

泰达荷银货币市场基金 2008年第三季度报告

一、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...

四、基金管理人报告 (一)基金经营情况

沈悦先生,工商管理硕士,计量金融硕士。2002年9月至2004年2月任职嘉实基金投资部,担任固定收益经理及社保基金投资组合经理...

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期2008年07月01日-2008年09月30日

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...

二、基金净值表现 (一)基金净值表现

Table with 5 columns: 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

基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



二、报告期内基金投资组合情况 (一)报告期末基金投资组合

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

(二)报告期末债券回购融资情况 1、

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

注:上表中,报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例指报告期内每日融资余额占基金资产净值的简单平均值...

2、本报告期末本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

(二) 基金投资组合平均剩余期限

Table with 2 columns: 项目, 天数

2、报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 债券资产占基金资产净值比例(%)

注:报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过180天情况。

(四) 报告期末债券投资组合 1、按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

注:附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应计利息。

2、基金投资的前十名债券明细

国泰金牛创新成长股票型证券投资基金 2008年第三季度报告

一、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...

二、基金产品概况 1、基金简介 基金名称:国泰金牛创新

2、基金产品说明 (1)投资目标:本基金为成长型股票基金,主要投资于通过各类创新预期能带来公司未来高速增长的创新型上市公司股票...

(2)投资策略: 本基金的大类资产配置主要通过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相对收益率、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、债券及现金类资产的配置比例。

(3)股票资产投资策略: 本基金股票资产投资将在国家发展规划所指引的产业领域中,采取自下而上的选股方法,利用“成长性”筛选出成长型上市公司股票池;在此基础上利用公司自主开发的“创新型上市公司评价体系”,对符合创新型特征的上市公司进行深入的分析和比较,筛选出通过创新能够在未来带来高速增长的上上市公司,形成创新成长型上市公司股票池,最后通过相对价值评估,形成优化的股票投资组合。

(4)债券资产投资策略: 本基金债券资产投资主要以中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,通过债券互换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

(5)业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率(在其它投资理想的业绩基准出现以后,经一定程序后可对业绩基准进行替换)。

(6)风险收益特征:本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金。

三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计) 1、主要财务指标

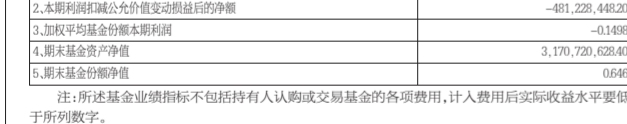
Table with 2 columns: 主要财务指标, 2008年7-9月

注: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。

2、本报告基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 5 columns: 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

3、国泰金牛创新成长基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



四、基金管理人报告 (一)基金管理人报告 1、基金管理人概况

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

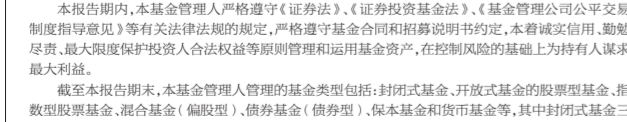
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期2008年07月01日-2008年09月30日

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...

二、基金净值表现 (一)基金净值表现

Table with 5 columns: 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

基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



四、基金管理人报告 (一)基金管理人报告 1、基金管理人概况

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

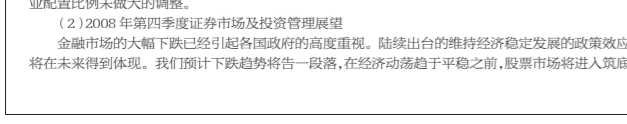
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期2008年07月01日-2008年09月30日

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...

二、基金净值表现 (一)基金净值表现

Table with 5 columns: 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

基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



五、基金管理人报告 (一)基金管理人报告 1、基金管理人概况

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期2008年07月01日-2008年09月30日

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金 2008年第三季度报告

一、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...

二、基金产品概况 1、基金简介 基金名称:国泰金鼎价值精选

2、基金产品说明 (1)投资目标:本基金为价值精选混合型基金,以量化指标分析为基础,在严格的风险控制前提下,不断寻找超越业绩比较基准的稳定回报。

(2)投资策略: A、大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过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市场环境、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、债券及现金类资产的配置比例。

B、股票资产投资策略: 本基金以量化分析为基础,从上市公司的基本面分析入手,建立基金的一、二级市场股票,根据股票池中个股的估值水平和P/E值,运用组合优化模型,积极构建并持续优化基金的股票组合,在有效控制组合估值风险的前提下,谋求超额收益。

C、债券资产投资策略: 本基金的债券资产投资主要以中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,通过债券互换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

(3)业绩比较基准:65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率。

(4)风险收益特征:本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计) 1、主要财务指标

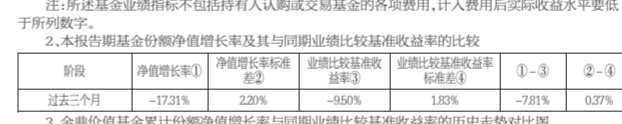
Table with 2 columns: 主要财务指标, 2008年7-9月

注: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。

2、本报告基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 5 columns: 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

3、国泰金鼎价值精选基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



四、基金管理人报告 (一)基金管理人报告 1、基金管理人概况

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

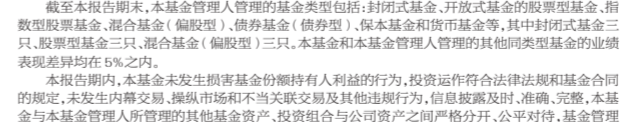
Table with 2 columns: 主要财务指标, 2008年7-9月

注: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。

2、本报告基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 5 columns: 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

3、国泰金鼎价值精选基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



四、基金管理人报告 (一)基金管理人报告 1、基金管理人概况

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

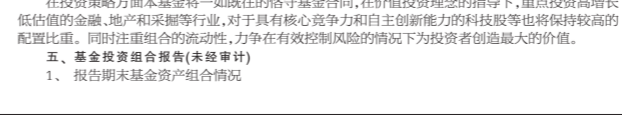
Table with 2 columns: 主要财务指标, 2008年7-9月

注: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。

2、本报告基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 5 columns: 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

3、国泰金鼎价值精选基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



五、基金管理人报告 (一)基金管理人报告 1、基金管理人概况

二、报告期内基金业绩表现 (一)主要财务指标(单位:元)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 2008年7-9月

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

注:上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况(%)

(六)投资组合报告附注 1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制前一年未受到公开谴责、处罚。

2、本基金的投资方法说明 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在基金存续期内平均摊销。

3、本报告期末,本基金没有持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

4、本报告期末没有需说明的证券投资决策程序。

5、其他资产的构成

Table with 3 columns: 序号, 其他资产, 金额(元)

6、由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

六、基金管理人运用固有资金投资本基金情况 本报告期末未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况;截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

七、开放式基金申购赎回 1、

Table with 2 columns: 序号, 项目, 份额(份)

八、备查文件目录及查阅方式 (一)中国证监会核准国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金设立的文件;

(二)《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金合同》;

(三)《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金招募说明书》;

(四)《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金托管协议》。

查询方式:投资者可通过指定信息披露报纸(《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》)或登陆基金管理人互联网网站(http://www.guotai.com.cn)查询。

存放地:基金管理人基金资产托管人的住所。

国泰金鼎基金管理有限公司 2008年10月24日

国泰基金管理有限公司 2008年10月24日

国泰基金管理有限公司 2008年10月24日