

国泰事件驱动策略混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

基金简称：国泰事件驱动策略混合型证券投资基金

基金代码：002003 基金托管人：中国建设银行股份有限公司 报告送出日期：二〇一七年四月二十二日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在任何异议，但对其中陈述或重大遗漏，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基金合同的约定，于2017年4月20日核发了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等项，保证本基金净值计算符合有关规定，但不保证基金一定盈利。

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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资人须谨慎投资。

基金合同由基金管理人和投资人共同制定。

本报告期无利润分配。

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：二〇一七年四月二十二日

5.2 基金产品概况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 油、气、公共事业	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	76,140,461.76	75.69	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	8,446,723.64	8.49	-
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	476,715.76	0.48	-
J 金融业	-	-	-
K 房屋、构筑物	-	-	-
L 机械设备	-	-	-
M 科学研究、技术服务与地质勘查业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
O 国际服务、租赁和商务服务业	-	-	-
P 教育	-	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	4,068,000.00	4.08	-
S 综合	-	-	-
合计	88,123,902.16	88.64	-

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

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	002210	东方园林	528,912	8,446,723.64	8.49
2	300356	神雾环保	218,000	7,630,000.00	7.07
3	002217	合力泰	322,200	6,373,856.00	6.40
4	600622	中天科技	440,093	6,198,672.00	6.21
5	600407	亨通光电	98,947	6,124,874.72	6.15
6	300296	利源精制	120,500	4,936,690.00	4.96
7	000140	深物业A	140,000	4,881,800.00	4.90
8	600066	中国国药	172,500	4,077,000.00	4.10
9	300140	天房发展	200,000	4,066,000.00	4.08
10	300146	中金环境	140,000	3,973,200.00	3.99

6.4 报告期末持有的各种类型的债券投资组合

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 共同基金 - -

3 企业债券 - -

4 债券回购 - -

5 资产支持证券 - -

6 短期投资 - -

7 可转换债券 - -

8 其他 - -

9 合计 37,003.44 0.04

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 128001 内购国债 296 31,723.44 0.03

2 110001 航信国债 60 6,210.00 0.01

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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及权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

6.8 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

6.9 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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

6.10 其他资产 - -

6.11 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 128001 内购国债 31,723.44 0.03

2 110001 航信国债 6,210.00 0.01

6.12 报告期末持有的处于停牌期间的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

6.13 报告期内通过港股通交易的股票情况

本基金本报告期末未通过港股通交易。

6.14 报告期内通过沪港通交易的股票情况

本基金本报告期末未通过沪港通交易。

6.15 报告期内通过深港通交易的股票情况

本基金本报告期末未通过深港通交易。

6.16 报告期末持有的其他金融工具

本基金本报告期末未持有其他金融工具。

6.17 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.18 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.19 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.20 报告期末持有的股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资组合。

6.21 报告期末持有的国债期货投资组合

本基金本报告期末未持有国债期货投资组合。

6.22 报告期末持有的其他金融工具组合

本基金本报告期末未持有其他金融工具组合。

6.23 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.24 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.25 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.26 报告期末持有的股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资组合。

6.27 报告期末持有的国债期货投资组合

本基金本报告期末未持有国债期货投资组合。

6.28 报告期末持有的其他金融工具组合

本基金本报告期末未持有其他金融工具组合。

6.29 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.30 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.31 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.32 报告期末持有的股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资组合。

6.33 报告期末持有的国债期货投资组合

本基金本报告期末未持有国债期货投资组合。

6.34 报告期末持有的其他金融工具组合

本基金本报告期末未持有其他金融工具组合。

6.35 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.36 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.37 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.38 报告期末持有的股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资组合。

6.39 报告期末持有的国债期货投资组合

本基金本报告期末未持有国债期货投资组合。

6.40 报告期末持有的其他金融工具组合

本基金本报告期末未持有其他金融工具组合。

6.41 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.42 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.43 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.44 报告期末持有的股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资组合。

6.45 报告期末持有的国债期货投资组合

本基金本报告期末未持有国债期货投资组合。

6.46 报告期末持有的其他金融工具组合

本基金本报告期末未持有其他金融工具组合。

6.47 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.48 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.49 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.50 报告期末持有的股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资组合。

6.51 报告期末持有的国债期货投资组合

本基金本报告期末未持有国债期货投资组合。

6.52 报告期末持有的其他金融工具组合

本基金本报告期末未持有其他金融工具组合。

6.53 报告期末持有的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

6.54 报告期末持有的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

6.55 报告期末持有的权证及权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证及权证投资组合。

6.56 报告