

国泰沪深 300 指数证券投资基金
2013 年半年度报告
2013 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：二〇一三年八月二十四日

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 2013 年 8 月 20 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 2013 年 1 月 1 日起至 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
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遵规守信情况的说明	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	12
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遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.10 投资组合报告附注	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49

10.1 基金份额持有人大会决议	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件	51
11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录	52
11.2 存放地点	52
11.3 查阅方式	52

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	8,654,902,899.46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	林海中	唐州徽
	联系电话	021-38561600 转	95566

	电子邮箱	xinxipilu@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	田国立

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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-376,388,505.13
本期利润	-482,068,783.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0469
本期加权平均净值利润率	-8.98%
本期基金份额净值增长率	-11.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,078,436,983.59
期末可供分配基金份额利润	-0.2401

期末基金资产净值	3,967,109,396.77
期末基金份额净值	0.458
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-54.15%

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

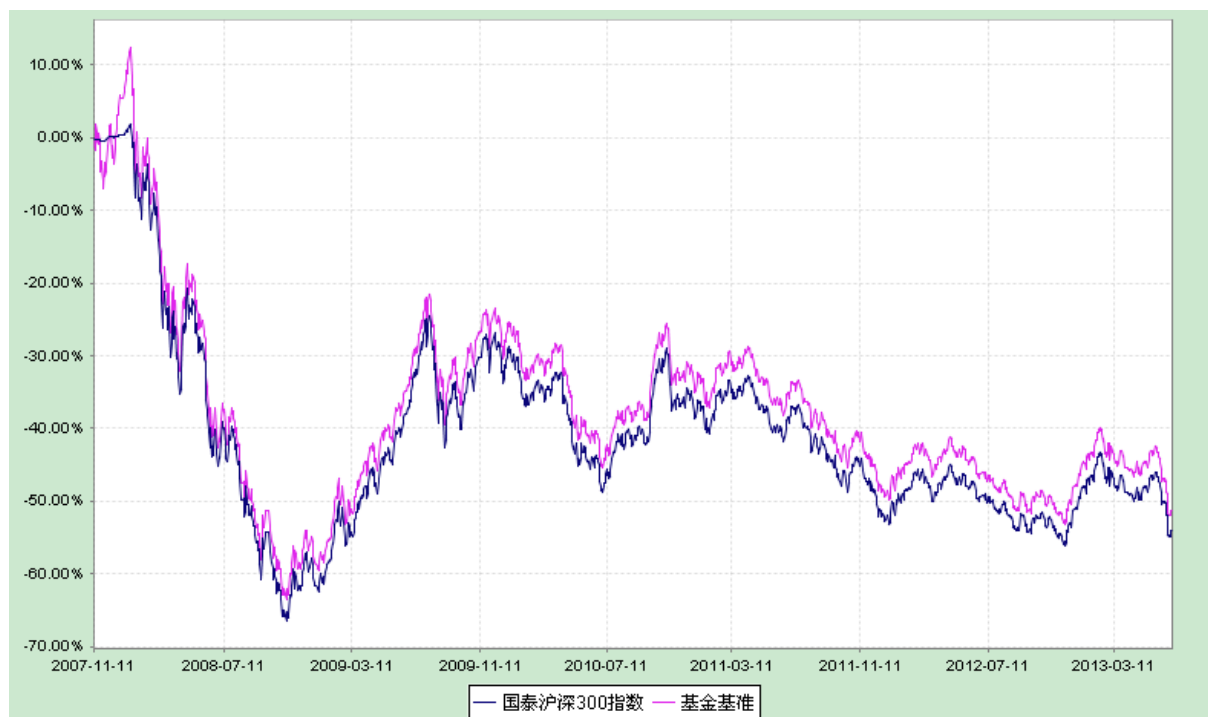
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-14.07%	1.76%	-14.09%	1.68%	0.02%	0.08%
过去三个月	-10.37%	1.36%	-10.62%	1.30%	0.25%	0.06%
过去六个月	-11.58%	1.41%	-11.44%	1.35%	-0.14%	0.06%
过去一年	-9.49%	1.29%	-9.34%	1.23%	-0.15%	0.06%
过去三年	-11.92%	1.29%	-12.09%	1.23%	0.17%	0.06%
自基金成立起至今	-54.15%	1.78%	-51.23%	1.75%	-2.92%	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 2013 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 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 35 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)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金。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人资格。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、国泰国证房地产行业指数分	2011-05-09	-	7	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

	级的基金 经理				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，2013 年 2 月起兼任国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理。
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	-	6	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。公司创

					新 ETF 运作工作小组成员。
--	--	--	--	--	-----------------

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。

（一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 20 ），溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

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 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

