国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

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： 二〇一三年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....7
3 主要财务指标和基金净值表现.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....7
4 管理人报告.....8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....13
5 托管人报告.....13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....14
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....14
6.1 资产负债表.....14
6.2 利润表.....15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....16
6.4 报表附注.....17
7 投资组合报告.....31
7.1 期末基金资产组合情况.....31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....35
7.6 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.....36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....36
7.8 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.....36
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....36

7.10 投资组合报告附注.....37
8 基金份额持有人信息.....38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....38
9 开放式基金份额变动.....38
10 重大事件揭示.....38
10.1 基金份额持有人大会决议.....38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....39
10.4 基金投资策略的改变.....39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....40
10.8 其他重大事件.....41
11 备查文件目录.....42
11.1 备查文件目录.....42
11.2 存放地点.....42
11.3 查阅方式.....42

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
基金简称	国泰金鹏蓝筹混合
基金主代码	020009
交易代码	020009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月29日
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
报告期末基金份额总额	1,481,088,448.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将坚持并深化价值投资理念。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增值，力争获取更高的超额市场收益。
投资策略	（1）大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济环境、证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围组合投资止损点，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。 （2）股票资产投资策略 本基金的股票资产投资采取核心-卫星投资策略(Core-Satellitestrategy)，核心投资主要以富时中国A股蓝筹价值100 指数所包含的成分股以及备选成分股为标的，构建核心股票投资组合，以期获得市场的平均收益（benchmark performance），这部分投资至少占基金股票资产的80%；同时，把握行业周期轮动、市场时机等机会，通过自下而上、精选个股、积极主动的卫星投资策略，力争获得更高的超额市场收益(outperformance)。 （3）债券资产投资策略

	本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。
业绩比较基准	业绩比较基准=60%×富时中国A股蓝筹价值100指数+40%×新华巴克莱资本中国债券指数 本基金的股票业绩比较基准为富时中国A股蓝筹价值100指数，债券业绩比较基准为新华巴克莱资本中国债券指数。 自2013年2月1日起本基金业绩比较基准由原“60%×富时中国A股蓝筹价值100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股蓝筹价值100指数+40%×中证全债指数”。
风险收益特征	本基金属于中等风险的证券投资基金品种，基金在获取市场平均收益的同时，力争获得更高的超额收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海中	唐州徽
	联系电话	021-38561600 转	95566
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		（021）38569000， 400-888-8688	95566
传真		021-38561800	010-66594942
注册地址		上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		陈勇胜	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中心	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	7,518,573.43
本期利润	-53,803,660.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0341
本期加权平均净值利润率	-3.92%
本期基金份额净值增长率	-4.89%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	-299,695,952.43
期末可供分配基金份额利润	-0.2023
期末基金资产净值	1,181,392,496.52
期末基金份额净值	0.798
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2013 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	81.73%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、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交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-13.54%	1.73%	-9.94%	1.18%	-3.60%	0.55%
过去三个	-6.56%	1.34%	-7.62%	0.89%	1.06%	0.45%

