长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

【2012】第二季度报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2012年07月20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2012年7月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信中证中央企业100指数(LOF)
基金主代码	163001
交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年03月26日
报告期末基金份额总额	98,898,933.47份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证中央企业100指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化进行相应的调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	中证中央企业100指数收益率＊95%+银行同行业存款收益率＊5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险特征的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
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

主要财务指标	报告期(2012年04月01日-2012年06月30日)
1.本期已实现收益	-303,551.36
2.本期利润	791,111.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079
4.期末基金资产净值	79,267,372.78
5.期末基金份额净值	0.801

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；

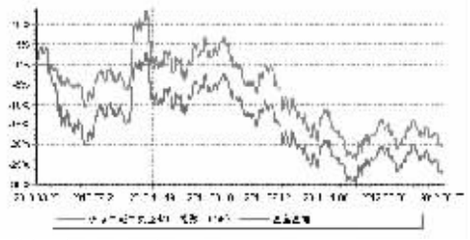
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	0.88%	0.97%	-0.37%	0.96%	1.25%	0.01%

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



注：1、图示日期为2010年3月26日至2012年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定；本基金投资于股票资产的比例占基金资产的90%-95%，其中，中证中央企业100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

§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		
胡倩	本基金的基金经理、长信量化先锋股票型证券投资基金的基金经理、金融工程部副总监	2011年9月21日	-	11年	经济学博士，上海财经大学世界经济专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾先后担任海通证券股份有限公司研究所分析师、高级分析师、首席分析师、金融工程部负责人等职务。2010年5月加入长信基金管理有限公司，担任金融工程部副总监，负责量化投资研究工作。现兼任本基金和长信量化先锋股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额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

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金日均跟踪误差0.072%，年化跟踪误差1.13%，符合基金合同约定。根据基金合同，本基金的投资目标主要为跟踪中证央企100指数。其跟踪误差来源主要在以下几个方面：指数中成份股的调整、申购赎回及由于标的指数成份股中存在法律法规禁止本基金投资的股票而需寻求替代股票所造成的影响。在本报告期内，日常基金申购和赎回的交易成本对本基金的收益产生了一定的负面影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，本基金单位净值为0.801元，本报告期内本基金净值增长率为0.88%，同期业绩比较基准涨幅为-0.37%，央企指数涨幅为-0.42%。

本报告期内，本基金相对于央企100指数的日均跟踪偏离度为0.0234%，年化跟踪误差为1.13%。

§5 投资组合报告

5.1 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	73,570,217.23	92.20
	其中：股票	73,570,217.23	92.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,639,819.06	7.07
6	其他各项资产	587,479.99	0.74
7	合计	79,797,516.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（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	-	-
B	采掘业	8,890,356.51	11.22
C	制造业	13,849,801.13	17.47
C0	食品、饮料	121,631.68	0.15
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	191,746.31	0.24
C5	电子	783,855.52	0.99
C6	金属、非金属	4,366,927.02	5.51
C7	机械、设备、仪表	6,743,199.45	8.51
C8	医药、生物制品	1,642,441.15	2.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,217,015.32	5.32
E	建筑业	4,596,770.89	5.80
F	交通运输、仓储业	2,187,012.73	2.76
G	信息技术业	2,744,965.44	3.46
H	批发和零售贸易	588,819.89	0.74
I	金融、保险业	26,735,122.58	33.73
J	房地产业	6,349,616.10	8.01
K	社会服务业	1,734,942.48	2.19
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	407,624.16	0.51
	合计	72,302,047.23	91.21

5.2.2 报告期末（积极投资）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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	686,090.00	0.87
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	582,080.00	0.73
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,268,170.00	1.60

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600036	招商银行	502,029	5,482,156.68	6.92
2	601328	交通银行	930,599	4,224,919.46	5.33
3	600030	中信证券	280,861	3,547,274.43	4.48
4	000002	万　科A	395,975	3,528,137.25	4.45
5	601088	中国神华	134,226	3,017,400.48	3.81
6	601601	中国太保	128,771	2,856,140.78	3.60
7	601398	工商银行	622,021	2,456,982.95	3.10
8	601288	农业银行	839,666	2,174,734.94	2.74
9	601668	中国建筑	614,373	2,052,005.82	2.59
10	600048	保利地产	173,562	1,968,193.08	2.48

5.3.2 积极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	601669	中国水电	157,000	686,090.00	0.87
2	601336	新华保险	17,000	582,080.00	0.73

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本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或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	284,104.41
4	应收利息	1,149.81
5	应收申购款	52,225.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	587,479.99

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	101,276,990.83
本报告期基金总申购份额	2,806,888.08
减：本报告期基金总赎回份额	5,184,945.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	98,898,933.47

