

国泰沪深 300 指数证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

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：二〇一二年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6	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.....	42
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8	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.....	43

7.9	投资组合报告附注.....	43
8	基金份额持有人信息.....	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
9	开放式基金份额变动.....	44
10	重大事件揭示.....	44
10.1	基金份额持有人大会决议.....	44
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4	基金投资策略的改变.....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8	其他重大事件.....	46
11	备查文件目录.....	46
11.1	备查文件目录.....	46
11.2	存放地点.....	47
11.3	查阅方式.....	47

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰沪深300指数证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	10,158,542,086.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	唐州徽

	联系电话	021-38561600 转	010-66594855
	电子邮箱	xinxipi lu@gtfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		(021) 38569000, 400-888-8688	95566
传真		021-38561800	010-66594942
注册地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		陈勇胜	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中 心	上海市世纪大道 100 号上海环球金 融中心 39 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-208,985,538.26
本期利润	273,241,182.56
加权平均基金份额本期利润	0.0260
本期加权平均净值利润率	5.00%
本期基金份额净值增长率	5.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,954,653,140.28
期末可供分配基金份额利润	-0.1924
期末基金资产净值	5,141,989,968.59

期末基金份额净值	0.506
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-49.35%

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. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

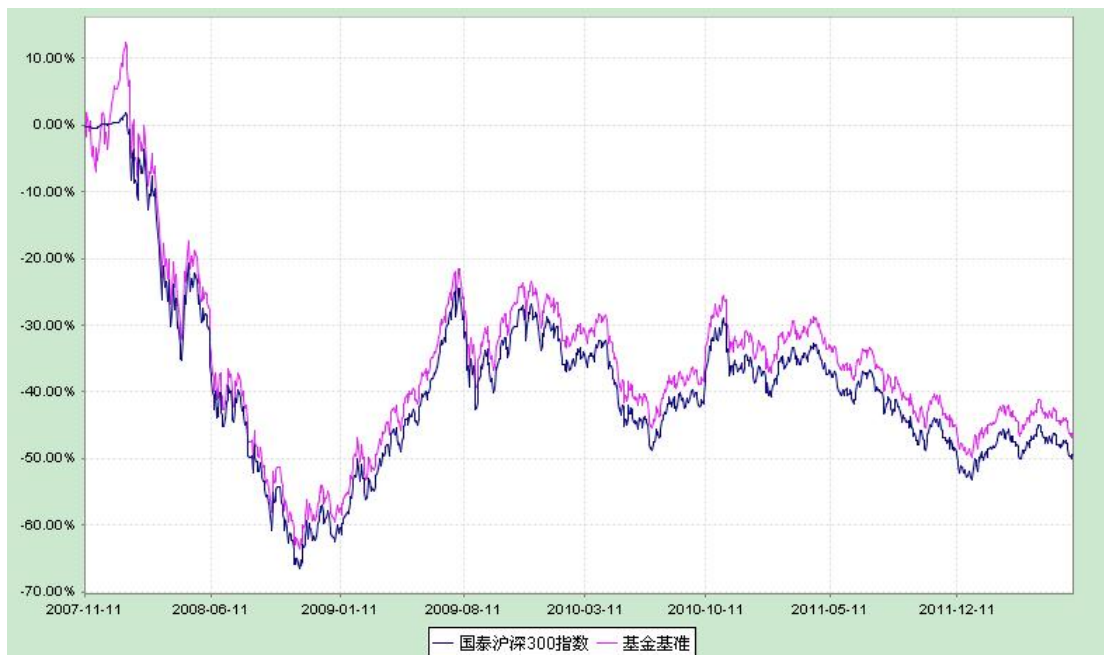
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.24%	1.00%	-5.83%	0.98%	0.59%	0.02%
过去三个月	1.20%	1.03%	0.30%	1.01%	0.90%	0.02%
过去六个月	5.42%	1.23%	4.57%	1.20%	0.85%	0.03%
过去一年	-17.72%	1.26%	-17.17%	1.21%	-0.55%	0.05%
过去三年	-20.44%	1.47%	-19.45%	1.41%	-0.99%	0.06%
自基金合同生效起至今	-49.35%	1.87%	-46.20%	1.84%	-3.15%	0.03%

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

国泰沪深 300 指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 23 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股

票型证券投资基金（LOF）、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、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、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、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
章贇	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	2011-05-09	-	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	2011-07-15	-	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。
徐皓	本基金的基金经理助理、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 联接的基金经理助理	2011-06-03	-	5	硕士，FRM，中级经济师，注册黄金投资分析师。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010 年 5 月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011 年 6 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及国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理助理；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助理。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，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，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 管理人对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 年上半年，资本市场受宏观调控放松预期走出一波上升行情，上证综指最高触及年内高点 2478.38 点，沪深 300 指数涨幅一度超过 15%，后受累经济持续下行担忧及欧债危机持续发酵的不利影响，股指持续走弱，沪深 300 指数最终涨幅 4.9%，整体呈现先扬后抑的走势。