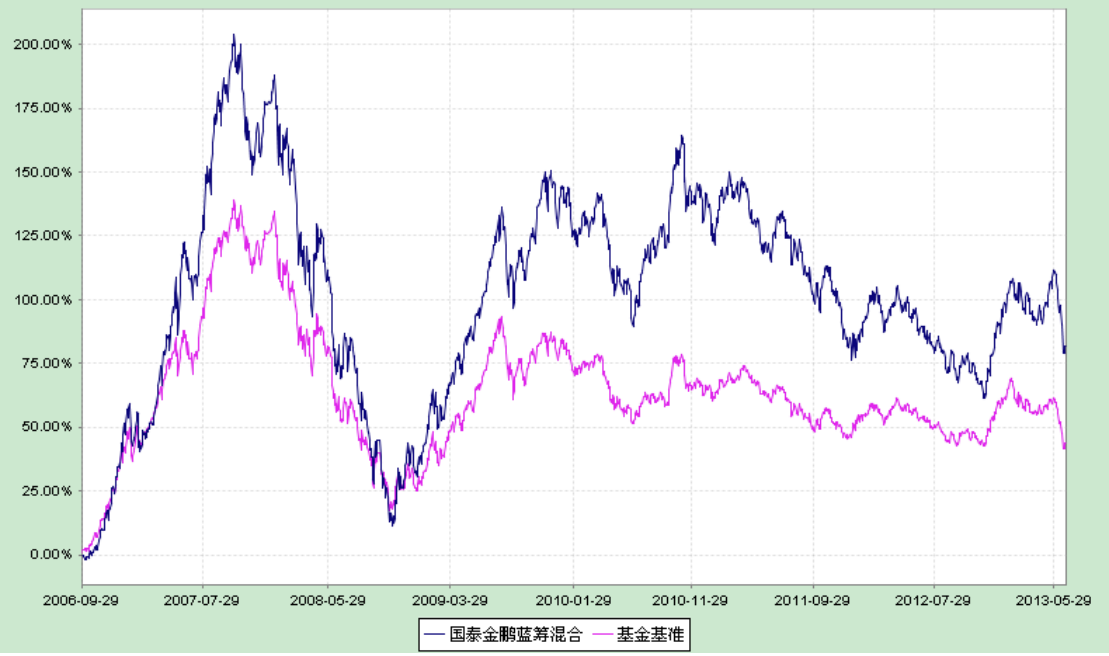
月						
过去六个月	-4.89%	1.39%	-9.31%	0.95%	4.42%	0.44%
过去一年	-3.86%	1.27%	-6.41%	0.83%	2.55%	0.44%
过去三年	-5.64%	1.25%	-5.47%	0.80%	-0.17%	0.45%
自基金成立起至今	81.73%	1.64%	43.98%	1.19%	37.75%	0.45%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2006 年 9 月 29 日至 2013 年 6 月 30 日）



注：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。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上

海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 35 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）	证券从业	说明

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
黄焱	本基金的基金经理、国泰价值经典股票的基金经理、公司投资总监兼基金管理部总监、公司总经理助理	2008-05-17	-	18	硕士研究生。曾任职于中期国际期货公司、和利投资发展公司、平安保险公司投资管理中心。2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司，曾任国泰金泰封闭基金经理、金鹿保本增值基金和金象保本增值基金的共同基金经理，2006 年 7 月至 2008 年 5 月担任金龙行业混合的基金经理，2007 年 4 月至 2010 年 10 月任国泰金鑫封闭的基金经理。2008 年 5 月起任国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金的基金经理；2010 年 8 月起兼任国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）的基金经理。2009 年 5 月至 2011 年 1 月任基金管理部副总监，2011 年 1 月起任基金管理部总监，2011 年 1 月至 2012 年 2 月任公司投资副总监，2012 年 2 月起任公司投资总监。2012 年 10 月起任公司总经理助理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数≥20），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年，资本市场呈现冲高回落走势。1 月份低估值银行板块延续去年 12 月份的表现，多数银行股创出阶段高点，上涨指数冲高至 2444 点回落，进入 2 月份，风格转向成长股，医药、环保和电子产业链涨幅居前，而食品饮料、有色、煤炭表现较弱。3～4 月份，经济复苏节奏低于市场预期，房地产调控政策加码，市场逐步震荡回落，5 月份主题投资获得市场认可，新能源汽车、传媒板块表现突出，6 月份在央行流动性紧缩下，上证指数下跌至 1849 点反弹，最终上半年下跌 12.7%。

本基金坚持价值投资理念，长期配置低估值蓝筹股，经济转型方向看好环保产业，在一季度获得较佳回报。 二季度，银行股表现弱于其他中小市值股票。操作上，对上半年资本市场判断为震荡市，政策刺激方向来自于城镇化。仓位保持在中性仓位，结构上依旧重点配置在受益经济企稳和受宏观政策刺激的相关行业，如金融、房地产、环保等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2013 年上半年的净值增长率为-4.89%，同期业绩比较基准收益率为-9.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

