

国泰金马稳健回报证券投资基金

[2013]第四季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

§ 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、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，复核结果是完全正确的。

基金财产净值以人民币计价，净值表现的计算方法遵循基金合同的规定，任何单位和个人不得非法干预。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31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

报告期末基金份额总额:5,201,402,422.62份

投资目标:通过股票、债券及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。紧密跟踪中国经济GDP增长趋势与货币供应量，获取企业营业收入增长和上市公司业绩增长的长期回报，为基金经理人寻求稳健增长的长期回报。

本基金采取定性与定量分析相结合的方式，通过资产配置有效把握本市场的系统性风险，通过对不同时期的GDP增长密切相关的投资、消费、进出口等因素的深入研究，准确预期并把握对GDP增长幅度及对GDP增长拉动受益最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，宏观政策方向以及收益率曲线分析，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5%~0；现金或到期日在一年以内的政府债券不高于5%。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准=沪深300上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均×140%+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货币基金，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:中国农业银行股份有限公司

§ 3 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10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -193,481,025.53

2.本期利润 -194,156,842.77

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0367

4.期末基金份额净值 3,616,805,228.00

5.期末基金份额净值 0.6959

注:1.本期利润为本期利息收入、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，本期利润不包含持有人认购或申购交易产生的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)报告期基金份额持有人认购或申购交易产生的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§ 2.2 基金净值表现

3.21 本报告期基金份额净值增长率及其相对应的基本收益的比较

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历史走势对比图

(2004年6月16日至2013年12月31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助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

本基金的基金经理

国泰基金管理有限公司

平衡型基金

基金经理助理

基金管理部

基金经理助理

基金经理助理