本报告期内，我们根据对市场行情的分析判断以及日常申购赎回情况，对股票仓位及现金头寸进行了合理安排；在交易策略上，我们严格按照基金合同要求实现了对沪深 300 指数

的有效跟踪，避免不必要的主动操作，减少了交易冲击成本。报告期内，本基金的日均跟踪误差为 0.058%，符合基金合同规定的日均跟踪误差不超过 0.35% 的规定。本基金跟踪误差来源主要是成份股分红所带来的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2012 年上半年净值增长率为 5.42%，同期业绩比较基准收益率为 4.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年下半年，信贷需求不足以及经济下行尚未触底企稳，上市公司中报业绩下滑的负面影响和经济数据的不确定性可能使市场继续保持谨慎。然而政府及监管层面出台更多稳增长财政政策及货币政策持续放松的概率较大，外围环境的冲击逐步弱化，在一定程度上有利于缓解投资者的悲观情绪及市场的杀跌动能。

在通胀持续下行以及前期稳增长政策累计作用下，随着上市公司业绩下滑的风险逐步释放以及实体经济触底企稳，预计下半年中后期大盘出现阶段性企稳上涨的概率较大，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。

我们坚信沪深 300 这一中国经济最具代表性的指数的长期增长空间是不言而喻的。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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未

实施的利润。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰沪深 300 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	211,241,415.62	266,148,717.95
结算备付金		2,434,138.65	368,134.53
存出保证金		500,000.00	638,549.12
交易性金融资产	6.4.7.2	4,946,590,677.89	4,803,971,305.38
其中：股票投资		4,813,032,095.79	4,679,152,144.38
基金投资		-	-
债券投资		133,558,582.10	124,819,161.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,860,585.05	1,458,058.20
应收股利		9,314,371.40	-
应收申购款		1,377,699.99	1,249,349.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,173,318,888.60	5,073,834,114.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,860,103.61	-
应付赎回款		5,290,121.81	1,065,249.82
应付管理人报酬		2,224,002.36	2,191,721.46
应付托管费		444,800.48	438,344.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	626,895.49	229,073.78
应交税费		652,003.80	652,003.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,230,992.46	947,314.22
负债合计		31,328,920.01	5,523,707.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,096,643,108.87	7,375,127,278.06
未分配利润	6.4.7.10	-1,954,653,140.28	-2,306,816,870.92
所有者权益合计		5,141,989,968.59	5,068,310,407.14
负债和所有者权益总计		5,173,318,888.60	5,073,834,114.50

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.506 元，基金份额总额

10,158,542,086.11 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		292,635,883.54	-56,739,266.13
1.利息收入		3,449,334.41	2,094,539.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	885,196.65	1,261,089.52
债券利息收入		2,564,137.76	833,450.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-193,654,736.94	-33,400,853.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-254,236,425.80	-87,243,268.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	2,135,259.02
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	60,581,688.86	51,707,156.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	482,226,720.82	-27,465,227.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	614,565.25	2,032,275.27
减：二、费用		19,394,700.98	26,294,417.29
1. 管理人报酬		13,574,963.14	17,149,922.84
2. 托管费		2,714,992.69	3,429,984.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,341,248.52	4,787,731.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	763,496.63	926,778.41
三、利润总额（亏损总额以“-”		273,241,182.56	-83,033,683.42

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		273,241,182.56	-83,033,683.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,375,127,278.06	-2,306,816,870.92	5,068,310,407.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	273,241,182.56	273,241,182.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-278,484,169.19	78,922,548.08	-199,561,621.11
其中：1. 基金申购款	887,942,880.38	-220,913,239.45	667,029,640.93
2. 基金赎回款	-1,166,427,049.57	299,835,787.53	-866,591,262.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,096,643,108.87	-1,954,653,140.28	5,141,989,968.59
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,479,859,022.19	-859,441,068.15	7,620,417,954.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-83,033,683.42	-83,033,683.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,420,836,912.10	93,774,567.06	-1,327,062,345.04
其中：1. 基金申购款	908,131,003.37	-104,822,167.88	803,308,835.49

2. 基金赎回款	-2,328,967,915.47	198,596,734.94	-2,130,371,180.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,059,022,110.09	-848,700,184.51	6,210,321,925.58

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据原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审议通过的《关于修改〈国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同〉中国泰金象保本基金相关转型条款的议案》，并经中国证监会证监基金字[2007]第 307 号《关于核准国泰金象保本增值证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原国泰金象保本增值混合证券投资基金在保本期满后转型而来。自 2007 年 11 月 11 日起，《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《国泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》和《关于原国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额拆分比例的公告》，本基金于 2007 年 12 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 1.431547301，并于 2007 年 12 月 19 日进行了份额变更登记。