两会期间政府工作报告提出 2013 年 GDP 目标为 7.5%，CPI 3.5%，财政赤字 1.2 万亿，M2 增速控制在 13%，全年目标偏中性。两会后，政府工作重点以控制风险为先，对影子银行的清理进度高于预期。从经济数据看，经济复苏力度偏弱，PMI 数据逐月下滑，6 月份 CPI 2.1%，均低于市场预期。房地产市场经过调控后，预计下半年政策会有小幅放松。而资本市场方面，新股发行启动推迟，预计三季度启动，一批经过层层筛选的优质上市公司将登陆资本市场，带来新的投资标的。风格方面，小盘股和大盘股估值差价巨大，三季度有回归均值的可能；以银行、地产为代表的低估值价值股经济复苏预期下重新获得市场认同。机构投资者对大盘蓝筹股投资价值的认同将逐步提升估值。未来股市投资收益更多来源于个体公司业绩的超预期增长和时间因素换来的企业盈利累积，如金融、地产等，中长期看好新能源电动车、环保和医药等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	58,574,409.74	232,310,840.50
结算备付金		654,738.12	603,497.58
存出保证金		146,333.70	1,000,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,073,900,342.02	1,151,666,517.20
其中：股票投资		975,884,542.02	1,097,803,917.20
基金投资		-	-
债券投资		98,015,800.00	53,862,600.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		52,080,000.00	-
应收利息	6.4.7.5	1,791,431.54	730,315.37
应收股利		-	-
应收申购款		164,636.52	78,393.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,187,311,891.64	1,386,389,564.30
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2013 年 6 月 30 日**	**上年度末 2012 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,323,197.38	18,944,830.61
应付赎回款		701,374.42	521,309.38
应付管理人报酬		1,576,591.87	1,607,415.86
应付托管费		262,765.31	267,902.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	524,804.82	393,180.52
应交税费		74,700.00	36,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	455,961.32	1,266,053.95
负债合计		5,919,395.12	23,036,692.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,481,088,448.95	1,625,371,759.73
未分配利润	6.4.7.10	-299,695,952.43	-262,018,888.39
所有者权益合计		1,181,392,496.52	1,363,352,871.34
负债和所有者权益总计		1,187,311,891.64	1,386,389,564.30

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.798 元，基金份额总额 1,481,088,448.95 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		**-39,655,468.35**	**54,825,232.56**
1.利息收入		1,605,703.04	1,767,934.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	494,942.24	502,929.30
债券利息收入		975,458.80	1,260,985.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		135,302.00	4,020.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,036,798.01	-95,993,459.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,854,886.79	-105,722,089.02

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-371,930.18	-174,550.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,553,841.40	9,903,179.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-61,322,234.31	148,850,654.93
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,264.91	200,102.24
减：二、费用		**14,148,192.53**	**15,508,523.09**
1．管理人报酬		10,213,387.01	11,269,351.13
2．托管费		1,702,231.12	1,878,225.14
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.18	2,002,970.17	2,149,679.65
5．利息支出		4,804.69	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,804.69	-
6．其他费用	6.4.7.19	224,799.54	211,267.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-53,803,660.88**	**39,316,709.47**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-53,803,660.88	39,316,709.47

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,625,371,759.73	-262,018,888.39	1,363,352,871.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-53,803,660.88	-53,803,660.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-144,283,310.78	16,126,596.84	-128,156,713.94

值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	29,697,550.50	-3,753,775.37	25,943,775.13
2.基金赎回款	-173,980,861.28	19,880,372.21	-154,100,489.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,481,088,448.95	-299,695,952.43	1,181,392,496.52
项目	**上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	2,018,682,315.08	-377,090,418.48	1,641,591,896.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,316,709.47	39,316,709.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-331,750,106.90	51,731,695.47	-280,018,411.43
其中：1.基金申购款	57,362,597.88	-8,241,915.44	49,120,682.44
2.基金赎回款	-389,112,704.78	59,973,610.91	-329,139,093.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,686,932,208.18	-286,042,013.54	1,400,890,194.64

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：巴立康

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”) 证监基金字[2006]第 159 号《关于同意国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金募集的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开

