

# 国泰金色年华股票型养老金 2015 年第 2 季度报告

(报告期间：2015 年 4 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日)

## 一、产品基本情况

产品名称：国泰金色年华股票型养老金
产品代码：02A001
产品起始投资日期：2014-7-14
投资管理人：国泰基金管理有限公司
托管人：中国建设银行股份有限公司
注册登记人：国泰基金管理有限公司

## 二、产品管理情况

### (一) 履职情况

在报告期内，遵守《企业年金基金管理办法》(人社部令 11 号)、《关于企业年金养老金产品有关问题的通知》(人社部发〔2013〕24 号)及其他有关法律、法规和基金合同的约定；履行应尽义务情况。

### (二) 重大事项说明

无。

## 三、产品投资情况

### (一) 产品资产净值和收益情况

产品资产净值 (元)		资产份额 (份)		单位净值 (元)		报告期内 投资收益 (元)	报告期 内投资 收益率 (%)	本年以 来投资 收益率 (%)	产品成 立以来 累计收 益率(%)
期初	期 末	期初	期末	期初	期末				
83,984,715.30	126,316,416.63	59,647,632.98	72,189,042.13	1.4080	1.7498	24,112,701.33	24.28	60.19	74.98

(二) 投资资产分布情况

资产种类		市值/摊余成本(元)	占净资产比例 (%)	
一、流动性资产	银行活期存款	47,053,157.61	37.25	49.75
	中央银行票据	-	-	
	一年期以内(含一年)定期存款/协议存款	-	-	
	买入返售金融资产	-	-	
	货币市场基金	12,003,639.88	9.50	
	清算备付金	3,789,713.94	3.00	
	应收证券清算款	-	-	
	其他流动性资产	-	-	
二、固定收益类资产	一年期以上银行定期存款/协议存款	-	-	6.26
	国债	5,323,987.50	4.21	
	金融债	2,581,219.30	2.04	
	企业(公司)债	-	-	
	短期融资券	-	-	
	中期票据	-	-	
	可转换债	-	-	
	债券基金	-	-	
	保险产品(万能保险、股票投资比例≤30%的投资连结保险)	-	-	
	商业银行理财产品	-	-	
	信托产品	-	-	
	特定资产管理计划	-	-	
	基础设施债权投资计划	-	-	
负债工具	-	-		
其他固定收益类资产	-	-		
三、权益类资产	股票	59,465,981.32	47.08	47.08
	股票基金、混合基金	-	-	
	投资连结保险产品(股票投资比例>30%)	-	-	
	权证(非直接投资)	-	-	
	权益工具	-	-	
	其他权益类资产	-	-	
其他资产	252,594.34	0.20	0.20	

合计	130,470,293.89	103.29
----	----------------	--------

(三) 投资资产明细

1. 股指期货投资情况

1) 本期期末股指期货合约占用的保证金：0 元

2) 本期期末股指期货合约持仓和公允价值变动明细（公允价值为负时以负号填列）

本基金本报告期末未持有股指期货。

2. 股票、基金、债券投资（前五位）

股票序号	股票名称	股票代码	数量	市值（元）	占该养老金产品净资产比例（%）
1	600366	宁波韵升	185,800	6,519,722.00	5.16
2	300197	铁汉生态	151,401	5,454,978.03	4.32
3	600687	刚泰控股	135,357	5,312,762.25	4.21
4	600651	飞乐音响	251,300	5,169,241.00	4.09
5	600114	东睦股份	260,222	4,673,587.12	3.70
基金序号	基金名称	基金代码	数量	市值（元）	占该养老金产品净资产比例（%）
1	511990	华宝添益	120,040.00	12,003,639.88	9.50
债券序号	债券名称	债券代码	数量	市值/摊余成本（元）	占该养老金产品净资产比例（%）
1	010107	21 国债(7)	50,250	5,323,987.50	4.21
2	018001	国开 1301	25,190	2,581,219.30	2.04

3. 新增投资品种资产投资（前五位）

无。

(四) 报告期间产品收益分配情况（如有）

无。

四、投资分析

(一) 市场分析及投资回顾与展望

2015年2季度,市场整体表现强劲,主要指数均有较好涨幅,但6月中旬后指数出现了剧烈下跌调整。2季度沪深300指数上涨10.41%,中小板指数上涨15.32%,创业板指数上涨22.42%。从行业指数涨幅来看,轻工、国防军工、交通运输涨幅靠前,金融、有色、建筑等行业涨幅靠后。

2季度,经济正在探底,库存去化,需求不济的情况仍在继续。积极一面是价格方面已经看到一些改善的迹象。4月30日政治局会议定调稳增长,5、6月稳增长政策高强度快节奏出炉。目前判断二季度GDP为6.9%(环比已经较1季度有较大改善,但去年同期基数较高,拖累同比)。三季度GDP有望回升。

2季度,本产品在4-5月份权益部分采取了相对积极的仓位策略,6月末市场剧烈下跌,产品及时做了减仓操作。产品个股持仓相对稳定,坚持以稳定成长个股为主。

## (二) 项目运行管理情况

监管层面收紧配资引发了股市剧烈下跌,但政府关键时刻强力政策支持给予市场巨大信心。经过6月中旬以来的剧烈杀跌,市场风险已得到一定释放,但市场信心受挫较深,恢复也需时日,预计3季度市场以震荡整固为主。操作上产品会适当降低仓位,个股延续稳定成长风格,集中持有一些基本面良好有业绩支撑的个股,同时减持有泡沫和题材类个股。3季度将重点关注前期被大幅杀跌但有业绩支撑的弹性品种。

## 五、其他需要说明的情况

### (一) 份额持有人个数

份额持有人个数(个)	
期初	期末
16	17

(二) 其他  
无。

## 六、声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表及附件真实、准确、完整。

国泰基金管理有限公司

2015年7月14日