2013 年上半年 A 股行情整体呈现冲高回落态势。受新领导层的改革预期推动，大盘延续去年 12 月份以来的反弹行情，上证指数最高触及 2444.80 点，个股出现普涨行情。后受持续低迷的经济指标的不利影响，尤其是受资金面紧张以及 IPO 可能开闸等多重利空因素影响，6 月份 A 股市场大幅下挫，上证指数最低触及 1849.65 点。个股行情出现分化，以 TMT 为主的创业板股票屡创新高，而以传统行业为主的大盘股表现较差。

本报告期内，我们根据对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，我们严格根据基金合同约定，避免不必要的主动操作，减少了交易冲击成本，实现了对标的指数沪深 300 指数的有效跟踪，截止报告日，本基金的日均跟踪误差为 0.057%，日均跟踪误差远低于基金合同规定的 0.35%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2013 年上半年净值增长率为-11.58%，同期业绩比较基准收益率为-11.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年下半年随着美国经济的强劲复苏，预期美联储将逐步收紧货币宽松的政策，QE 退出将只是时间问题，资金外流预期将对资金面形成不利影响。国内经济方面，在银行降杠杆的过程中预期难有明显改善。将于四季度召开的十八届三中全会，将是市场期盼的改革红利。但在市场大幅下挫的情况下，估值屡创新低，未来或有阶段性机会。

行业方面，预计成长性较确定的转型类股票如环保工程与服务、传媒以及消费类股票如电子、食品、医药仍将获得超越市场平均的收益。

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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	270,486,496.58	443,752,648.11
结算备付金		-	-
存出保证金		1,440,243.63	500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	3,586,819,085.17	5,857,304,772.77
其中：股票投资		3,582,272,492.57	5,802,586,124.57
基金投资		-	-
债券投资		4,546,592.60	54,718,648.20

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	110,020,375.01	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	112,534.97	1,279,609.18
应收股利		11,466,677.04	-
应收申购款		1,804,836.68	51,684,361.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	100,000.00
资产总计		3,982,150,249.08	6,354,621,391.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		7,871,060.22	121,494,916.86
应付赎回款		1,591,419.76	4,829,827.23
应付管理人报酬		1,773,947.36	2,259,163.75
应付托管费		354,789.50	451,832.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,200,498.25	965,413.64
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	1,597,133.42	1,131,244.07
负债合计		15,040,852.31	131,784,402.10
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	6,045,546,380.36	8,399,611,225.05
未分配利润	6.4.7.10	-2,078,436,983.59	-2,176,774,235.37
所有者权益合计		3,967,109,396.77	6,222,836,989.68
负债和所有者权益总计		3,982,150,249.08	6,354,621,391.78

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.458元，基金份额总额8,654,902,899.46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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		-460,532,180.11	292,635,883.54
1.利息收入		1,774,693.26	3,449,334.41
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	1,184,560.04	885,196.65
债券利息收入		545,656.25	2,564,137.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		44,476.97	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-358,478,466.85	-193,654,736.94
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-411,486,177.42	-254,236,425.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	1,206,071.43	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	51,801,639.14	60,581,688.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-105,680,278.22	482,226,720.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	1,851,871.70	614,565.25
减：二、费用		21,536,603.24	19,394,700.98
1. 管理人报酬		13,369,960.22	13,574,963.14
2. 托管费		2,673,992.07	2,714,992.69
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.1 8	4,735,046.53	2,341,248.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	757,604.42	763,496.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-482,068,783.35	273,241,182.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-482,068,783.35	273,241,182.56

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	8,399,611,225.05	-2,176,774,235.37	6,222,836,989.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-482,068,783.35	-482,068,783.35
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）	-2,354,064,844.69	580,406,035.13	-1,773,658,809.56
其中：1.基金申购款	450,113,726.00	-116,630,087.52	333,483,638.48
2.基金赎回款	-2,804,178,570.69	697,036,122.65	-2,107,142,448.04
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）	6,045,546,380.36	-2,078,436,983.59	3,967,109,396.77

项目	上年度可比期间		
	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

报表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：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：巴立康

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 2013 年 8 月 20 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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。2013 年 1 月 1 日以前，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(4) 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	270,486,496.58
定期存款	-
其他存款	-
合计	270,486,496.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,607,072,535.19	3,582,272,492.57	-1,024,800,042.62	
债券	交易所市场	4,334,968.75	4,546,592.60	211,623.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,334,968.75	4,546,592.60	211,623.85
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,611,407,503.94	3,586,819,085.17	-1,024,588,418.77

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	110,020,375.01	-
合计	110,020,375.01	-

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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	49,567.60
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	-
应收债券利息	17,890.58
应收买入返售证券利息	44,476.97
应收申购款利息	16.53
其他	583.29
合计	112,534.97

