

国泰金鑫股票型证券投资基金
(原金鑫证券投资基金转型)
2014 年第 3 季度报告

2014 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年十月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本基金系原封闭式基金金鑫证券投资基金转型而来。金鑫基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2014 年 7 月 11 日起至 2014 年 8 月 11 日 17:00 止，议案内容包括金鑫证券投资基金由封闭式转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。本次会议议案于 2014 年 8 月 12 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。自 2014 年 9 月 15 日起，原《金鑫证券投资基金基金合同》终止，《国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“国泰金鑫股票型证券投资基金”。

本报告中，原金鑫证券投资基金报告期自 2014 年 7 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日止，国泰金鑫股票型证券投资基金报告期自 2014 年 9 月 15 日（基金合同生效日）起至 2014 年 9 月 30 日止。

本报告中财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

2.1 国泰金鑫股票型证券投资基金

基金简称	国泰金鑫股票
基金主代码	519606

交易代码	519606
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 15 日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
投资目标	有效控制投资组合风险，以积极与稳健并重的投资原则，谋求基金资产长期稳定增值。
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运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。 2、股票投资策略 本基金将从中观角度出发，捕捉新政策背景下出现的行业投资机会，进行行业资产配置，并辅以个股强化策略。选择成长型股票是本基金投资策略的核心，本基金将以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手选择具有长期可持续成长能力的股票。 3、固定收益品种投资策略 由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。另外，本基金在中小企业私募债的投资中，将利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合 Z-Score、KMV 等数量分析模型，测算中小企

	业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异，根据自上而下的宏观经济及行业特性分析，从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异，结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。 4、股指期货投资策略 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，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。 5、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。
业绩比较基准	90%×沪深 300 指数收益率+ 10%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
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

2.2 原金鑫证券投资基金

基金简称	国泰金鑫封闭
基金主代码	500011

交易代码	500011
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 10 月 21 日
报告期末基金份额总额	3, 000, 000, 000. 00 份
投资目标	本基金是以具有良好成长性的国企股为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资组合由股票投资和债券投资两部分组成，其中股票投资部分主要包括稳定成长型国企股和快速成长型国企股。 稳定成长型股票的判断标准为：成长性来自于企业自身主营业务的增长潜力，具体表现为企业主营业务的行业地位和市场地位突出，主营业务的增长是公司利润长期持续增长的主要源泉，有产品、技术、销售渠道、特许权等方面的竞争优势等特点。 快速成长型股票的判断标准为：成长性来自于因企业的重大实质性变化而带来的公司业绩的高速增长潜力。本基金的快速成长国企股部分将侧重于具有资产重组题材股票的投资。 在遵循以上投资组合目标和范围的基础上，基金管理人将根据具体情况变化，适时调整投资组合。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	承担中等风险，获取中等的超额收益。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

项目	2014 年第 3 季度报告	
	转型后（2014 年 9 月 15 日-2014 年 9 月 30 日）	转型前（2014 年 7 月 1 日-2014 年 9 月 14 日）
1. 本期已实现收益	-1, 143, 762. 59	-16, 321, 011. 13
2. 本期利润	-23, 784, 360. 27	137, 772, 792. 44
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0079	0. 0459
4. 期末基金资产净值	3, 352, 846, 416. 87	3, 376, 630, 777. 14
5. 期末基金份额净值	1. 118	1. 1255

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 国泰金鑫股票型证券投资基金

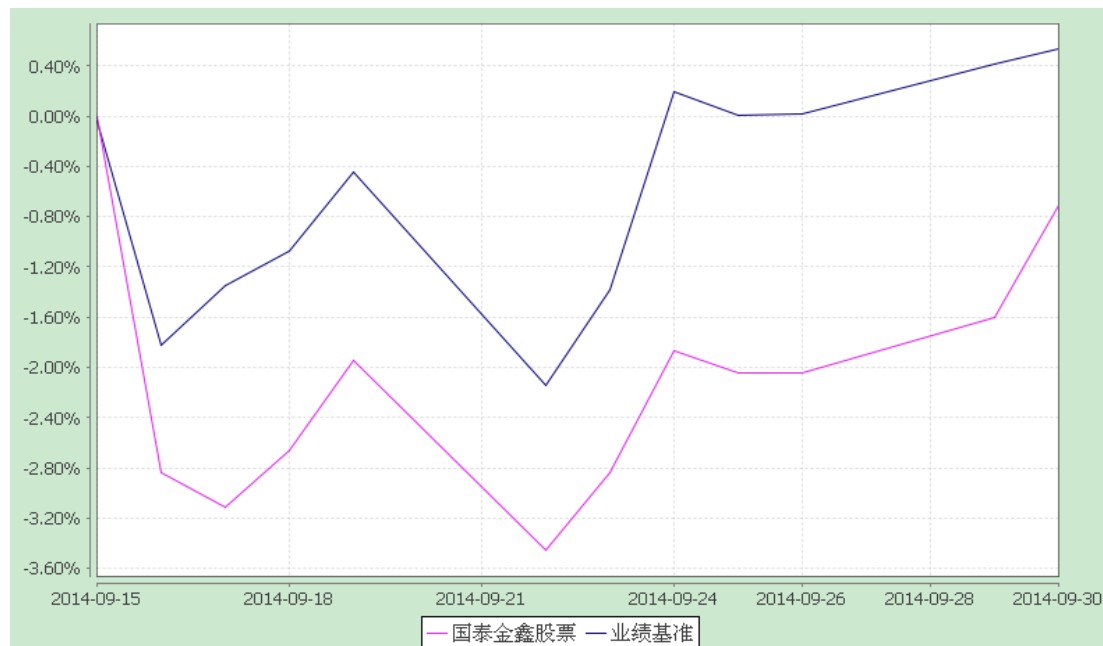
3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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
2014年9月15日至2014年9月	-0.71%	1.12%	0.54%	0.96%	-1.25%	0.16%