本基金于合同生效后自 2007 年 11 月 16 日至 2007 年 12 月 14 日止期间进行集中申购，共募集净有效集中申购资金 5,938,412,579.14 元。根据《国泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金集中申购期内募集的净有效集中申购资金连同申购资金产生的利息收入 3,606,042.98 元在本基金集中申购期结束后于 2007 年 12 月 19 日按上述拆分后的基金份额净值 1.000 元折算为基金份额，划入基金份额持有人账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等，股票资产投资比例不低于基金资产的

90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%，其中备选成份股投资比例不高于 15%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。本基金的业绩比较基准为：90% X 沪深 300 指数收益率+10% X 银行同业存款收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2012 年 8 月 22 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公

司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	211,241,415.62
定期存款	-
其他存款	-
合计	211,241,415.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	6,012,299,703.33	4,813,032,095.79	-1,199,267,607.54	
债券	交易所市场	12,802,968.75	13,526,582.10	723,613.35
	银行间市场	120,022,600.00	120,032,000.00	9,400.00
	合计	132,825,568.75	133,558,582.10	733,013.35
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,145,125,272.08	4,946,590,677.89	-1,198,534,594.19	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	37,154.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	985.86
应收债券利息	1,821,437.97
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,006.37
其他	-
合计	1,860,585.05

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	626,895.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	626,895.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,247,272.32
应付后端申购费	-
预提费用	208,850.46
应付指数使用费	274,869.68
合计	2,230,992.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,557,466,420.93	7,375,127,278.06
本期申购	1,270,964,719.90	887,942,880.38
本期赎回（以“-”号填列）	-1,669,889,054.72	-1,166,427,049.57
本期末	10,158,542,086.11	7,096,643,108.87

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	944,474,334.98	-3,251,291,205.90	-2,306,816,870.92
本期利润	-208,985,538.26	482,226,720.82	273,241,182.56
本期基金份额交易产生的变动数	-29,281,635.77	108,204,183.85	78,922,548.08
其中：基金申购款	98,681,887.93	-319,595,127.38	-220,913,239.45
基金赎回款	-127,963,523.70	427,799,311.23	299,835,787.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	706,207,160.95	-2,660,860,301.23	-1,954,653,140.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	869,331.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,840.16
其他	5,024.69
合计	885,196.65

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	852,975,940.32
减：卖出股票成本总额	1,107,212,366.12
买卖股票差价收入	-254,236,425.80

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	60,581,688.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	60,581,688.86

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	482,226,720.82
——股票投资	481,955,299.72
——债券投资	271,421.10
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	482,226,720.82

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	600,207.17
转换费收入	14,358.08
合计	614,565.25

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	2,341,248.52
银行间市场交易费用	-
合计	2,341,248.52

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	59,672.34
信息披露费	149,178.12

银行费用	2,247.68
债券账户服务费	9,000.00
数字证书服务费	400.00
指数使用费	542,998.49
合计	763,496.63

注：注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期和本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,574,963.14	17,149,922.84
其中：支付销售机构的客户 维护费	2,537,735.39	1,508,966.23

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,714,992.69	3,429,984.63

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
中国银行扬州营业部	793,142.22	0.01%	2,593,142.22	0.02%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	211,241,415.62	869,331.80	329,823,811.51	1,244,556.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600489	中金黄金	2011-08-18	2012-08-13	非公开发行	24.97	21.52	900,000	22,473,000.00	19,368,000.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2012-05-15	重大事项	8.19	-	-	499,393	4,471,708.59	4,090,028.67	

注：本基金截至 2012 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金属被动式股票指数基金，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。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.26%(2011 年 12 月 31 日：0.09%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等,其余大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	211,241,415.62	-	-	-	211,241,415.62
结算备付金	2,434,138.65	-	-	-	2,434,138.65
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	120,032,000.00	1,428,858.90	12,097,723.20	4,813,032,095.79	4,946,590,677.89
应收利息	-	-	-	1,860,585.05	1,860,585.05
应收股利	-	-	-	9,314,371.40	9,314,371.40

