

信息披露 Disclosure

国泰金牛创新成长混合型证券投资基金

2017] 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§ 1 基本提示

基金管理人的董事会及基金经理保证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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2017年4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等內容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金销售机构在销售基金时，应向客户说明基金的销售适用性原则、风险评级及适当性匹配意见。购买基金，投资者应认真阅读本基金的招募说明书。

本报告期无内幕交易行为。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰金牛创新成长混合型证券投资基金
基金代码	020910
基金合同生效方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年5月18日
前一日基金份额总额	1,288,788,912.12份
投资目标	本基金为成长型基金，主要投资于由各类创新机制推动的公司股票，追求高速增长的回报。
投资策略	本基金的投资策略主要通过对于宏观经济运行、国民经济发展和货币供应、国民经济发展阶段、行业景气度、公司经营状况、公司治理结构、公司估值水平、公司盈利能力和公司成长性的综合分析，结合对不同行业未来发展趋势的判断运用资产配置方法，不断调整基金资产的配置比例。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，整体资产的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
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)	(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益		2,448,380.29
2.本期利润		5376,331.64
3.加权平均基金份额本期利润		0.0424
4.期末基金份额净值		1,706,361.8770
5.期末可供分配基金份额净值		1.356

注:1)本期已实现收益为本期利息收入、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3)基金可供分配收益=基金本期利润-基金本期已实现收益-本期利润中包含的本期利润部分。

4)期末可供分配基金份额净值=基金可供分配利润/期末基金份额总数。

§ 4 报告期按品种持有的各种类型的证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例%
1	000205	国债-贴现券	500,000	50,635,000.00	2.97
2	010919	16国债11	200,000	19,988,000.00	1.17
3	17农发行01	农发行金融债	200,000	19,940,000.00	1.17
4	100215	16国债15	100,000	10,020,000.00	0.59
5	120406	12农发行06	100,000	10,000,000.00	0.59
6	000000	000000	-	-	-
7	000000	000000	-	-	-
8	000000	000000	-	-	-
9	000000	000000	-	-	-
10	000000	000000	-	-	-
11	000000	000000	-	-	-
12	000000	000000	-	-	-
13	000000	000000	-	-	-
14	000000	000000	-	-	-
15	000000	000000	-	-	-
16	000000	000000	-	-	-
17	000000	000000	-	-	-
18	000000	000000	-	-	-
19	000000	000000	-	-	-
20	000000	000000	-	-	-
21	000000	000000	-	-	-
22	000000	000000	-	-	-
23	000000	000000	-	-	-
24	000000	000000	-	-	-
25	000000	000000	-	-	-
26	000000	000000	-	-	-
27	000000	000000	-	-	-
28	000000	000000	-	-	-
29	000000	000000	-	-	-
30	000000	000000	-	-	-
31	000000	000000	-	-	-
32	000000	000000	-	-	-
33	000000	000000	-	-	-
34	000000	000000	-	-	-
35	000000	000000	-	-	-
36	000000	000000	-	-	-
37	000000	000000	-	-	-
38	000000	000000	-	-	-
39	000000	000000	-	-	-
40	000000	000000	-	-	-
41	000000	000000	-	-	-
42	000000	000000	-	-	-
43	000000	000000	-	-	-
44	000000	000000	-	-	-
45	000000	000000	-	-	-
46	000000	000000	-	-	-
47	000000	000000	-	-	-
48	000000	000000	-	-	-
49	000000	000000	-	-	-
50	000000	000000	-	-	-
51	000000	000000	-	-	-
52	000000	000000	-	-	-
53	000000	000000	-	-	-
54	000000	000000	-	-	-
55	000000	000000	-	-	-
56	000000	000000	-	-	-
57	000000	000000	-	-	-
58	000000	000000	-	-	-
59	000000	000000	-	-	-
60	000000	000000	-	-	-
61	000000	000000	-	-	-
62	000000	000000	-	-	-
63	000000	000000	-	-	-
64	000000	000000	-	-	-
65	000000	000000	-	-	-
66	000000	000000	-	-	-
67	000000	000000	-	-	-
68	000000	000000	-	-	-
69	000000	000000	-	-	-
70	000000	000000	-	-	-
71	000000	000000	-	-	-
72	000000	000000	-	-	-
73	000000	000000	-	-	-
74	000000	000000	-	-	-
75	000000	000000	-	-	-
76	000000	000000	-	-	-
77	000000	000000	-	-	-
78	000000	000000	-	-	-
79	000000	000000	-	-	-
80	000000	000000	-	-	-
81	000000	000000	-	-	-
82	000000	000000	-	-	-
83	000000	000000	-	-	-
84	000000	000000	-	-	-
85	000000	000000	-	-	-
86	000000	000000	-	-	-
87	000000	000000	-	-	-
88	000000	000000	-	-	-
89	000000	000000	-	-	-
90	000000	000000	-	-	-
91	000000	000000	-	-	-
92	000000	000000	-	-	-
93	000000	000000	-	-	-
94	000000	000000	-	-	-
95	000000	000000	-	-	-
96	000000	000000	-	-	-
97	000000	000000	-	-	-
98	000000	000000	-	-	-
99	000000	000000	-	-	-
100	000000	000000	-	-	-
101	000000	000000	-	-	-
102	000000	000000	-	-	-
103	000000	000000	-	-	-
104	000000	000000	-	-	-
105	000000	000000	-	-	-
106	000000	000000	-	-	-
107	000000	000000	-	-	-
108	000000	000000	-	-	-
109	000000	000000	-	-	-
110</td					