

## 2013 第四季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,253,982,792.80	89.14
	其中:股票	6,253,982,792.80	89.14
2	固定收益投资	109,689,000.00	1.56
	其中:债券	109,689,000.00	1.56
	资产支持证券	--	--
3	金融衍生品投资	--	--
4	买入返售金融资产	49,500,144.75	0.71
	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	506,148,606.85	7.21
6	其他各项资产	96,906,149.02	1.38
7	合计	7,016,226,693.42	100.00
6.2 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	212,466,970.72	3.05
C	制造业	3,779,637,908.61	54.29
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	268,639,328.25	3.86
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	520,716,335.76	7.48
J	金融业	902,412,059.54	12.96
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	350,152,090.00	5.03
M	科学研究和技术服务业	203,560,657.92	2.92
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	16,397,442.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	6,253,982,792.80	89.82

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	6,426.40	449,274,517.70	6.45
2	600400	红豆股份	9,660.368	366,000.00	5.03
3	601318	中国平安	6,006.436	250,648,574.28	3.60
4	300228	富临特装	2,866.769	226,474,751.10	3.25
5	300182	捷成股份	5,579.177	221,939,661.06	3.19
6	600089	特变电工	20,321.289	217,844,218.08	3.13
7	600835	上海机电	12,000.000	211,800,000.00	3.04
8	002065	东方软件	6,000.000	202,800,000.00	2.91
9	600600	青岛啤酒	4,000.000	195,800,000.00	2.81

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	49,755,000.00	0.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,034,000.00	0.86

	其中:政策性金融债	59,934,000.00	0.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-

9	合计			109,689,000.00	1.58
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	130201	13国开01	500,000	49,995,000.00	0.72

2	019307	15国债07	300,000	49,733,000.00	0.71
3	110234	11国开34	100,000	9,939,000.00	0.14

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 本基金股指期货投资期指的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货期货, 本基金将根据风险管理的原则, 以套期保值为主要的目的, 有选择地投资于股指期货期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

本基金在进行股指期货期货投资时, 将通过对证券市场和相关期货市场运行趋势的研究, 并结合股指期货期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金组合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, 以降低投资组合整体的整体风险。

5.9 报告期末本基金投资国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

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 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体(除“中国平安”公告其子公司情况外)没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

根据2013年5月21日中国平安发布的相关公告, 该公司控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称“平安证券”)因违反证券监管规定, 被中国证监会处以警告, 并处以罚款。平安证券已就此作出深刻反省, 并已采取整改措施, 以切实落实监管要求, 杜绝此类事件再次发生。

5.10.2 基金投资于前十名股票中,没有投资金额超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,852,040.88
2	应收证券清算款	68,840,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	2,913,322.05

5	应收申购款	23,300,786.09
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	96,906,149.02

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§ 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	3,985,355,621.51
本报告期基金总申购份额	1,820,308,591.43

减:本报告期基金总赎回份额	447,676,047.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,357,988,165.82

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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. 关于同意国泰金牛创新成长股票型证券投资基金基金募集的批复
2. 国泰金牛创新成长股票型证券投资基金合同
3. 国泰金牛创新成长股票型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

8.3 查阅方式

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  
二〇一四年一月二十二日

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	019307	13国债07	350,000	34,828,500.00	2.79
2	019302	13国债02	150,000	15,004,500.00	1.20

3	130002	13年国债02	100,000	9,995,000.00	0.80
4	113005	平安转债	83,430	8,947,867.50	0.72

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组合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  
本基金本报告期末未投资股指期货。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,有选择性地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。  
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。  
本基金管理人将在充分理解股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低和

投资组合的整体风险。

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 本期国债期货投资政策

根据本基金合同,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中的发行主体(除“中国平安”公告其子公司情况外)没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

根据2013年5月21日中国证监会上发布的相关公告,该公司控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称“平安证券”)收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《行政处理决定书》(市场禁入决定书),中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,556万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

本基金管理人此前对湖南平安证券进行了严格履行了公司的投资决策流程,在充分调研的基础上,按规定将该股票纳入本基金股票池,而后进行了投资,并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后,本基金管理人立即会同平安证券对外处处理事宜进行了及时分析和研究,认为平安证券存在上述违规行为对公司资产没有造成实质性损害,且平安证券的处罚行为符合交易所的相关规定,因此公司评估认为该处罚行为不构成重大事件,本基金管理人将按照交易所有关规定履行信息披露义务。

跟踪研究。

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	74,973.50
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,355,534.00
5	应收申购款	15,776.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

9	合计	1,446,283.68
---	----	--------------

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  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**§6 开放式基金份额变动**

本报告期初基金份额总额	1,421,302,586.29
本报告期基金总申购份额	12,722,003.77
减:本报告期基金总赎回份额	69,701,207.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,364,323,382.60

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 关于同意国泰基金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金募集的批复
2. 国泰基金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金合同
3. 国泰基金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管协议
4. 报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求审查的其他文件  
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  
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  
二〇一四年一月二十二日