应收申购款	23,284.56	-	-	1,354,415.43	1,377,699.99
资产总计	333,730,838.83	1,428,858.90	12,097,723.20	4,826,061,467.67	5,173,318,888.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19,860,103.61	19,860,103.61
应付赎回款	-	-	-	5,290,121.81	5,290,121.81
应付管理人报酬	-	-	-	2,224,002.36	2,224,002.36
应付托管费	-	-	-	444,800.48	444,800.48
应付交易费用	-	-	-	626,895.49	626,895.49
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	2,230,992.46	2,230,992.46
负债总计	-	-	-	31,328,920.01	31,328,920.01
利率敏感度缺口	333,730,838.83	1,428,858.90	12,097,723.20	4,794,732,547.66	5,141,989,968.59
上年度末2011年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	266,148,717.95	-	-	-	266,148,717.95
结算备付金	368,134.53	-	-	-	368,134.53
存出保证金	138,549.12	-	-	500,000.00	638,549.12
交易性金融资产	120,354,000.00	1,395,690.60	3,069,470.40	4,679,152,144.38	4,803,971,305.38
应收利息	-	-	-	1,458,058.20	1,458,058.20
应收申购款	38,553.72	-	-	1,210,795.60	1,249,349.32
资产总计	387,047,955.32	1,395,690.60	3,069,470.40	4,682,320,998.18	5,073,834,114.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,065,249.82	1,065,249.82
应付管理人报酬	-	-	-	2,191,721.46	2,191,721.46
应付托管费	-	-	-	438,344.28	438,344.28
应付交易费用	-	-	-	229,073.78	229,073.78
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	947,314.22	947,314.22
负债总计	-	-	-	5,523,707.36	5,523,707.36
利率敏感度缺口	387,047,955.32	1,395,690.60	3,069,470.40	4,676,797,290.82	5,068,310,407.14

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日, 本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.60%(2011 年 12 月 31 日: 2.46%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金, 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, 本基金的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。

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 90%。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,813,032,095.79	93.60	4,679,152,144.38	92.32
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	4,813,032,095.79	93.60	4,679,152,144.38	92.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	沪深300指数上升5%	增加约23,653	增加约23,821
	沪深300指数下降5%	减少约23,653	减少约23,821

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 4,803,100,649.22 元，属于第二层级的余额为 143,490,028.67 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 4,656,365,136.62 元，第二层级 147,606,168.76 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时

的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

7.2.2 积极资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	601088	中国神华	3,336,027	74,993,886.96	1.46
12	601601	中国太保	3,181,350	70,562,343.00	1.37
13	000858	五粮液	1,921,517	62,948,896.92	1.22
14	601398	工商银行	15,805,997	62,433,688.15	1.21
15	600111	包钢稀土	1,459,314	57,584,530.44	1.12
16	601288	农业银行	20,744,628	53,728,586.52	1.04
17	601668	中国建筑	15,352,748	51,278,178.32	1.00
18	600048	保利地产	4,339,681	49,211,982.54	0.96
19	000157	中联重科	4,452,652	44,660,099.56	0.87
20	002304	洋河股份	331,542	44,608,976.10	0.87
21	600031	三一重工	3,177,845	44,235,602.40	0.86
22	000651	格力电器	2,119,150	44,184,277.50	0.86
23	601169	北京银行	4,447,839	43,455,387.03	0.85
24	601006	大秦铁路	6,098,521	42,872,602.63	0.83

25	601939	建设银行	9,707,134	40,769,962.80	0.79
26	000001	深发展 A(后更名为 "平安银行")	2,589,175	39,251,893.00	0.76
27	002024	苏宁电器	4,245,352	35,618,503.28	0.69
28	601818	光大银行	12,298,238	34,926,995.92	0.68
29	600900	长江电力	5,011,963	34,081,348.40	0.66
30	600887	伊利股份	1,620,166	33,343,016.28	0.65
31	600015	华夏银行	3,470,010	32,860,994.70	0.64
32	601857	中国石油	3,587,347	32,465,490.35	0.63
33	600104	上汽集团	2,231,760	31,891,850.40	0.62
34	600050	中国联通	8,560,608	31,845,461.76	0.62
35	601899	紫金矿业	7,998,673	31,034,851.24	0.60
36	600585	海螺水泥	2,024,660	30,005,461.20	0.58
37	000568	泸州老窖	706,134	29,876,529.54	0.58
38	600383	金地集团	4,546,083	29,458,617.84	0.57
39	600256	广汇能源	2,131,798	28,715,319.06	0.56
40	601628	中国人寿	1,524,837	27,904,517.10	0.54
41	000063	中兴通讯	1,990,421	27,786,277.16	0.54
42	600999	招商证券	2,385,881	27,700,078.41	0.54
43	600028	中国石化	4,299,574	27,087,316.20	0.53
44	000776	广发证券	901,292	26,885,540.36	0.52
45	000983	西山煤电	1,594,506	24,874,293.60	0.48
46	600518	康美药业	1,560,158	24,057,636.36	0.47
47	600547	山东黄金	720,363	23,656,720.92	0.46
48	000069	华侨城 A	3,687,777	23,528,017.26	0.46
49	601989	中国重工	4,463,690	23,166,551.10	0.45
50	600019	宝钢股份	5,305,066	22,917,885.12	0.45
51	000338	潍柴动力	765,813	22,736,987.97	0.44
52	000527	美的电器	2,055,924	22,717,960.20	0.44
53	600489	中金黄金	1,037,532	22,327,688.64	0.43
54	000792	盐湖股份	645,657	21,803,836.89	0.42
55	600739	辽宁成大	1,370,299	21,376,664.40	0.42
56	000423	东阿阿胶	530,149	21,211,261.49	0.41
57	600795	国电电力	7,804,956	21,073,381.20	0.41
58	600362	江西铜业	842,128	20,135,280.48	0.39
59	000629	攀钢钒钛	2,964,362	19,505,501.96	0.38
60	601699	潞安环能	935,902	19,410,607.48	0.38
61	000895	双汇发展	307,162	19,007,184.56	0.37
62	600690	青岛海尔	1,619,648	18,982,274.56	0.37
63	600348	阳泉煤业	1,218,597	18,644,534.10	0.36
64	600089	特变电工	2,674,107	18,103,704.39	0.35
65	601788	光大证券	1,372,788	18,079,617.96	0.35

