国泰金马稳健回报证券投资基金

【2013】第三季度报告

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

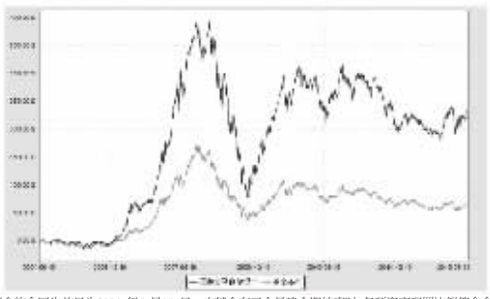
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.55%	1.17%	6.41%	0.68%	0.14%	0.49%

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》、《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的规定，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异常交易。

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担忧。

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，所以经济整体基调平稳的。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就是存量资产的盘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的值回账的机会，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	华邦颖泰	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，以降低股资组合的整体风险。

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	华邦颖泰	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稳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

金鑫证券投资基金

【2013】第三季度报告

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	国泰金鑫封闭
基金主代码	500011
交易代码	500011
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年10月21日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
投资目标	本基金是以具有良好成长性的国企股为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资组合由股票投资和债券投资两部分组成，其中股票投资部分主要包括稳定成长型国企股和快速成长型国企股。 稳定成长型股票的判断标准为：成长性来自于企业自身主营业务的增长潜力，具体表现为企业主营业务的行业地位和市场地位突出，主营业务的增长是公司利润长期持续增长的主要源泉，有产品、技术、销售渠道、特许权等方面的竞争优势等特点。 快速成长型股票的判断标准为：成长性来自于因企业的重大实质性变化而带来的公司业绩的高速增长潜力。本基金的快速成长国企股部分将侧重于具有资产重组题材股票的投资。 在遵循以上投资组合目标和范围的基础上，基金管理人将根据具体情况变化，适时调整投资组合。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	承担中等风险，获取中等的超额收益。
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	148,014,147.46
2.本期利润	800,580,450.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.2669
4.期末基金资产净值	4,385,766,048.56
5.期末基金份额净值	1.4619

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	22.32%	2.20%	-	-	-	-

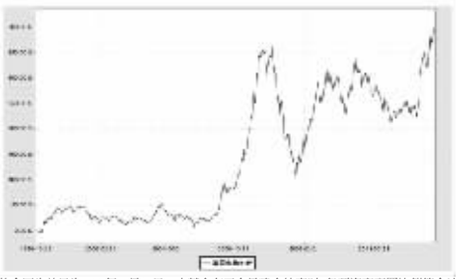
注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

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

金鑫证券投资基金

累计份额净值增长率历史走势图

（1999年10月21日至2013年9月30日）



注：本基金的合同生效日为1999年10月21日。本基金在三个月建仓结束时，各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的规定。

§ 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		
王航	本基金的基金经理、国泰事件驱动策略的基金经理、国泰金龙行业混合的基金经理，投资副总监	2010-4-7	-	12	王航，男，硕士研究生，CFA，12年证券从业经历。曾任职于南方证券有限公司，2003年12月加盟国泰基金管理有限公司，历任投资经理助理、基金经理助理；2008年5月至2012年1月任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理；2010年4月起兼任金鑫证券投资基金的基金经理；2011年8月起兼任国泰事件驱动策略股票型证券投资基金的基金经理，2013年9月起兼任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2013年9月起任投资副总监。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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异常交易。

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

三季度随着经济数据向好，过度悲观的市场信心有所恢复，在以文化传媒为代表的新兴产业通过一个又一个的收购事件，不断刺激市场的神经。与此同时，围绕改革预期展开的土地流转、二胎政策以及各省、各种版本的自贸区的主题此起彼伏。

在三季度的热闹喧嚣中，隐忧犹存。首先，对市场整体而言，虽然已经不再担心经济硬着陆，但相对三季度的7.8%，四季度GDP增速会有所放缓，市场更普遍预期明年的GDP目标会下调到底线值7%，经济数据在未来一到两个季度对市场无法再形成强有力的拉动，企业盈利增速的高点也出现在三季度，在这样的背景下大权重板块仍然难有趋势性的机会。其次，部分年初至今涨幅较好的行业和个股，经过中报和三季报的业绩印证，难以消化目前的高估值，靠外延式扩张提升估值也渐渐导致市场审美疲劳；同时，好收购标的越来越少，价格越抬越高的现象开始显现，IPO重启很可能就是扭转这种正反馈的强大外力之一。虽然我们不能准确预测均值回归这一资本市场的万有引力何时发挥作用，可以预见的是高成长、高估值、高涨幅行业或个股在业绩印证下会出现分化。