放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,248,741,994.07 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 125 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,248,974,112.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 232,118.68 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、现金、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，债券以及包括权证和资产支持证券在内的其他证券资产占基金资产的 0%-60%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2013 年 2 月 1 日之前，本基金的业绩比较基准为富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数（原新华富时蓝筹价值 100 指数）×60%＋新华巴克莱资本中国债券指数(原新华雷曼中国债券指数)×40%。因富时集团终止提供新华巴克莱中国全债指数系列的相关服务，根据《 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金业绩比较基准自 2013 年 2 月 1 日起发生变更,变更后的业绩比较基准为“60%X 富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数+40%X 中证全债指数”。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2013 年 8 月 20 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则－基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净

值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1） 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2） 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3） 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

（4） 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	58,574,409.74
定期存款	-
其他存款	-

合计	58,574,409.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,152,854,671.54	975,884,542.02	-176,970,129.52
债券	交易所市场	48,106,970.00	48,098,800.00	-8,170.00
	银行间市场	49,822,200.55	49,917,000.00	94,799.45
	合计	97,929,170.55	98,015,800.00	86,629.45
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,250,783,842.09	1,073,900,342.02	-176,883,500.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	9,781.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	265.23
应收债券利息	1,781,325.16
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.33
其他	59.31
合计	1,791,431.54

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	522,205.83
银行间市场应付交易费用	2,598.99
合计	524,804.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	7,607.04
预提费用	198,354.28
合计	455,961.32

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,625,371,759.73	1,625,371,759.73
本期申购	29,697,550.50	29,697,550.50
本期赎回（以“-”号填列）	-173,980,861.28	-173,980,861.28
本期末	1,481,088,448.95	1,481,088,448.95

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-101,419,650.40	-160,599,237.99	-262,018,888.39
本期利润	7,518,573.43	-61,322,234.31	-53,803,660.88
本期基金份额交易产生的变动数	8,332,830.97	7,793,765.87	16,126,596.84
其中：基金申购款	-1,778,271.28	-1,975,504.09	-3,753,775.37
基金赎回款	10,111,102.25	9,769,269.96	19,880,372.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-85,568,246.00	-214,127,706.43	-299,695,952.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	484,532.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,134.96
其他	1,274.60
合计	494,942.24

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	682,259,271.00
减：卖出股票成本总额	670,404,384.21
买卖股票差价收入	11,854,886.79

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	147,562,992.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	144,319,840.72
减：应收利息总额	3,615,082.07
债券投资收益	-371,930.18

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,553,841.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,553,841.40

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1.交易性金融资产	-61,322,234.31
——股票投资	-61,373,664.35
——债券投资	51,430.04
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-61,322,234.31

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	19,114.10
转换费收入	5,150.81
合计	24,264.91

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	1,999,120.17
银行间市场交易费用	3,850.00
合计	2,002,970.17

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	8,045.26
债券账户服务费	18,000.00
其他	400.00
合计	224,799.54

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金管理人于 2013 年 5 月 31 日发布《国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告》，本基金管理人获批设立子公司国泰元鑫资产管理有限公司，注册资本为 5000 万元人民币。本基金管理人持有 50%的股权，中投信托有限责任公司和上海津赞投资管理有限公司分别持有 30%和 20%的股权。国泰元鑫资产管理有限公司已在上海市工商行政管理局虹口分局完成工商注册登记，取得营业执照。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,213,387.01	11,269,351.13
其中：支付销售机构的客户维护费	1,053,064.39	1,098,896.21

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,702,231.12	1,878,225.14

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	58,574,409.74	484,532.68	128,752,476.39	495,563.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601989	中国重工	2013-05-16	重大事项	4.52	2013-07-22	4.46	2,565,881	12,096,769.24	11,597,782.12	-
600292	九龙电力	2013-06-05	重大事项	16.90	2013-07-01	17.50	2,766,596	35,156,459.50	46,755,472.40	-
600335	国机汽车	2013-03-25	重大事项	11.55	2013-07-01	13.99	3,608,200	50,894,205.30	41,674,710.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在获取市场平均收益的同时，力争获得更高的超额收益”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由监察稽核部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。监察稽核部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 3.38%(2012 年 12 月 31 日：1.84%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值或者基金净资产的 40%。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	58,574,409.74	-	-	-	58,574,409.74
结算备付金	654,738.12	-	-	-	654,738.12