66	601009	南京银行	2,112,820	18,001,226.40	0.35
67	600406	国电南瑞	957,983	17,904,702.27	0.35
68	600276	恒瑞医药	623,525	17,901,402.75	0.35
69	601600	中国铝业	2,888,888	17,824,438.96	0.35
70	601688	华泰证券	1,687,007	17,713,573.50	0.34
71	000024	招商地产	695,912	17,070,721.36	0.33
72	601299	中国北车	4,164,367	16,699,111.67	0.32
73	000538	云南白药	280,185	16,609,366.80	0.32
74	601168	西部矿业	1,915,716	16,398,528.96	0.32
75	601766	中国南车	3,578,725	16,318,986.00	0.32
76	000402	金融街	2,444,394	15,961,892.82	0.31
77	000783	长江证券	1,682,477	15,310,540.70	0.30
78	000709	河北钢铁	5,387,032	14,706,597.36	0.29
79	600309	烟台万华	1,096,298	14,635,578.30	0.28
80	601898	中煤能源	1,856,413	14,368,636.62	0.28
81	000100	TCL 集团	6,874,161	13,954,546.83	0.27
82	600068	葛洲坝	2,116,133	13,818,348.49	0.27
83	000630	铜陵有色	714,044	13,781,049.20	0.27
84	601186	中国铁建	3,096,226	13,778,205.70	0.27
85	601390	中国中铁	5,320,564	13,673,849.48	0.27
86	600642	申能股份	2,964,740	13,667,451.40	0.27
87	600100	同方股份	1,612,181	13,574,564.02	0.26
88	600600	青岛啤酒	351,048	13,406,523.12	0.26
89	600660	福耀玻璃	1,708,270	13,358,671.40	0.26
90	000878	云南铜业	712,662	12,756,649.80	0.25
91	600150	中国船舶	553,179	12,706,521.63	0.25
92	000623	吉林敖东	726,617	12,599,538.78	0.25
93	600010	包钢股份	2,581,632	12,598,364.16	0.25
94	000060	中金岭南	1,452,044	12,516,619.28	0.24
95	600123	兰花科创	687,894	12,423,365.64	0.24
96	601958	金钼股份	973,381	12,332,737.27	0.24
97	600009	上海机场	966,240	12,309,897.60	0.24
98	601618	中国中冶	4,886,235	12,117,862.80	0.24
99	601666	平煤股份	1,195,609	12,099,563.08	0.24
100	600549	厦门钨业	273,552	12,011,668.32	0.23
101	600583	海油工程	1,971,784	12,008,164.56	0.23
102	000425	徐工机械	837,302	12,006,910.68	0.23
103	600875	东方电气	669,609	11,999,393.28	0.23
104	000012	南玻 A	1,325,944	11,933,496.00	0.23
105	600196	复星医药	1,148,378	11,839,777.18	0.23
106	002142	宁波银行	1,169,996	11,676,560.08	0.23

