

2013年4月22日 星期一

## 国泰金牛创新成长股票型证券投资基金

## [2013] 第一季度报告

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:二〇一三年四月二十二日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月21日核对了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2013年1月1日至2013年3月31日止。

## §2 基金产品概况

基金名称:国泰金牛创新成长股票型证券投资基金

基金代码:020010

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2007年5月6日

报告期末基金份额总额:4,055,208,879.90份

投资目标:本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，在有效的风险控制前提下，追求基金资产的长期增值。

投资策略:①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、行业政策、资金面以及市场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

②股票投资策略

本基金在股票投资上将长期坚持趋势投资的基本理念，结合中期的经济周期、宏观环境以及行业景气度，通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

③债券投资策略

本基金在债券投资上将通过分析利率走势、收益率曲线变化和信用利差变化等对债券品种进行综合评估，选择到期收益率较高且流动性较好的债券品种进行投资。

④现金管理策略

本基金在现金管理上将充分考虑短期利率变化的基本规律，适时调整货币市场基金的资产配置比例。

⑤定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

⑥风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑦现金持有策略

本基金在现金持有上将通过分析利率走势、收益率曲线变化和信用利差变化等对债券品种进行综合评估，选择到期收益率较高且流动性较好的债券品种进行投资。

⑧其他投资策略

本基金在其他投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑨杠杆投资策略

本基金在杠杆投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑩定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

⑪风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑫现金持有策略

本基金在现金持有上将通过分析利率走势、收益率曲线变化和信用利差变化等对债券品种进行综合评估，选择到期收益率较高且流动性较好的债券品种进行投资。

⑬其他投资策略

本基金在其他投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑭定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

⑮风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑯定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

⑰风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑱定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

⑲风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

⑳定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉑风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉒定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉓风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉔定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉕风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉖定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉗风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉘定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉙风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉚定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉛风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉜定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉝风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉞定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉟风险资产投资策略

本基金在风险资产投资上将通过分析宏观经济、行业政策、资金面以及市

场资金量的变化、证券市场的估值水平的分析，择机调整股票、债券及现金资产的配置比例。

㉟定期开放机制

本基金在定期开放机制下，将通过资产配置选择具有高性价比的投资品种。

㉟风险资产投资策略

本基金在风险