存出保证金	146,333.70	-	-	-	146,333.70
交易性金融资产	98,015,800.00	-	-	975,884,542.02	1,073,900,342.02
应收证券清算款	-	-	-	52,080,000.00	52,080,000.00
应收利息	-	-	-	1,791,431.54	1,791,431.54
应收申购款	2,087.17	-	-	162,549.35	164,636.52
资产总计	157,393,368.73	-	-	1,029,918,522.91	1,187,311,891.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,323,197.38	2,323,197.38
应付赎回款	-	-	-	701,374.42	701,374.42
应付管理人报酬	-	-	-	1,576,591.87	1,576,591.87
应付托管费	-	-	-	262,765.31	262,765.31
应付交易费用	-	-	-	524,804.82	524,804.82
应付税费	-	-	-	74,700.00	74,700.00
其他负债	-	-	-	455,961.32	455,961.32
负债总计	-	-	-	5,919,395.12	5,919,395.12
利率敏感度缺口	157,393,368.73	-	-	1,023,999,127.79	1,181,392,496.52
上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	232,310,840.50	-	-	-	232,310,840.50
结算备付金	603,497.58	-	-	-	603,497.58
存出保证金	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
交易性金融资产	53,862,600.00	-	-	1,097,803,917.20	1,151,666,517.20
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	730,315.37	730,315.37
应收申购款	1,093.30	-	-	77,300.35	78,393.65
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	286,778,031.38	-	-	1,099,611,532.92	1,386,389,564.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,944,830.61	18,944,830.61
应付赎回款	-	-	-	521,309.38	521,309.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,607,415.86	1,607,415.86

应付托管费	-	-	-	267,902.64	267,902.64
应付交易费用	-	-	-	393,180.52	393,180.52
应交税费	-	-	-	36,000.00	36,000.00
其他负债	-	-	-	1,266,053.95	1,266,053.95
负债总计	-	-	-	23,036,692.96	23,036,692.96
利率敏感度缺口	286,778,031.38	-	-	1,076,574,839.96	1,363,352,871.34

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 8.30%(2012 年 12 月 31 日：3.95%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，债券以及包括权证和资产支持证券在内的其他证券资产占基金资产的 0%-60%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	975,884,542.02	82.60	1,097,803,917.20	80.52
交易性金融资产-债券投资	98,015,800.00	8.30	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,073,900,342.02	90.90	1,097,803,917.20	80.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除富时中国A股蓝筹价值100指数外其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	富时中国A股蓝筹价值100指数上升5%	增加约5,069	增加约6,362
	富时中国A股蓝筹价值100指数下降5%	减少约5,069	减少约6,362

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分

为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具为交易性金融资产，其中属于第一层级的余额为 935,553,159.62 元，属于第二层级的余额为 138,347,182.40 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 1,101,642,517.20 元，第二层级 50,024,000.00 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	975,884,542.02	82.19
	其中：股票	975,884,542.02	82.19
2	固定收益投资	98,015,800.00	8.26
	其中：债券	98,015,800.00	8.26

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	59,229,147.86	4.99
6	其他各项资产	54,182,401.76	4.56
7	合计	1,187,311,891.64	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,847,803.69	0.66
B	采矿业	42,771,415.39	3.62
C	制造业	344,545,437.46	29.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,755,472.40	3.96
E	建筑业	41,654,718.00	3.53
F	批发和零售业	99,453,768.75	8.42
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,355,612.60	1.22
J	金融业	271,767,845.54	23.00
K	房地产业	64,573,840.19	5.47
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,520,104.00	3.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,638,524.00	0.22
	合计	975,884,542.02	82.60