107	601117	中国化学	1,997,760	11,527,075.20	0.22
108	000039	中集集团	866,331	11,522,202.30	0.22
109	600535	天士力	262,075	11,457,919.00	0.22
110	600188	兖州煤业	603,335	11,451,298.30	0.22
111	600085	同仁堂	653,841	11,409,525.45	0.22
112	600177	雅戈尔	1,343,797	11,408,836.53	0.22
113	002422	科伦药业	243,097	11,342,906.02	0.22
114	601991	大唐发电	2,011,917	11,327,092.71	0.22
115	601998	中信银行	2,788,753	11,155,012.00	0.22
116	002415	海康威视	408,611	11,114,219.20	0.22
117	600143	金发科技	1,853,317	11,064,302.49	0.22
118	000009	中国宝安	1,097,116	10,971,160.00	0.21
119	600005	武钢股份	4,061,003	10,924,098.07	0.21
120	000581	威孚高科	397,978	10,904,597.20	0.21
121	600369	西南证券	954,226	10,792,296.06	0.21
122	000728	国元证券	984,794	10,744,102.54	0.21
123	000937	冀中能源	702,289	10,723,953.03	0.21
124	601919	中国远洋	2,298,187	10,663,587.68	0.21
125	600415	小商品城	1,366,876	10,661,632.80	0.21
126	600066	宇通客车	473,421	10,633,035.66	0.21
127	600166	福田汽车	1,484,026	10,610,785.90	0.21
128	601111	中国国航	1,724,043	10,602,864.45	0.21
129	600881	亚泰集团	1,917,503	10,546,266.50	0.21
130	600271	航天信息	556,155	10,516,891.05	0.20
131	002155	辰州矿业	538,648	10,428,225.28	0.20
132	601808	中海油服	608,425	10,045,096.75	0.20
133	002202	金风科技	1,559,161	9,994,222.01	0.19
134	600029	南方航空	2,162,848	9,970,729.28	0.19
135	600376	首开股份	749,518	9,923,618.32	0.19
136	600694	大商股份	295,346	9,879,323.70	0.19
137	600153	建发股份	1,372,173	9,824,758.68	0.19
138	600252	中恒集团	895,445	9,814,077.20	0.19
139	600809	山西汾酒	260,081	9,802,452.89	0.19
140	600115	东方航空	2,341,748	9,788,506.64	0.19
141	000768	西飞国际	1,241,842	9,748,459.70	0.19
142	600058	五矿发展	431,260	9,630,035.80	0.19
143	000401	冀东水泥	678,381	9,538,036.86	0.19
144	000625	长安汽车	1,943,539	9,484,470.32	0.18
145	600741	华域汽车	1,047,492	9,396,003.24	0.18
146	000933	神火股份	1,029,983	9,393,444.96	0.18
147	600497	驰宏锌锗	667,552	9,392,456.64	0.18

148	000869	张裕A	138,963	9,346,651.38	0.18
149	000729	燕京啤酒	1,267,571	9,253,268.30	0.18
150	600395	盘江股份	343,696	9,238,548.48	0.18
151	600655	豫园商城	1,162,698	9,162,060.24	0.18
152	000422	湖北宜化	735,659	9,011,822.75	0.18
153	000960	锡业股份	454,665	8,956,900.50	0.17
154	000800	一汽轿车	819,088	8,895,295.68	0.17
155	600832	东方明珠	1,655,202	8,888,434.74	0.17
156	000758	中色股份	461,431	8,753,346.07	0.17
157	000999	华润三九	392,536	8,576,911.60	0.17
158	002106	莱宝高科	423,176	8,493,142.32	0.17
159	600259	广晟有色	127,863	8,430,007.59	0.16
160	000528	柳工	678,941	8,425,657.81	0.16
161	600649	城投控股	1,156,299	8,348,478.78	0.16
162	601333	广深铁路	2,838,099	8,344,011.06	0.16
163	600779	水井坊	343,021	8,325,119.67	0.16
164	601717	郑煤机	717,173	8,319,206.80	0.16
165	601106	中国一重	2,628,135	8,304,906.60	0.16
166	601607	上海医药	772,108	8,238,392.36	0.16
167	000825	太钢不锈	2,333,022	8,235,567.66	0.16
168	000876	新希望	534,753	8,010,599.94	0.16
169	600804	鹏博士	1,343,198	7,978,596.12	0.16
170	600219	南山铝业	1,185,137	7,940,417.90	0.15
171	600125	铁龙物流	936,290	7,939,739.20	0.15
172	002385	大北农	409,029	7,935,162.60	0.15
173	600703	三安光电	582,014	7,921,210.54	0.15
174	600839	四川长虹	3,710,579	7,829,321.69	0.15
175	600208	新湖中宝	1,867,801	7,714,018.13	0.15
176	002001	新和成	364,371	7,699,159.23	0.15
177	600588	用友软件	500,676	7,640,315.76	0.15
178	600320	振华重工	1,777,544	7,501,235.68	0.15
179	601888	中国国旅	265,123	7,481,771.06	0.15
180	002038	双鹭药业	229,529	7,390,833.80	0.14
181	600267	海正药业	422,791	7,390,386.68	0.14
182	600811	东方集团	1,341,075	7,349,091.00	0.14
183	601001	大同煤业	670,081	7,337,386.95	0.14
184	002092	中泰化学	944,126	7,222,563.90	0.14
185	000898	鞍钢股份	1,851,919	7,222,484.10	0.14
186	600372	中航电子	396,541	7,133,772.59	0.14
187	600893	航空动力	548,181	7,131,834.81	0.14
188	002007	华兰生物	289,716	7,121,219.28	0.14