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件；

2、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；

6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

7.2 存放地点

基金管理人的住所。

7.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：http://www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司
2012年7月20日

国泰沪深300指数证券投资基金

【2012】第二季度报告

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：二〇一二年七月二十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰沪深300指数
基金主代码	020011
交易代码	020011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年11月11日
报告期末基金份额总额	10,158,542,086.11份
投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%，实现对沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为以完全复制为目标的指数基金，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合；当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	90%×沪深300指数收益率+10%×银行同业存款收益率。
风险收益特征	本基金属于中高风险的证券投资基金品种。
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

§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

主要财务指标	报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-88,880,564.19
2.本期利润	58,976,986.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0056
4.期末基金资产净值	5,141,989,968.59
5.期末基金份额净值	0.506

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。

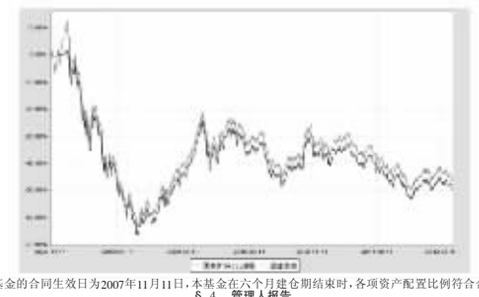
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	1.20%	1.03%	0.30%	1.01%	0.90%	0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

国泰沪深300指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2007年11月11日至2012年6月30日）



注：本基金的合同生效日为2007年11月11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		
章赟	本基金的基金经理、国泰上证180金融ETF、国泰上证180金融ETF联接、国泰中小板300成长ETF、国泰中小板300成长ETF联接的基金经理	2011-5-9	-	6	博士。曾任职于平安资产管理公司。2008年5月加盟国泰基金管理有限公司，任数量金融分析师，2010年3月至2011年5月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理，2011年3月起担任上证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的基金经理；2011年5月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理；2012年3月起兼任中小板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的基金经理。
林海	本基金的基金经理	2011-7-15	-	12	硕士研究生。曾任职于银河证券。2003年7月加入国泰基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。2009年10月至2010年10月任国泰稳健增值混合型资产管理计划的投资经理，2009年11月至2011年2月任国泰隆腾红利灵活配置型-09年第一期资产管理计划的投资经理，2011年4月至2011年6月任财富管理中心投资大使，2011年7月起任国泰沪深300指数基金的基金经理。

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 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

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 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

2012年二季度，沪深300指数先扬后抑呈现倒V型走势，创年内新高后随即逐步回落屡创季度新低并突破了多个主要技术支撑点位。上涨阶段主要源于3月大幅急速下跌的技术性修复、政府预调微调着重保增长的表态及相关放松支持措施以及监管部门有关资本市场的多项政策红利（包括扩大QFII额度、减免相关交易费用、金融改革及创新等），然而负面的经济数据、疲弱的信贷需求加重了资本市场对实体经济、上市公司业绩的悲观预期及上述一系列刺激政策执行实效的忧虑，加之欧洲信用体系危机的反复、美国经济增长不及预期、大宗商品大幅回落等因素，即使出现了降准降息，场内资金仍逐步流出，市场成交量不断萎缩，市场人气极度低迷。

本报告期内，我们根据市场行情分析、判断以及日常申赎情况，对股票仓位及头寸进行了合理安排；在交易策略上，我们严格根据基金契约全面跟踪沪深300指数，避免不必要的主动操作，减少了交易冲击成本。报告期内，本基金组合状况跟踪效果如下：

①日跟踪偏差TD平均为0.0069%，范围在-0.1292%--0.2173%之间；

②截至报告日，日均跟踪误差TE稳定在0.058%。

跟踪误差TE低于基金合同规定的0.35%。TD和TE变化相对稳定，表明本基金所采用的跟踪技术稳定可靠。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金在2012年二季度的净值增长率为1.20%，同期业绩比较基准收益率为0.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

信贷需求及经济基本面尚未得到触底企稳的印证，资金参与情绪不高，上市公司中报业绩和经济数据的不确定性及负面预期可能使市场继续保持谨慎，然而政府及监管层面出台更多的扶持政策及货币管控持续放松的概率较大；外围环境的冲击也已逐步消化，在一定程度上有利于缓解投资者的悲观情绪及市场的承跌动能。

在通胀下行，前期政策扶持累积及货币供应放松的作用下，随着上市公司业绩下滑的风险逐步释放以及实体经济逐步触底企稳的情况下，三季度中后期大盘出现阶段性回调上涨的概率较大，届时市场的整体运行态势及投资者的参与热情将有所好转。

沪深300这一中国经济最具代表性的指数的长期增长空间不言而喻。基于长期投资、价值投资的理念，投资者可积极利用沪深300指数基金这一优良的资产配置工具，把握中国经济长期增长机会。