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产

					净值比例（%）
1	601166	兴业银行	3,761,260	55,553,810.20	4.70
2	600036	招商银行	4,313,538	50,037,040.80	4.24
3	000001	平安银行	5,017,066	50,020,148.02	4.23
4	601601	中国太保	3,127,694	49,824,165.42	4.22
5	600089	特变电工	5,980,337	48,141,712.85	4.07
6	600292	九龙电力	2,766,596	46,755,472.40	3.96
7	601318	中国平安	1,291,550	44,894,278.00	3.80
8	600587	新华医疗	1,052,001	43,594,921.44	3.69
9	600335	国机汽车	3,608,200	41,674,710.00	3.53
10	002672	东江环保	1,117,650	39,520,104.00	3.35
11	600376	首开股份	6,791,753	37,694,229.15	3.19
12	600153	建发股份	5,627,111	35,394,528.19	3.00
13	601808	中海油服	2,502,467	35,259,760.03	2.98
14	000024	招商地产	1,107,068	26,879,611.04	2.28
15	601669	中国水电	8,653,729	24,922,739.52	2.11
16	600572	康恩贝	2,211,961	24,530,647.49	2.08
17	000639	西王食品	1,642,890	23,049,746.70	1.95
18	600739	辽宁成大	1,706,138	22,384,530.56	1.89
19	601628	中国人寿	1,565,990	21,438,403.10	1.81
20	002567	唐人神	2,638,986	19,924,344.30	1.69
21	000800	一汽轿车	1,346,261	16,559,010.30	1.40
22	002063	远光软件	993,468	14,355,612.60	1.22
23	000725	京东方 A	6,443,102	14,303,686.44	1.21
24	002318	久立特材	804,965	13,789,050.45	1.17
25	600498	烽火通信	775,373	12,778,147.04	1.08
26	600276	恒瑞医药	466,363	12,293,328.68	1.04
27	601668	中国建筑	3,620,400	11,838,708.00	1.00
28	601989	中国重工	2,565,881	11,597,782.12	0.98
29	000968	煤 气 化	1,542,289	11,227,863.92	0.95
30	000521	美菱电器	3,400,601	10,677,887.14	0.90
31	600997	开滦股份	1,583,044	9,023,350.80	0.76
32	600582	天地科技	1,367,163	8,777,186.46	0.74
33	002029	七 匹 狼	1,200,000	8,580,000.00	0.73
34	002477	雏鹰农牧	497,011	7,847,803.69	0.66
35	002005	德豪润达	840,427	7,815,971.10	0.66
36	000983	西山煤电	920,546	7,511,655.36	0.64
37	000338	潍柴动力	412,468	7,156,319.80	0.61
38	600362	江西铜业	439,243	6,913,684.82	0.59
39	000816	江淮动力	1,735,911	6,266,638.71	0.53
40	601299	中国北车	1,624,638	6,108,638.88	0.52

41	002367	康力电梯	545,608	6,105,353.52	0.52
42	601117	中国化学	513,999	4,893,270.48	0.41
43	300147	香雪制药	238,290	3,998,506.20	0.34
44	600114	东睦股份	321,300	3,017,007.00	0.26
45	002106	莱宝高科	192,652	2,957,208.20	0.25
46	600149	廊坊发展	424,200	2,638,524.00	0.22
47	600366	宁波韵升	158,600	2,504,294.00	0.21
48	002466	天齐锂业	65,100	2,208,192.00	0.19
49	600535	天士力	16,474	644,957.10	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601601	中国太保	38,121,803.40	2.80
2	600376	首开股份	35,102,088.06	2.57
3	000024	招商地产	31,337,355.87	2.30
4	002672	东江环保	26,978,861.03	1.98
5	601808	中海油服	21,767,318.57	1.60
6	000725	京东方 A	16,624,970.00	1.22
7	600498	烽火通信	16,201,173.21	1.19
8	000521	美菱电器	15,598,432.40	1.14
9	002567	唐人神	15,410,744.50	1.13
10	600153	建发股份	14,468,849.97	1.06
11	601989	中国重工	13,593,311.77	1.00
12	601668	中国建筑	13,499,867.00	0.99
13	600276	恒瑞医药	13,226,890.07	0.97
14	002318	久立特材	13,007,735.69	0.95
15	601318	中国平安	12,201,907.76	0.89
16	000858	五 粮 液	12,124,678.87	0.89
17	000001	平安银行	12,031,410.00	0.88
18	002275	桂林三金	11,026,426.40	0.81
19	002005	德豪润达	11,006,617.40	0.81
20	000951	中国重汽	10,301,663.60	0.76

