

## 国泰成长优选股票型证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

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

基金管理人的董事会及董事声明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。

基金托管人国泰基金管理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,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。

基金过往业绩并不代表基金未来表现,基金管理人管理的其他基金的过往业绩并不构成基金业绩表现的保证。

本基金报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

## \$ 2 基金产品概况

基金简称:国泰成长优选股票

基金代码:602026

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年5月31日

报告期末基金份额总额:52,037,550.20份

投资目标:本基金通过精选具有较高成长性和良好基本面的优质企业,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,力争使基金资产的长期稳定增值。

1. 大类资产配置策略:本基金运用基金管理人的资产配置模型(Melva),通过宏观经济、企业盈利、波动性、估值和行业景气等相关因素的分析判断,采用评分法确定大类资产配置比例。

2. 行业配置策略:本基金采取积极主动的投资管理策略,通过以下几个方面优化选股长期投资。

(1) 行业经久耐用、成长性和利润的快速增长:(2)通过调用分析了解财务数据背后成因的逻辑,并探寻长期的持续性,选择有竞争力的龙头企业;(3)着重判断企业的成长性,选择具有持续增长的行业;(4)在综合考虑估值的风格和风险的前提下,完成本基金的投资组合构建。

3. 个股投资策略:本基金的股票投资主要以价值为导向,结合中短期的经济周期、行业周期及个股成长性分析,通过宏观分析为基础,结合行业配置方法,精选个股。

4. 权证投资策略:本基金将根据风险管理的原则,在有效控制风险的前提下,主动进行权证投资。本基金将根据权证定价模型,结合估值分析,选择具有较好投资价值的权证进行投资。

5. 债券投资策略:本基金将根据风险管理的原则,在有效控制风险的前提下,主动进行债券投资。本基金将根据宏观经济、企业盈利、估值和行业景气等相关因素的分析判断,采用评分法确定大类资产配置比例。

6. 银行存款和结算准备金投资:本基金将根据风险管理的原则,在有效控制风险的前提下,主动进行银行存款和结算准备金投资。

7. 其他各项资产:本基金将根据风险管理的原则,在有效控制风险的前提下,主动进行其他各项资产投资。

8. 合计:本基金将根据风险管理的原则,在有效控制风险的前提下,主动进行其他各项资产投资。

## \$ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产构成情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 52,104,618.60 87.82

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

4 资产支持证券 - -

5 金融衍生品投资 - -

其中:买入返售金融资产 - -

6 银行存款和结算准备金合计 6,748,998.47 11.38

7 其他各项资产 477,742.91 0.81

8 合计 59,331,359.98 100.00

5.2 报告期末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 制造业 1,210,300.00 2.10

C 制造业 26,069,006.35 45.29

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 8,470,600.00 14.72

F 批发和零售业 6,357,062.25 11.04

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 - -

J 金融业 - -

K 房地产业 1,224,400.00 2.13

L 租赁和商务服务业 6,881,000.00 11.95

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 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 52,104,618.60 90.52

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 600335 国机汽车 550,395 6,357,062.25 11.04

2 300058 蓝色光标 130,000 5,421,000.00 9.42

3 300147 香雪制药 234,000 3,926,520.00 6.82

4 601117 中国国化 300,000 2,856,000.00 4.96

5 300043 星光农机 260,000 2,766,400.00 4.81

6 300055 万邦达 70,000 2,737,000.00 4.75

7 600572 康恩贝 238,500 2,644,965.00 4.59

8 002140 东华科技 100,000 2,481,000.00 4.31

9 000731 四川美丰 280,000 2,326,800.00 4.04

10 000049 德赛电池 33,040 1,982,400.00 3.44

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

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(手) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100001 国债 6,357,062.25 11.04

2 100002 国债 6,357,062.25 11.04

3 100003 国债 6,357,062.25 11.04

4 100004 国债 6,357,062.25 11.04

5 100005 国债 6,357,062.25 11.04

5.6 报告期末按品种分类的贵金属投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.7 报告期末按品种分类的权证及金融衍生品投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.8 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.9 报告期末按品种分类的股票投资组合

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.10 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.11 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.12 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.13 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.14 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.15 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.16 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.17 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.18 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.19 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.20 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.21 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.22 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.23 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.24 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.25 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.26 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.27 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.28 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.29 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.30 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.31 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.32 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的股票投资指定期货,并通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,以降低投资组合的系统性风险。

5.33 报告期末按品种分类的其他投资

本基金将根据基金管理人的投资决策,将本基金的