经济结构的转型将是大势所趋,因此四季度我们将重点关注国内外宏观经济的走势,房地产调控措施的变化,以及十八届三中全会对我国未来改革和经济发展方向的规划等等。我们对于四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,估值低的优质蓝筹股;(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恪守基金契约,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	2,515,015,657.49	88.52
	其中:股票	2,515,015,657.49	88.52
2	固定收益投资	136,629,558.13	4.81
	其中:债券	136,629,558.13	4.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	186,246,572.53	6.56
6	其他各项资产	3,317,737.15	0.12
7	合计	2,841,209,525.30	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	37,079,582.85	1.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,747,583,366.83	61.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	50,912,669.08	1.80
F	批发和零售业	209,395,904.14	7.39
G	交通运输、仓储和邮政业	15,130,000.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	337,208,106.41	11.90
J	金融业	87,977,986.18	3.11
K	房地产业	1,125,000.00	0.04
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	28,603,042.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,515,015,657.49	88.78

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	13,707,440	256,740,351.20	9.06
2	600887	伊利股份	4,742,622	211,900,350.96	7.48
3	600276	恒瑞医药	5,633,615	204,894,577.55	7.23
4	000538	云南白药	1,500,000	175,590,000.00	6.20
5	600597	光明乳业	6,619,991	156,165,587.69	5.51
6	600872	中炬高新	14,671,740	147,010,834.80	5.19
7	600511	国药股份	7,500,000	140,550,000.00	4.96
8	300168	万达信息	2,800,000	98,476,000.00	3.48
9	300188	美亚柏科	5,386,652	89,418,423.20	3.16
10	300182	捷成股份	2,215,501	82,261,552.13	2.90

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	103,016,500.00	3.64
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	33,613,058.13	1.19
8	其他	-	-
9	合计	136,629,558.13	4.82

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	59,970,000.00	2.12
2	110015	石化转债	343,160	33,591,932.40	1.19
3	019307	13国债07	300,000	30,027,000.00	1.06
4	019302	13国债02	130,000	13,019,500.00	0.46
5	128002	东华转债	170	21,125.73	0.00

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名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

5.8.1 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。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	712,303.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,517,689.49
5	应收申购款	87,744.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,317,737.15

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5 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	3,942,030,270.46
本报告期基金总申购份额	8,943,239.10
减:本报告期基金总赎回份额	184,964,028.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,766,009,480.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

序号	交易方式	交易日期	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2013-08-27	12,832,272.35	0.00
合计			12,832,272.35	

注:交易份额为17,699,686.00份。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、关于核准全期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

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

国泰金鹰增长证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§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。

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7月1日起至9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	1,798,688,212.26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实出的产品或服务