§5 投资组合报告

5.1 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	4,813,032,095.79	93.04
	其中：股票	4,813,032,095.79	93.04
2	固定收益投资	133,558,582.10	2.58
	其中：债券	133,558,582.10	2.58
	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	213,675,554.27	4.13
6	其他各项资产	13,052,656.44	0.25
7	合计	5,173,318,888.60	100.00

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

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	采掘业	3,344,851.00	0.07
C	制造业	36,951,764.87	0.72
C0	食品、饮料	2,160,120.30	0.04
C1	纺织、服装、皮毛	1,401,022.10	0.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,786,068.70	0.17
C5	电子	16,586,387.00	0.32
C6	金属、非金属	5,791,600.37	0.11
C7	机械、设备、仪表	2,226,566.40	0.04
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,290,837.00	0.49
E	建筑业	14,784,206.85	0.29
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	5,914,259.13	0.12
I	金融、保险业	8,659,221.48	0.17
J	房地产业	8,570,849.52	0.17
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	1,845,560.00	0.04
M	综合类	-	-
	合计	105,361,549.85	2.05

5.2.2 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	29,072,408.52	0.57
B	采掘业	497,148,084.11	9.67
C	制造业	1,658,561,561.71	32.26
C0	食品、饮料	361,217,629.00	7.02
C1	纺织、服装、皮毛	14,013,732.35	0.27
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	89,225,638.22	1.74
C5	电子	52,970,418.63	1.03
C6	金属、非金属	393,623,417.11	7.66
C7	机械、设备、仪表	519,393,098.38	10.10
C8	医药、生物制品	226,529,006.76	4.41
C99	其他制造业	1,588,621.26	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	105,455,243.18	2.05
E	建筑业	135,292,380.79	2.63
F	交通运输、仓储业	131,247,148.39	2.55
G	信息技术业	141,525,719.89	2.75
H	批发和零售贸易	125,240,422.02	2.44
I	金融、保险业	1,488,042,195.31	28.94
J	房地产业	264,944,917.39	5.15
K	社会服务业	42,536,863.52	0.83
L	传播与文化产业	10,034,761.96	0.20
M	综合类	78,568,839.15	1.53
	合计	4,707,670,545.94	91.55

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积极投资明细

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	601318	中国平安	3,393,221	155,205,928.54	3.02
2	600036	招商银行	12,542,994	136,969,494.48	2.66
3	600016	民生银行	22,866,055	136,967,669.45	2.66
4	601328	交通银行	23,222,644	105,430,803.76	2.05
5	600519	贵州茅台	424,009	101,401,752.35	1.97
6	601166	兴业银行	7,636,507	99,121,860.86	1.93
7	600000	浦发银行	11,350,660	92,280,865.80	1.79
8	600030	中信证券	7,007,939	88,510,269.57	1.72
9	000002	万　科A	9,796,572	87,287,456.52	1.70
10	600837	海通证券	8,205,055	79,014,679.65	1.54

5.3.2期末积极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	600011	华能国际	3,921,060	25,290,837.00	0.49
2	002081	金　螳　螂	275,196	10,457,448.00	0.20
3	000046	泛海建设	1,917,416	8,570,849.52	0.17
4	002241	歌尔声学	231,800	8,458,382.00	0.16
5	000725	京东方A	4,255,500	8,128,005.00	0.16

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	120,032,000.00	2.33
	其中：政策性金融债	120,032,000.00	2.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,526,582.10	0.26
8	其他	-	-
9	合计	133,558,582.10	2.60

5.5 报告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

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	110239	11国开39	1,000,000	100,020,000.00	1.95
2	110242	11国开42	200,000	20,012,000.00	0.39
3	113003	重工转债	84,680	8,840,592.00	0.17
4	110018	国电转债	28,960	3,257,131.20	0.06
5	113002	工行转债	13,110	1,428,858.90	0.03

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,314,371.40
4	应收利息	1,860,585.05
5	应收申购款	1,377,699.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,052,656.44

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110018	国电转债	3,257,131.20	0.06
2	113002	工行转债	1,428,858.90	0.03

5.8.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	10,405,990,940.48
本报告期基金总申购份额	946,984,116.02
减：本报告期基金总赎回份额	1,194,432,970.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,158,542,086.11

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于核准国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复

2、国泰沪深300指数证券投资基金基金合同

3、国泰沪深300指数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

7.2 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。

7.3 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
二〇一二年七月二十日

国泰双利债券证券投资基金

【2012】第二季度报告

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：二〇一二年七月二十日

§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2012年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰双利债券
基金主代码	020019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月11日
报告期末基金份额总额	1,606,307,715.13份
投资目标	通过主要投资于债券等固定收益类品种，在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，力争为基金份额持有人谋求较高的当期收入和投资总回报。
投资策略