189	002310	东方园林	120,437	7,070,856.27	0.14
190	601101	昊华能源	409,051	7,002,953.12	0.14
191	601179	中国西电	1,752,985	6,976,880.30	0.14
192	600108	亚盛集团	1,413,592	6,969,008.56	0.14
193	600216	浙江医药	276,969	6,965,770.35	0.14
194	601918	国投新集	557,190	6,803,289.90	0.13
195	600266	北京城建	447,350	6,795,246.50	0.13
196	000718	苏宁环球	824,011	6,674,489.10	0.13
197	600895	张江高科	777,825	6,665,960.25	0.13
198	600331	宏达股份	828,148	6,658,309.92	0.13
199	601018	宁波港	2,621,944	6,633,518.32	0.13
200	600062	华润双鹤	345,627	6,594,563.16	0.13
201	000061	农产品	1,134,562	6,580,459.60	0.13
202	600997	开滦股份	620,355	6,495,116.85	0.13
203	600674	川投能源	938,517	6,494,537.64	0.13
204	000778	新兴铸管	962,358	6,438,175.02	0.13
205	000839	中信国安	948,252	6,372,253.44	0.12
206	000969	安泰科技	520,479	6,365,458.17	0.12
207	600664	哈药股份	965,895	6,365,248.05	0.12
208	600718	东软集团	738,959	6,362,436.99	0.12
209	600859	王府井	231,855	6,343,552.80	0.12
210	601866	中海集运	2,464,437	6,235,025.61	0.12
211	600863	内蒙华电	780,600	6,166,740.00	0.12
212	002146	荣盛发展	562,528	6,131,555.20	0.12
213	600550	天威保变	688,243	6,008,361.39	0.12
214	600352	浙江龙盛	1,036,625	5,939,861.25	0.12
215	002069	獐子岛	284,684	5,935,661.40	0.12
216	600221	海南航空	1,206,284	5,886,665.92	0.11
217	600498	烽火通信	220,974	5,858,020.74	0.11
218	600160	巨化股份	569,838	5,755,363.80	0.11
219	601558	华锐风电	820,817	5,753,927.17	0.11
220	600316	洪都航空	441,165	5,748,379.95	0.11
221	600118	中国卫星	454,360	5,720,392.40	0.11
222	601158	重庆水务	962,277	5,667,811.53	0.11
223	600516	方大炭素	648,115	5,534,902.10	0.11
224	000807	云铝股份	925,789	5,452,897.21	0.11
225	000680	山推股份	932,037	5,452,416.45	0.11
226	601118	海南橡胶	791,123	5,435,015.01	0.11
227	600432	吉恩镍业	408,537	5,425,371.36	0.11
228	600812	华北制药	851,422	5,415,043.92	0.11
229	002299	圣农发展	373,455	5,392,690.20	0.10

230	600508	上海能源	296,611	5,377,557.43	0.10
231	600598	北大荒	716,783	5,340,033.35	0.10
232	002128	露天煤业	401,942	5,257,401.36	0.10
233	601098	中南传媒	543,136	5,203,242.88	0.10
234	600770	综艺股份	445,533	5,114,718.84	0.10
235	600169	太原重工	1,454,122	5,103,968.22	0.10
236	600170	上海建工	703,455	5,078,945.10	0.10
237	600970	中材国际	439,713	5,074,288.02	0.10
238	002073	软控股份	597,092	5,003,630.96	0.10
239	600528	中铁二局	734,874	4,967,748.24	0.10
240	000059	辽通化工	623,853	4,934,677.23	0.10
241	600418	江淮汽车	906,730	4,905,409.30	0.10
242	600500	中化国际	719,838	4,866,104.88	0.09
243	600037	歌华有线	641,636	4,831,519.08	0.09
244	601377	兴业证券	442,880	4,641,382.40	0.09
245	601369	陕鼓动力	492,757	4,562,929.82	0.09
246	002344	海宁皮城	171,803	4,480,622.24	0.09
247	000686	东北证券	257,879	4,420,046.06	0.09
248	000961	中南建设	351,942	4,385,197.32	0.09
249	600546	山煤国际	206,553	4,321,088.76	0.08
250	600109	国金证券	300,166	4,319,388.74	0.08
251	600971	恒源煤电	306,952	4,275,841.36	0.08
252	000780	平庄能源	406,517	4,260,298.16	0.08
253	600595	中孚实业	758,576	4,232,854.08	0.08
254	601992	金隅股份	634,453	4,219,112.45	0.08
255	601933	永辉超市	154,752	4,193,779.20	0.08
256	002500	山西证券	499,393	4,090,028.67	0.08
257	600456	宝钛股份	216,682	4,067,121.14	0.08
258	002431	棕榈园林	156,995	4,048,901.05	0.08
259	000559	万向钱潮	802,199	4,035,060.97	0.08
260	000968	煤气化	264,550	4,034,387.50	0.08
261	002122	天马股份	596,777	3,855,179.42	0.07
262	600873	梅花集团	556,732	3,757,941.00	0.07
263	600183	生益科技	710,287	3,657,978.05	0.07
264	600783	鲁信创投	228,964	3,654,265.44	0.07
265	601718	际华集团	1,155,330	3,650,842.80	0.07
266	000021	长城开发	662,894	3,566,369.72	0.07
267	600096	云天化	267,639	3,548,893.14	0.07
268	002493	荣盛石化	227,139	3,482,040.87	0.07
269	002399	海普瑞	162,196	3,438,555.20	0.07
270	601258	庞大集团	538,452	3,284,557.20	0.06