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22.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，我们仍然坚持认为改革红利的释放是A股市场未来结构性行情能够持续的重要支撑，转型、结构调整过程中的广义消费品行业以及改革受益相关行业依然是组合配置重点。结合公司成长性和目前的估值水平，我们要努力发掘新价值和新成长。新价值，更为注重并购价值、重估价值和隐蔽资产价值；新成长，也不局限在业绩增长得益于行业的高景气度或是依靠政策的支持，而是更为看重那些相对低估值的传统行业中，真正具有优秀管理能力的公司；在整体行业不景气的背景下，依靠新产品和良好的成本控制，强化竞争优势，提升市场份额从而改善利润率的公司；传统行业中通过寻求新的商业模式或是进入有更广阔市场需求的新领域的公司将是我们关注的重点。此外，改革的进一步深化依然是重要的投资线索，在行业层面，部分垄断行业的放开势必带来巨大的投资机会，例如教育和医疗的产业化；在企业层面，国企改革仍可能以抓大放小的形式出现，不关系到国计民生领域的市场化改革会明显提升企业的经营效率和盈利能力，也为市场提供更多的投资机会。

§ 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	3,451,228,658.09	77.44
	其中：股票	3,451,228,658.09	77.44
2	固定收益投资	945,052,500.00	21.21
	其中：债券	945,052,500.00	21.21
	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	5,374,340.26	0.12
6	其他各项资产	54,795,809.83	1.23
7	合计	4,456,451,308.18	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	76,690,980.40	1.75
C	制造业	1,730,647,092.48	39.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	86,668,023.65	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	393,397,517.63	8.97
J	金融业	400,315,609.97	9.13
K	房地产业	181,524,704.23	4.14
L	租赁和商务服务业	338,888,729.73	7.73
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	81,825,000.00	1.87
R	文化、体育和娱乐业	161,271,000.00	3.68
S	综合	-	-
	合计	3,451,228,658.09	78.69

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	600587	新华医疗	5,900,000	357,422,000.00	8.15
2	002400	省广股份	7,717,803	338,888,729.73	7.73
3	600637	百视通	5,500,000	287,925,000.00	6.56
4	600597	光明乳业	11,900,000	280,721,000.00	6.40
5	600837	海通证券	19,500,000	243,945,000.00	5.56
6	002353	杰瑞股份	2,459,267	172,345,431.36	3.93
7	600315	上海家化	3,914,761	169,939,775.01	3.87
8	000625	长安汽车	14,283,595	147,121,028.50	3.35
9	600887	伊利股份	3,127,592	139,740,810.56	3.19
10	601633	长城汽车	2,600,000	132,808,000.00	3.03

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	815,965,500.00	18.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,700,000.00	1.82
	其中：政策性金融债	79,700,000.00	1.82
4	企业债券	19,568,000.00	0.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	29,819,000.00	0.68
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	945,052,500.00	21.55

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	010701	07国债01	1,600,000	160,016,000.00	3.65
2	019307	13国债07	1,400,000	140,126,000.00	3.20
3	019302	13国债02	1,100,000	110,165,000.00	2.51
4	019219	12国债19	970,000	96,951,500.00	2.21
5	130007	13付息国债07	900,000	89,631,000.00	2.04

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，以降低股资组合的整体风险。

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	558,839.00
2	应收证券清算款	38,005,645.37
3	应收股利	-
4	应收利息	16,231,325.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,795,809.83

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处于转股期的可转换债券。

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	002400	省广股份	338,888,729.73	7.73	公告重大事项

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	7,500,000
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	7,500,000
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	0.25

§ 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、关于同意设立金鑫证券投资基金的批复

2、金鑫证券投资基金合同

3、金鑫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

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