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000598	兴蓉投资	45,835,626.38	3.36
2	600388	龙净环保	36,526,057.08	2.68
3	600292	九龙电力	30,878,617.93	2.26
4	600535	天士力	23,490,412.74	1.72
5	601166	兴业银行	22,656,709.97	1.66
6	000001	平安银行	22,133,984.61	1.62
7	002226	江南化工	20,771,289.60	1.52
8	600068	葛洲坝	19,899,649.42	1.46
9	600239	云南城投	18,403,648.85	1.35
10	000800	一汽轿车	17,877,393.07	1.31
11	002462	嘉事堂	14,063,618.99	1.03
12	600089	特变电工	12,990,184.60	0.95
13	600320	振华重工	12,462,208.33	0.91
14	000731	四川美丰	12,172,429.98	0.89
15	600060	海信电器	11,993,691.73	0.88
16	000983	西山煤电	11,787,422.79	0.86
17	002029	七 匹 狼	11,426,107.02	0.84
18	000858	五 粮 液	11,092,710.68	0.81
19	601006	大秦铁路	10,937,473.68	0.80
20	000338	潍柴动力	10,921,272.95	0.80

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	609,858,673.38
卖出股票的收入（成交）总额	682,259,271.00

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	58,047,800.00	4.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	39,968,000.00	3.38
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	98,015,800.00	8.30

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019025	10 国债 25	300,000	29,937,000.00	2.53
2	041262044	12 富通 CP002	200,000	20,064,000.00	1.70
3	041359018	13 常熟风范 CP001	200,000	19,904,000.00	1.68
4	019302	13 国债 02	100,000	9,970,000.00	0.84
5	130002	13 付息国债 02	100,000	9,949,000.00	0.84

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。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、交易活跃的期货合约。

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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期内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报告编制日前一年受到公开谴责、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”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》。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 2,555 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。

本基金管理人此前投资中国平安股票时，严格执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，本基金管理人就中国平安子公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为平安证券存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	146,333.70
2	应收证券清算款	52,080,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,791,431.54
5	应收申购款	164,636.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,182,401.76

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600292	九龙电力	46,755,472.40	3.96	重大事项
2	600335	国机汽车	41,674,710.00	3.53	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
71,075	20,838.39	50,044,444.51	3.38%	1,431,044,004.44	96.62%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	111,615.19	0.01%

注：1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 9 月 29 日）基金份额总额	1,248,974,112.75
本报告期期初基金份额总额	1,625,371,759.73
本报告期基金总申购份额	29,697,550.50
减：本报告期基金总赎回份额	173,980,861.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,481,088,448.95

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2013 年 3 月 6 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》刊登了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十四次会议审议通过，同意梁之平先生因工作需要离职。

2013 年 6 月 25 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过，同意李志坚先生出任公司副总经理。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	1	159,640,692.57	12.40%	145,336.85	12.48%	-
中信建投	1	224,644,575.09	17.44%	198,788.55	17.07%	-
北京高华证券	1	76,538,302.47	5.94%	69,680.18	5.98%	-
万联证券	1	426,012,331.23	33.08%	387,840.23	33.31%	-
中金公司	1	175,394,400.57	13.62%	157,918.37	13.56%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	225,619,728.10	17.52%	204,772.08	17.59%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

(1)资力雄厚，信誉良好；

(2)财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3)经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；

(4)内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5)公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

申银万国	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	9,064,381.23	49.80%	68,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	9,136,011.23	50.20%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金变更业绩比较基准及修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2013-01-28
2	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-04-01
3	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-04-26
4	国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-05-31
5	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-06-08
6	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-06-15

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、关于同意国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金募集的批复
2、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金合同
3、国泰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、法律法规要求备查的其他文件

11.2 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。

11.3 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
二〇一三年八月二十四日