

国泰沪深300指数证券投资基金

2012 第三季度报告

目前,股指已由低点向上反弹,市场人气有所恢复,资金意愿增强及成交量有所增强,技术指标上也具备了进一步反弹的条件...

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 农林牧渔, 采矿业, 制造业, etc.

5.3 报告期末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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601318 中国平安, 600016 民生银行, etc.

5.4 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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 120181 12国债开18, 120003 重工转债, etc.

5.5 报告期末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

5.6 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

5.7 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权证投资明细

5.8 本报告期末本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

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1110018 国电转债, 113002 工行转债, etc.

5.8.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.2 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.3 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.4 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.5 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.6 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.7 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.8 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.9 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.10 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.11 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.12 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.13 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.14 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.15 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.16 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.17 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.18 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.19 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.20 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.21 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.22 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.23 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.24 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.25 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.26 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.27 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.28 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.29 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.30 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.31 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.32 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.33 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.34 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.35 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.36 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.37 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.38 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.39 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明. Rows include 曹冀, 林海.

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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定,严格履行基金合同和招募说明书约定,本着诚实信用、勤勉尽责、最大诚信原则,为基金份额持有人谋求利益,在控制风险的基础上,为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

2012年三季度,实体经济依然没有彻底反弹的迹象,货币供应量增速、新增贷款额、PMI、工业增加值、固定资产投资等月度数据中依然没有发现更加乐观、积极的信号和迹象。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入四季度我们认为实体经济运行、政策层面及流动性方面不会出现过多或深层次方面的变动,属于一个延续性或过渡性的时间窗口。

4.6 投资组合报告

4.6.1 报告期末基金资产组合情况

4.6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.6.3 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

4.6.4 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

4.6.5 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权证投资明细

4.6.6 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

4.6.7 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权证投资明细

4.6.8 本报告期末本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

4.6.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

4.6.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1110018 国电转债, 113002 工行转债, etc.

4.6.8.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.6.8.5.1 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.2 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

4.6.8.5.3 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.4 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.5 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.6 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.7 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.8 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.9 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.10 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.11 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.12 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.13 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.14 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.15 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.16 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.17 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.18 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.19 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.20 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.21 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.22 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.23 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.24 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.25 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.26 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.27 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.28 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.29 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.30 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.31 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.32 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.33 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.34 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.35 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.36 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.37 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.38 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.39 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.40 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.41 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.42 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.43 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.44 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.45 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.46 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.47 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.48 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.49 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.50 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.51 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

4.6.8.5.52 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

国泰君安沪深300指数证券投资基金

2012 第三季度报告

目前,股指已由低点向上反弹,市场人气有所恢复,资金意愿增强及成交量有所增强,技术指标上也具备了进一步反弹的条件...

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 农林牧渔, 采矿业, 制造业, etc.

5.3 报告期末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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601318 中国平安, 600016 民生银行, etc.

5.4 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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 120181 12国债开18, 120003 重工转债, etc.

5.5 报告期末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

5.6 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

5.7 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权证投资明细

5.8 本报告期末本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

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1110018 国电转债, 113002 工行转债, etc.

5.8.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.2 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.3 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.4 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.5 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.6 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.7 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.8 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.9 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.10 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.11 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.12 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.13 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.14 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.15 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.16 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.17 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.18 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.19 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.20 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.21 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.22 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.23 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.24 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.25 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.26 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.27 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.28 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.29 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.30 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.31 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.32 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.33 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.34 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.35 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.36 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.37 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.38 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

5.8.5.39 本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况

国泰保本混合型证券投资基金

2012 第三季度报告

目前,股指已由低点向上反弹,市场人气有所恢复,资金意愿增强及成交量有所增强,技术指标上也具备了进一步反弹的条件...

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 农林牧渔, 采矿业, 制造业, etc.

5.3 报告期末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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601318 中国平安, 600016 民生银行, etc.

5.4 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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 120181 12国债开18, 120003 重工转债, etc.

5.5 报告期末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

5.6 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

5.7 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权证投资明细

5.8 本报告期末本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

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

国泰君安保本混合型证券投资基金

2012 第三季度报告

目前,股指已由低点向上反弹,市场人气有所恢复,资金意愿增强及成交量有所增强,技术指标上也具备了进一步反弹的条件...

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 固定收益投资, etc.