

国泰双利债券证券投资基金

[illegible]

国泰区位优势股票型证券投资基金

[illegible]

国泰沪深300指数证劵投资基金

[illegible]

国泰沪深300指数证劵投资基金

二 度 报 告

5.5.2 指数投资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	21,639,166.46	0.55
B	采矿业	277,378,671.74	6.99
C	制造业	1,227,908,207.42	30.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,684,348.22	2.41
E	建筑业	140,182,009.61	3.53
F	批发和零售业	87,765,331.30	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	76,926,658.86	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,214,669.88	1.90
J	金融业	1,207,965,498.05	30.45
K	房地产业	199,503,649.30	5.03
L	租赁和商务服务业	22,493,603.74	0.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,082,537.89	0.53
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	8,980,838.50	0.23
S	综合	47,872,962.56	1.21
合计		3,510,598,143.27	88.49

5.5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名指数投资明细和前五名指数投资明细

5.5.3.1 期末指数投资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	600016	民生银行	19,929,339	153,656,149.23	3.87
2	600036	招商银行	10,932,334	126,815,074.40	3.20
3	601318	中国平安	2,545,538	88,482,900.88	2.23
4	601166	兴业银行	5,970,123	88,178,716.71	2.22
5	000002	万科A	7,526,412	74,135,158.20	1.87
6	600000	浦发银行	8,948,886	74,096,776.08	1.87
7	600519	贵州茅台	310,061	59,646,434.57	1.50
8	600837	海通证券	6,269,198	58,805,077.24	1.48
9	601328	交通银行	13,070,957	53,198,794.99	1.34
10	600030	中信证券	5,199,633	52,672,282.29	1.33

5.5.3.2 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600332	广州药业	390,425	13,375,960.50	0.34
2	002450	康得新	407,650	11,406,047.00	0.29
3	601991	大唐发电	2,011,400	13,398,596.00	0.26
4	600060	海信电器	589,990	6,129,196.10	0.15
5	000963	华东医药	153,432	6,114,265.20	0.15

5.5.4 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	-	-
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,546,592.60	0.11
8	其他	-	-
9	合计	4,546,592.60	0.11

5.5.5 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	110018	国电转债	28,960	3,112,620.80	0.08
2	113002	工行转债	13,110	1,433,971.80	0.04

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

5.5.2 指数投资按期限结构划分的投资政策

本基金采用期限投资策略,即:本基金投资股指期货时,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、交易活跃的近月合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对市场供求和期货市场行情走势的研究,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。

5.9 股指期货投资情况

5.9.1 期末报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体 除“中国平安”外,其余公司均没有被监管部门立案调查或报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

④根据2013年5月21日中国证券监督管理委员会公告,该上市公司平安证券股份有限公司(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“证监会”)行政处罚决定书,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收违法所得,同时没收违法所得,同时没收违法所得。

5.11 资产的流动性,暂停其保本基金资格6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投资组合,而后进行了投资,并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后,本基金管理人就贵州茅台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行为对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响,对该公司股票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。

②根据2013年2月21日贵州茅台发布的相关公告,该上市公司控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》(黔价字[2013]1号),该决定书认为:贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的价格最低折扣进行限定,违反《中华人民共和国价格法》第十三条的规定。