30 日

3.2.1.2 自基金转型以来基金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

国泰金鑫股票型证券投资基金
 转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2014 年 9 月 15 日至 2014 年 9 月 30 日)



注： 1、本基金合同生效日为2014 年9 月15 日，截至2014 年9 月30 日，本基金运作时间不满一年；

2、本基金的建仓期为6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6 个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.2 金鑫证券投资基金

3.2.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2014年7月1日-2014年9月14	4.25%	1.59%	-	-	-	-

日						
---	--	--	--	--	--	--

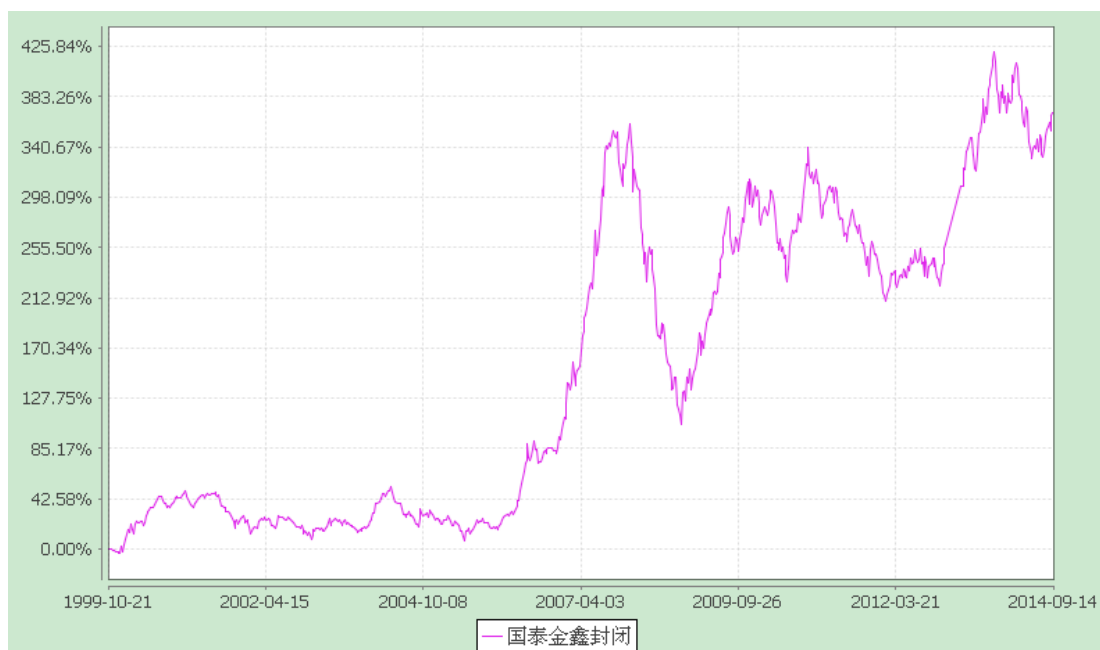
注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

3.2.2.2 自基金合同生效以来基金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

金鑫证券投资基金

转型前累计净值增长率历史走势图

(1999 年 10 月 21 日至 2014 年 9 月 14 日)



注：本基金的合同生效日为1999年10月21日。本基金在三个月建仓结束时，各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
王航	本基金的	2014-09-15	-	13	硕士研究生，CFA。曾任职于南方证券有限公

