

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：二〇一三年八月二十四日

## 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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的法律责任。本基金半年度报告已经三分之二以上独立董事通过。

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8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置等内容，对本基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金投资人的风险承受能力以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本报告期内基金财务报告摘要自平年度报告正文，投资者欲了解详细内容，阅读年度报告正文。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

## 2 基金简介

## 基金基本情况

基金简称 国泰金鹏蓝筹混合

基金主代码 020000

交易代码 020000

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2006年9月29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

报告期末基金份额总额 1,481,088,449.95份

基金合同存续期 不定期

## 基金产品说明

本基金将坚持其深化价值投资理念，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增值，力争获取更高的超越市场收益。

## 投资目标

本基金的主要资产配置主要通过对宏观经济环境、证券市场的走势的分析，预测未来一段时期的固定收益收益率、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围综合投资于货币市场、债券、股票、债券和现金资产的配置比例。

## (1) 大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对中国宏观经济、证券市场的走势的分析，预测未来一段时期的固定收益收益率、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围综合投资于货币市

场、债券、股票、债券和现金资产的配置比例。

## (2) 债券投资策略

本基金的债券投资采取核心-卫星投资策略 (Core-Satellite strategy)，核心投资主要集中在对宏观经济、证券市场的走势的分析，预测未来一段时期的固定收益收益率、股票市场的风

险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围综合投资于货币市

场、债券、股票、债券和现金资产的配置比例。

## (3) 股票投资策略

本基金的股票投资将主要以长期利率趋势为基础，结合中期的经济周期、宏观政策方向以及收益曲线分析，通过债券配置和收益曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

## (4) 衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将主要以长期利率趋势为基础，结合中期的经济周期、宏观政策方向以及收益曲线分析，通过债券配置和收益曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

## 投资策略

## 大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对中国宏观经济、证券市场的走

势的分析，预测未来一段时期的固定收益收益率、股票市场的风

险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围综合投资于货币市

场、债券、股票、债券和现金资产的配置比例。

## 大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对中国宏观经济、证券市场的走

势的分析，预测未来一段时期的固定收益收益率、股票市场的风

险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围综合投资于货币市