

国泰金马稳健回报证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

基金托管人的董事会及监察促保部门对本基金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。

基金托管人对本基金报告的内容进行复核,并认为该报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人对本报告复核无误,但并不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来的表现,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。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		国泰金马稳健回报
基金代码		020090
交易代码		020090
基金运作方式		契约型开放式
基金合同生效日		2006年06月01日
报告期末基金份额总额		2,097,388,289.69

通过投资,本基金拟实现资产的合理配置,进而促进中国宏观经济的稳定发展。同时不同期限的国债、企业债、公司债、金融债、可转换债、股票等不同类型的证券品种,通过资产配置,在不同的经济周期内获取不同的收益。

本基金采取绝对收益策略,通过资产配置,在不同的经济周期内获取不同的收益。

本基金的过往业绩并不代表未来的表现,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。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 3 主要财务指标

主要财务指标		(单位:人民币元)
报告期	(2015年1月1日-2015年3月31日)	
1.本期已实现收益		190,224,028.31
2.期初利润		697,011,534.60
3.期初平均基金份额利润		0.1406
4.期末基金份额净值		3,428,090.0561
5.期末基金资产净值		0.927

注:1.本期利润为收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为人民币元,收入以人民币计价,单位为人民币元,收益以人民币元为单位。

2.所述本期利润不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,计入后实际收益水平将低于所列数字。

3.基金的基本情况

4.基金管理人:国泰基金管理有限公司

5.中国建设银行股份有限公司

注:本基金管理人收取基金管理费,不收取申购费、赎回费。

6.报告期未按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	000657	新华医疗	5,831,336	262,701,698.00	7.66
2	000625	长安汽车	10,483,501	242,064,038.00	7.06
3	001318	中国平安	3,095,023	241,372,191.02	7.04
4	601166	兴业银行	9,504,386	174,500,526.00	5.09
5	002415	康美药业	5,402,431	168,617,631.70	4.92
6	002470	金地大	4,202,042	164,155,146.60	4.51
7	300168	万达信息	1,607,918	131,720,642.66	3.84
8	600697	信达地产	12,666,100	119,939,349.30	3.50
9	002529	新都化工	4,264,462	113,168,689.20	3.30
10	000672	东江环保	2,238,542	112,500,120.02	3.28

7.报告期未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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,963,000.00	0.58
4	其他金融债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债券	16,563,350.68	0.48
8	其他	-	-
9	合计	36,506,350.68	1.06

8.报告期未按权证品种分类的权证及衍生品投资组合

序号	权证品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	净价回购	3,000,000.00	0.11%
2	认沽权证	1,000,000.00	0.03%
3	认沽权证	1,000,000.00	0.03%
4	权证组合	1,000,000.00	0.03%
5	权证组合	1,000,000.00	0.03%
6	权证组合	1,000,000.00	0.03%
7	权证组合	1,000,000.00	0.03%
8	权证组合	1,000,000.00	0.03%
9	权证组合	1,000,000.00	0.03%
10	权证组合	1,000,000.00	0.03%

9.报告期未按资产支持证券品种分类的资产支持证券投资组合

序号	资产支持证券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
2	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
3	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
4	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
5	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
6	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
7	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
8	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
9	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%
10	资产支持证券	1,000,000.00	0.03%

10.报告期未按股票期权品种分类的股票期权投资组合

序号	股票期权品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票期权	1,000,000.00	0.03%
2	股票期权	1,000,000.00	0.03%
3	股票期权	1,000,000.00	0.03%
4	股票期权	1,000,000.00	0.03%
5	股票期权	1,000,000.00	0.03%
6	股票期权	1,000,000.00	0.03%
7	股票期权	1,000,000.00	0.03%
8	股票期权	1,000,000.00	0.03%
9	股票期权	1,000,000.00	0.03%
10	股票期权	1,000,000.00	0.03%

11.报告期未按沪市深市交易型开放式指数基金品种分类的交易型开放式指数基金投资组合

序号	交易型开放式指数基金品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
2	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
3	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
4	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
5	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
6	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
7	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%
8	交易型开放式指数基金	1,000,000.00	0.03%

12.报告期未按沪市深市股票品种分类的股票投资组合

序号	股票品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票	1,000,000.00	0.03%
2	股票	1,000,000.00	0.03%
3	股票	1,000,000.00	0.03%
4	股票	1,000,000.00	0.03%
5	股票	1,000,000.00	0.03%
6	股票	1,000,000.00	0.03%
7	股票	1,000,000.00	0.03%
8	股票	1,000,000.00	0.03%