	基金 经理 (原 国泰 金鑫 封 闭)、 国泰 事件 驱动 股票、 国泰 国策 驱动 混合、 国泰 金龙 行业 混合、 国泰 金马 稳健 混合 的基 金经 理,权 益投 资总 监				司; 2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司; 历任社保 111 组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金经理助理、国泰金马稳健混合的基金经理助理、国泰金牛创新股票的基金经理助理; 2008 年 5 月至 2012 年 1 月任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理, 2010 年 4 月至 2014 年 9 月兼任金鑫证券投资基金的基金经理, 2011 年 8 月起兼任国泰事件驱动策略股票型证券投资基金的基金经理, 2013 年 9 月起兼任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理, 2014 年 2 月起兼任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2014 年 3 月起兼任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理, 2014 年 9 月起兼任国泰金鑫股票型证券投资基金的基金经理。2013 年 9 月至 2014 年 3 月任投资副总监, 2014 年 3 月起任权益投资总监。
--	---	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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。

2014 年 7 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日，原金鑫证券投资基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，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。

2014 年 9 月 15 日至报告期末，国泰金鑫股票型证券投资基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，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 公平交易专项说明

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，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

2014 年 7 月 1 日至 2014 年 9 月 14 日，原金鑫证券投资基金与本基金管理人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。

2014 年 9 月 15 日至报告期末，国泰金鑫股票型证券投资基金与本基金管理人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 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

三季度经济遭遇拐点，增长动能有所放缓。但股票市场走势与经济基本面发生背离，三季度A股走势强劲，特别进入九月迎来普涨局面，沪深300涨幅4.82%，创业板涨幅8.17%。分行业看，国防军工以及前期涨幅落后的农林牧渔、交通运输、钢铁等行业取得明显超额收益；银行、家电和医药等行业表现相对落后。

本基金三季度维持了较高的股票仓位，重点配置新能源汽车产业链、光伏、智能装备等产业方向，在三季度末增加了前期表现落后的医药、银行等行业的配置。但三季度市场分化仍然明显，本基金所重点投资行业和品种在三季度上涨幅度不大，因此虽然股票配置比例较高但未能取得预期投资效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

原金鑫证券投资基金 2014 年 7 月 1 至 9 月 14 日期间的净值增长率为 4.25%；国泰金鑫股票型证券投资基金 2014 年 9 月 15 日至 9 月 30 日期间的净值增长率为-0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，经济下行已成市场共识，宏观基本面短期仍难以成为市场走势的决定因素；四中全会、沪港通、三季度经济数据、上市公司三季报等事件都将在10月份发生，市场对这些事件的不同解读可能引发市场短期震荡。A股市场中的小盘科技股一方面受到海外科技股近期明显回调影响，另一方面，高估值和高涨幅也将再次面临业绩的考验。但是，对市场整体而言，无风险利率水平趋势性下降，金融体系充裕的资金仍然在寻求出路，加上改革有望在四中全会后进一步加快推进，等等这些促使今年股市和经济出现背离走势的逻辑并没有发生变化，因此我们预期四季度A股仍然维持窄幅震荡向上的格局。投资方向上，改革和转型仍然是市场的主题词，符合社会进步和技术发展大方向智能装备、新能源和

新能源汽车和互联网是未来具备巨大发展空间的行业，也是我们选取的重点投资方向；我国在发展中所遇到的一些瓶颈问题，例如安全、环保等急需解决，相关行业仍然有较大的整合和增长潜力；此外，经过调整后的以医药为代表的稳定增长的品种也有望在四季度完成估值切换。

§ 5 投资组合报告

5.1 国泰金鑫股票型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2014年9月15日-2014年9月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,527,502,459.61	75.15
	其中：股票	2,527,502,459.61	75.15
2	固定收益投资	686,316,339.00	20.41
	其中：债券	686,316,339.00	20.41
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	48,300,272.45	1.44
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	79,942,716.07	2.38
7	其他资产	21,198,322.26	0.63
8	合计	3,363,260,109.39	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,820,429,365.02	54.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,907,218.80	2.83
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	15,995,000.00	0.48
J	金融业	222,070,183.20	6.62
K	房地产业	112,476,205.95	3.35
L	租赁和商务服务业	113,130,000.00	3.37
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	124,369,486.64	3.71
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	24,125,000.00	0.72
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,527,502,459.61	75.38

5.1.3 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

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	600587	新华医疗	7,200,000	269,352,000.00	8.03
2	000625	长安汽车	13,300,000	182,210,000.00	5.43
3	600401	海润光伏	17,715,268	163,047,893.32	4.86

4	600885	宏发股份	7,022,924	151,624,929.16	4.52
5	002672	东江环保	3,759,658	124,369,486.64	3.71
6	600563	法拉电子	3,396,812	115,559,544.24	3.45
7	002400	省广股份	4,500,000	113,130,000.00	3.37
8	600900	长江电力	12,013,572	94,907,218.80	2.83
9	300146	汤臣倍健	3,107,311	91,075,285.41	2.72
10	002353	杰瑞股份	2,300,000	89,654,000.00	2.67