271	601099	太平洋	451,719	3,116,861.10	0.06
272	002603	以岭药业	112,142	3,089,512.10	0.06
273	600307	酒钢宏兴	825,803	2,865,536.41	0.06
274	002405	四维图新	232,135	2,771,691.90	0.05
275	002378	章源钨业	86,339	2,733,492.74	0.05
276	601233	桐昆股份	298,043	2,604,895.82	0.05
277	601268	二重重装	337,703	2,070,119.39	0.04
278	601216	内蒙君正	262,080	1,826,697.60	0.04
279	002594	比亚迪	79,991	1,588,621.26	0.03
280	600132	重庆啤酒	8,965	193,554.35	0.00

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
6	600315	上海家化	178,191	6,951,230.91	0.14
7	600827	友谊股份	522,923	5,914,259.13	0.12
8	600022	山东钢铁	2,253,541	5,791,600.37	0.11
9	601669	中国水电	990,105	4,326,758.85	0.08
10	601336	新华保险	105,953	3,627,830.72	0.07
11	002353	杰瑞股份	68,966	3,344,851.00	0.07
12	601901	方正证券	632,500	3,213,100.00	0.06
13	601633	长城汽车	125,088	2,226,566.40	0.04
14	002570	贝因美	107,202	2,160,120.30	0.04
15	601928	凤凰传媒	214,600	1,845,560.00	0.04
16	000703	恒逸石化	110,333	1,834,837.79	0.04
17	601555	东吴证券	205,689	1,818,290.76	0.04
18	601566	九牧王	50,306	1,401,022.10	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	601818	光大银行	35,737,099.85	0.71
2	600011	华能国际	24,701,967.81	0.49
3	601288	农业银行	23,307,462.80	0.46
4	600015	华夏银行	14,306,782.70	0.28
5	600016	民生银行	13,286,378.84	0.26
6	601328	交通银行	12,269,699.94	0.24
7	600036	招商银行	11,829,285.57	0.23
8	600000	浦发银行	11,574,479.07	0.23
9	002081	金螳螂	10,519,080.23	0.21
10	000046	泛海建设	8,997,468.88	0.18
11	000157	中联重科	8,653,787.05	0.17
12	601166	兴业银行	8,356,146.67	0.16
13	000725	京东方 A	8,295,845.00	0.16
14	600104	上汽集团	8,231,682.58	0.16
15	601398	工商银行	8,109,325.57	0.16
16	601088	中国神华	8,054,820.79	0.16
17	600519	贵州茅台	7,923,298.97	0.16
18	601318	中国平安	7,869,449.69	0.16
19	002241	歌尔声学	7,862,049.59	0.16
20	000063	中兴通讯	7,683,165.17	0.15

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	20,496,091.32	0.40
2	600036	招商银行	18,927,630.26	0.37
3	601328	交通银行	17,746,978.34	0.35
4	600000	浦发银行	16,614,897.43	0.33
5	601318	中国平安	15,592,484.49	0.31
6	601166	兴业银行	13,737,110.00	0.27
7	601818	光大银行	12,339,740.41	0.24
8	601088	中国神华	12,198,924.91	0.24
9	600519	贵州茅台	12,023,241.67	0.24
10	601727	上海电气	11,808,312.97	0.23
11	601288	农业银行	11,619,450.73	0.23
12	600837	海通证券	10,723,174.28	0.21
13	000002	万科 A	10,223,943.77	0.20
14	601398	工商银行	10,090,945.61	0.20
15	600030	中信证券	9,860,643.27	0.19

16	601899	紫金矿业	9,844,422.03	0.19
17	601601	中国太保	9,180,411.51	0.18
18	000858	五 粮 液	8,949,625.68	0.18
19	600547	山东黄金	8,888,747.30	0.18
20	002155	辰州矿业	8,466,059.63	0.17

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	759,137,017.81
卖出股票的收入（成交）总额	852,975,940.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

7.9.5.1 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。

7.9.5.2 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
253,205	40,119.83	2,260,452,589.40	22.25%	7,898,089,496.71	77.75%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	8,203,661.61	0.08%

注：1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 11 月 11 日）基金份额总额	347,989,794.67
本报告期初基金份额总额	10,557,466,420.93
本报告期基金总申购份额	1,270,964,719.90
减：本报告期基金总赎回份额	1,669,889,054.72
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

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	225,261,187.74	14.05%	191,471.23	16.38%	-
银河证券	1	90,242,504.95	5.63%	73,322.62	6.27%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	341,388,186.80	21.29%	281,628.46	24.09%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	946,523,038.01	59.03%	622,618.64	53.26%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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。

11.3 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
二〇一二年八月二十七日