

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:二〇一四年十一月二十七日

**5.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及监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法律责任。本基金于2014年10月23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。

本基金自2014年7月1日起至9月30日止。

**5.2 基金产品概况**

|            |   |
|------------|---|
| 基金名称       | 国泰目标收益保本混合型证券投资基金   |
| 基金代码       | 000099  |
| 交易代码       | 000099  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2013年8月6日   |
| 报告期末基金份额总额 | 111,447,568.40份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资资金安全的保证，并在此基础上力争实现基金资产的增值。   |
| 投资策略       | 本基金采用比例保险策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)策略，控制股票市场的系统性风险，分享股票市场的成长收益。<br>1. 采用CPPI策略进行资产配置<br>本基金主要对股市趋势的研究，根据CPPI策略，控制股市风险，分享股票市场的成长收益。<br>2. 投资策略<br>本基金将长期保持本周期配的债券，主要锁定并持有长期国债、企业债、金融债等品种，以获取稳定的利息收入；同时通过定期调整资产的配置比例，以达到降低风险、提高收益的目的。<br>3. 风险控制<br>本基金将长期保持本周期配的债券，主要锁定并持有长期国债、企业债、金融债等品种，以获取稳定的利息收入；同时通过定期调整资产的配置比例，以达到降低风险、提高收益的目的。<br>4. 其他投资策略<br>本基金将在投资运作时，将通过分析公司基本面状况，结合证交会定期报告，将持有的股票按其行业属性归类，从而选择不同行业的股票进行配置，以达到降低风险、提高收益的目的。<br>5. 估值方法<br>本基金在投资运作时，将通过分析公司基本面状况，结合证交会定期报告，将持有的股票按其行业属性归类，从而选择不同行业的股票进行配置，以达到降低风险、提高收益的目的。<br>6. 风险收益特征<br>本基金为保本基金，属于投资资金中的低风险品种。<br>基金管理人 国泰基金管理有限公司<br>基金托管人 中国建设银行股份有限公司<br>基金销售人 重庆市三峡集团集利公司 |

**5.3 主要财务指标和基金净值表现**

| 主要财务指标         | (2014年7月1日-2014年9月30日) |
|----------------|------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 4,631,141.68           |
| 2.本期利润         | 6,311,589.92           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0450                 |
| 4.期末基金资产净值     | 123,307,162.84         |
| 5.期末基金份额净值     | 1.106                  |

注:本基金的开放时间为2013年8月12日，本基金在6个月建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

5.4 管理人报告

5.5 基金管理人对报告期内基金运作的说明

5.6 报告期内基金的业绩表现

5.7 报告期末基金资产构成情况

5.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.9 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.10 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

5.11 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债券投资明细

5.12 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贵金属投资明细

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.15 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.16 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

5.17 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债券投资明细

5.18 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贵金属投资明细

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.21 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.22 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

5.23 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债券投资明细

5.24 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贵金属投资明细

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.27 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.28 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

5.29 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债券投资明细

5.30 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贵金属投资明细

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.33 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.34 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

5.35 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债券投资明细

5.36 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贵金属投资明细

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.39 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.40 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

5.41 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债券投资明细

5.42 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贵金属投资明细

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.45 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.46 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

5.47 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债券投资明细

5.48 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贵金属投资明细

5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.51 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.52 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

5.53 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债券投资明细

5.54 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贵金属投资明细

5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.57 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.58 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

5.59 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债券投资明细

5.60 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贵金属投资明细

5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.63 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.64 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

5.65 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债券投资明细

5.66 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贵金属投资明细

5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.69 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.70 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

5.71 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债券投资明细

5.72 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贵金属投资明细

5.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.75 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.76 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

5.77 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债券投资明细

5.78 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贵金属投资明细

5.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.81 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.82 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

5.83 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债券投资明细

5.84 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贵金属投资明细

5.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.86 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.87 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.88 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

5.89 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债券投资明细

5.90 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贵金属投资明细

5.91 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.92 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.93 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.94 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

5.95 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债券投资明细

5.96 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贵金属投资明细

5.97 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.98 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.99 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.10 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

5.11 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债券投资明细

5.12 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贵金属投资明细

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.15 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况

5.16 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

5.17 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债券投资明细

5.18 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贵金属投资明细

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

5.21 报告期末按资产类别分类的基金资产组合情况