

2013年10月23日 星期三

## 国泰金泰平衡混合型证券投资基金

[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：中国光大银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一三年十月二十三日

**重要提示**  
基金管理人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。  
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，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。  
本报告期由2013年7月1日至9月30日止。

**§ 2 基金产品概况**

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 210,678,241.93 39.71

其中：股票 210,678,241.93 39.71

2 固定收益投资 190,020,362.20 35.81

其中：债券 190,020,362.20 35.81

货币支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 38,800,178.20 7.31

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 86,138,506.29 16.24

6 其他各项资产 4,927,635.64 0.93

7 合计 530,564,924.26 100.00

**§ 3 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 82,151,854.85 15.96

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 非金属矿物制品业 3,359,388.48 0.65

F 批发和零售业 382,543.00 0.07

G 交通运输、仓储和邮政业 9,661,444.21 1.88

H 食品、饮料和烟草制造业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 36,586,122.61 7.11

K 房地产业 71,518,768.08 13.89

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 1,909,312.50 0.37

N 水利、环境和公共设施管理业 5,108,808.20 0.99

O 国际服务、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 210,678,241.93 40.92

**§ 4.3 本报告期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 002152 广电运通 1,699,960 27,199,360.00 5.28

2 002250 联创科技 915,797 22,487,201.91 4.37

3 000095 万向钱潮 17,184,070 17,184,070.00 3.40

4 002604 金利华电气 3,535 15,985,890.60 3.40

5 000656 金科股份 1,325,191 14,815,635.38 2.88

6 000837 海航控股 1,064,483 13,316,682.33 2.59

7 000000 浦发银行 1,295,353 13,070,111.77 2.54

8 000667 万科A 2,000,000 12,840,000.00 2.45

9 600067 中国人寿 1,639,631 12,231,647.26 2.38

10 600009 上海机场 600,067 9,079,013.71 1.76

**§ 5.4 本报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细**

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 国家债券 - -

2 央行票据 - -

3 金融债券 9,969,000.00 1.94

4 企业债券 140,046,362.20 27.20

5 企业短期融资券 40,005,000.00 7.77

6 中期票据 - -

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 190,020,362.20 36.91

**§ 5.5 本报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细**

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 1380119 13平潭国投债 500,000 49,780,000.00 9.67

2 1208342 12兴安企业债 300,000 30,591,000.00 5.94

3 07132001 13渤海证券CP001 300,000 30,000,000.00 5.83

4 122232 12招商01 299,990 29,999,000.00 5.83

5 1380198 13朗湖创投债 200,000 19,612,000.00 3.81

6 1380199 13平潭国投债 - -

7 1380197 13渤海企业债 - -

8 其他 - -

9 合计 - -

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位:份

本报告期内基金期初基金份额总额 841,801,136.86

本报告期内基金总申购份额 20,273,736.07

本报告期内基金总赎回份额 354,043,559.70

本报告期内基金拆分变动份额 -

本报告期内期末基金份额总额 508,031,313.23

**§ 7 主要财务指标和基金净值表现**

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 8,919,226.67

2.本期利润 23,698,996.94

3.加权平均基金份额本期利润 0.0400

4.期末基金资产净值 514,884,406.63

5.期末基金份额净值 1.013

注:本基金的合同生效日为2013年12月24日,至2013年9月30日,本基金运作时间不满一年。

2.本基金在每个开放日的资产净值,在估值日后第2个工作日起可查询。

§ 8 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

程洲 基金经理 2012-12-24 -

说明:硕士研究生,CFA,曾就职于美国摩根士丹利公司,历任高级策略分析师、基金经理助理,2004年加入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1月至2010年1月任公司固定收益部基金经理,2010年1月至2012年11月任公司固定收益部基金经理,2012年12月24日兼任金泰平衡混合型基金经理,2013年9月28日兼任金泰平衡混合型基金经理。

注:1.本基金的合同生效日为2013年12月24日,至2013年9月30日,本基金运作时间不满一年。

2.本基金在每个开放日的资产净值,在估值日后第2个工作日起可查询。

3.2.1 本报告期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组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.95% 0.52% 1.58% 0.02% 1.37% 0.50%

3.2.2 本报告期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组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.95% 0.52% 1.58% 0.02% 1.37% 0.50%

3.2.3 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.56% 1.19%

3.2.4 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.44% 1.19%

3.2.5 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.44% 1.19%

3.2.6 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.44% 1.19%

3.2.7 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.44% 1.19%

3.2.8 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.44% 1.19%

3.2.9 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 准收益率③ 标准差系数④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.35% 1.05% 5.91% 0.86% 5.44% 1.19%

3.2.10 本报告期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

阶段 净值增长率① 净值增长率