5.1.4 报告期末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	国家债券	246,834,899.00	7.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	430,032,000.00	12.83
	其中：政策性金融债	430,032,000.00	12.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,449,440.00	0.28
8	其他	-	-
9	合计	686,316,339.00	20.47

5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019322	13 国债 22	1,603,100	160,774,899.00	4.80
2	130243	13 国开 43	1,000,000	100,050,000.00	2.98
3	090417	09 农发 17	800,000	79,928,000.00	2.38
4	090311	09 进出 11	800,000	79,920,000.00	2.38
5	130428	13 农发 28	700,000	70,042,000.00	2.09

5.1.6 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投资。

5.1.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.1.8 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

本基金本期末未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 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。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	656,447.70
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	20,361,788.83
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	180,085.73
8	其他	—
9	合计	21,198,322.26

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告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 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600401	海润光伏	23,400,000.00	0.70	非公开发行

5.2 原金鑫证券投资基金投资组合报告

（报告期：2014年7月1日-2014年9月14日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,524,375,488.98	73.87
	其中：股票	2,524,375,488.98	73.87
2	固定收益投资	685,780,410.00	20.07
	其中：债券	685,780,410.00	20.07
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	152,642,181.32	4.47
7	其他资产	54,740,309.85	1.60
8	合计	3,417,538,390.15	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,813,657,485.66	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,062,875.76	2.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	15,995,000.00	0.47
J	金融业	225,720,859.31	6.68

K	房地产业	111,833,169.85	3.31
L	租赁和商务服务业	112,140,000.00	3.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	130,836,098.40	3.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,130,000.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,524,375,488.98	74.76

5.2.3 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

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	600587	新华医疗	7,200,000	255,240,000.00	7.56
2	000625	长安汽车	13,300,000	182,875,000.00	5.42
3	600885	宏发股份	7,022,924	162,721,149.08	4.82
4	600401	海润光伏	14,715,268	146,564,069.28	4.34
5	002672	东江环保	3,759,658	130,836,098.40	3.87
6	600563	法拉电子	3,396,812	124,934,745.36	3.70
7	002400	省广股份	4,500,000	112,140,000.00	3.32
8	002353	杰瑞股份	2,531,922	106,112,851.02	3.14
9	300146	汤臣倍健	3,107,311	96,264,494.78	2.85
10	600900	长江电力	12,013,572	91,062,875.76	2.70

5.2.4 报告期末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	国家债券	246,402,062.00	7.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	430,021,000.00	12.74
	其中：政策性金融债	430,021,000.00	12.74

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,357,348.00	0.28
8	其他	-	-
9	合计	685,780,410.00	20.31

5.2.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019322	13 国债 22	1,603,100	160,342,062.00	4.75
2	130243	13 国开 43	1,000,000	100,060,000.00	2.96
3	090417	09 农发 17	800,000	79,904,000.00	2.37
4	090311	09 进出 11	800,000	79,896,000.00	2.37
5	130428	13 农发 28	700,000	70,070,000.00	2.08

5.2.6 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。

5.2.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 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。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	656,447.70
2	应收证券清算款	34,345,704.85
3	应收股利	—
4	应收利息	19,414,002.93
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	324,154.37
8	其他	—
9	合计	54,740,309.85

5.2.11.4 报告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。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未存在前十名股票流通受限情况。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资原封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	7,500,000.00
报告期初至转型前买入总份额	—
报告期初至转型前卖出总份额	—
转型前最后一日管理人持有的封闭式基金份额	7,500,000.00
转型前最后一日持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	0.25

注：本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月15日）基金份额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
报告期期末基金份额总额	3,000,000,000.00

注：截止本报告期末，本基金尚处于集中申购期。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

金鑫证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起

止时间为自 2014 年 7 月 11 日起至 2014 年 8 月 11 日 17:00 止，议案内容包括金鑫证券投资基金由封闭式转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。本次会议议案于 2014 年 8 月 12 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。自 2014 年 9 月 15 日起，原《金鑫证券投资基金基金合同》终止，《国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“国泰金鑫股票型证券投资基金”。

本基金自 2014 年 9 月 22 日至 2014 年 10 月 17 日开放集中申购，期间不开放赎回，称为“集中申购期”。截止至本报告期末，本基金尚处于集中申购期。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于同意设立金鑫证券投资基金的批复
- 2、金鑫证券投资基金合同
- 3、金鑫证券投资基金托管协议
- 4、关于金鑫证券投资基金基金份额持有人大会的决议
- 5、国泰金鑫股票型证券投资基金基金合同
- 6、国泰金鑫股票型证券投资基金托管协议
- 7、国泰金鑫股票型证券投资基金招募说明书
- 8、报告期内披露的各项公告
- 9、法律法规要求备查的其他文件

9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

9.3 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）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一四年十月二十七日