

## 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告日期:2015年7月21日  
重要提示:见第1页至第21页

基金管理人的董事会重申本基金所载资料存在虚假记载、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的法律责任。  
基金托管人中国银行股份有限公司根据《基金法》的规定，于2015年7月17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。  
基金过往业绩并不代表其未来表现。投资者有责任在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报吿书中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:国泰金鹏蓝筹混合  
基金代码:020099  
交易代码:020099  
基金运作方式:契约型开放式  
基金合同生效日:2006年5月12日  
报告期末基金份额总额:524,233,753.03份

本基金将坚持深化价值投资理念，在有效控制风险的前提下，谋求本基金资产的增值，力求获取超越市场的收益。

(1)类属资产配置策略  
本基金将主要通过股票资产配置来把握市场环境、证券市场走势的分析，进而判断股票市场的风格与收益水平，结合基金资产的配置比例，对股票资产进行配置。

(2)股票资产配置策略  
本基金主要采用“成本-收益”(Cost-Benefit)策略(Care-and-share strategy)，核心投资主要侧重于中国A股投资价值100指数所包含的所有成分股以及备选成分股的配置，同时兼顾行业轮动，通过行业轮动，择机调整行业的配置比例，力争获得超额收益。

(3)债券资产配置策略  
本基金将主要以长期持有为主，结合定期的经济周期变化以及资金的运用安排，通过价值投资，选择具有高性价比的债券品种，基金在获取市场平均收益的同时，力争获得更高的收益。

本基金是股票型基金，因此在投资中将充分考虑股票投资的风险。

基金管理人:国泰基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标  
单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 363,215,809.99

2.本期利润 184,633,138.98

3.加权平均基金份额本期利润 0.2729

4.期末基金资产净值 899,802,982.71

5.期末基金份额净值 1.715

注:1.本基金的合同生效日为2006年9月29日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。  
2.本基金自2013年1月1日起本基金业绩比较基准由“60%×富时中国A股股票指数+40%×新华巴克莱资本中国债券指数”，变更为“60%×富时中国A股股票指数+40%×中债企业债指数”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理及基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

黄森 2008-05-17 - 20年

本基金的基金经理黄森先生，曾任国泰基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理、基金经理，现任国泰基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理、基金经理。

黄森先生具有13年证券从业经验，其中10年基金管理经验，期间管理过国泰金鹏蓝筹、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金。

黄森先生具有良好的研究功底，善于从宏观经济、政策、行业等多角度出发，对宏观经济、政策、行业等有深入的研究。

黄森先生具有良好的研究功底，善于从宏观经济、政策、行业等多角度出发，对宏观经济、政策、行业等有深入的研究。