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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,200,123.24
银行间市场应付交易费用	375.01
合计	1,200,498.25

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	901,079.79
应付指数使用费	234,804.91
预提费用	211,248.72
合计	1,597,133.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,023,972,985.88	8,399,611,225.05
本期申购	644,464,931.79	450,113,726.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,013,535,018.21	-2,804,178,570.69
本期末	8,654,902,899.46	6,045,546,380.36

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	743,828,195.67	-2,920,602,431.04	-2,176,774,235.37
本期利润	-376,388,505.13	-105,680,278.22	-482,068,783.35
本期基金份额交易产生的变动数	-152,083,138.84	732,489,173.97	580,406,035.13

其中：基金申购款	31,435,318.97	-148,065,406.49	-116,630,087.52
基金赎回款	-183,518,457.81	880,554,580.46	697,036,122.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	215,356,551.70	-2,293,793,535.29	-2,078,436,983.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,162,078.92
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	9,977.10
其他	12,504.02
合计	1,184,560.04

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,123,558,931.16
减：卖出股票成本总额	2,535,045,108.58
买卖股票差价收入	-411,486,177.42

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	72,973,287.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,036,300.00
减：应收利息总额	1,730,915.97
债券投资收益	1,206,071.43

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 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	51,801,639.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	51,801,639.14

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1.交易性金融资产	-105,680,278.22
——股票投资	-105,551,522.62
——债券投资	-128,755.60
——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	-105,680,278.22

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	1,416,865.26
转换费收入	435,006.44
合计	1,851,871.70

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 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	4,735,046.53
银行间市场交易费用	-
合计	4,735,046.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	62,483.01
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	2,157.33
指数使用费	534,798.37
债券账户服务费	9,000.00
证书费	400.00
合计	757,604.42

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

本基金管理人于 2013 年 5 月 31 日发布《国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告》，本基金管理人获批设立子公司国泰元鑫资产管理有限公司，注册资本为 5000 万元人民币。本基金管理人持有 50% 的股权，中投信托有限责任公司

和上海津赞投资管理有限公司分别持有 30% 和 20% 的股权。国泰元鑫资产管理有限公司已在上海市工商行政管理局虹口分局完成工商注册登记，取得营业执照。

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 2013年1月1日至2013年 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,369,960.22	13,574,963.14
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,908,280.17	2,537,735.39

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,673,992.07	2,714,992.69

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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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%	793,142.22	0.01%

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	270,486,496.58	1,162,078.92	211,241,415.62	869,331.80

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（2013 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

无。

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
000999	华润三九	2013-06-03	重大事项	29.60	2013-08-19	26.51	325,342	6,578,699.36	9,630,123.20	-
600547	山东黄金	2013-04-03	重大事项	32.13	2013-07-01	28.77	709,746	27,590,123.60	22,804,138.98	-
600598	北大荒	2013-05-25	重大事项	8.35	2013-07-19	8.35	603,602	7,621,704.13	5,040,076.70	-
601918	国投新集	2013-05-16	重大事项	7.55	-	-	471,492	5,931,388.51	3,559,764.60	-
601989	中国重工	2013-05-17	重大事项	4.52	-	-	3,733,947	20,558,760.08	16,877,440.44	-

注：本基金截至2013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 2013 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 0.11%(2012 年 12 月 31 日：0.08%)。

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 2013 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	270,486,496.58	-	-	-	270,486,496.58
存出保证金	1,440,243.63	-	-	-	1,440,243.63
交易性金融资产	-	4,546,592.60	-	3,582,272,492.57	3,586,819,085.17
买入返售金融资产	110,020,375.01	-	-	-	110,020,375.01
应收利息	-	-	-	112,534.97	112,534.97

应收股利	-	-	-	11,466,677.04	11,466,677.04
应收申购款	51,630.21	-	-	1,753,206.47	1,804,836.68
资产总计	381,998,745.43	4,546,592.60	-	3,595,604,911.05	3,982,150,249.08
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,871,060.22	7,871,060.22
应付赎回款	-	-	-	1,591,419.76	1,591,419.76
应付管理人报酬	-	-	-	1,773,947.36	1,773,947.36
应付托管费	-	-	-	354,789.50	354,789.50
应付交易费用	-	-	-	1,200,498.25	1,200,498.25
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	1,597,133.42	1,597,133.42
负债总计	-	-	-	15,040,852.31	15,040,852.31
利率敏感度缺口	381,998,745.43	4,546,592.60	-	3,580,564,058.74	3,967,109,396.77
上年度末 2012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	443,752,648.11	-	-	-	443,752,648.11
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	50,020,000.00	4,698,648.20	-	5,802,586,124.57	5,857,304,772.77
应收利息	-	-	-	1,279,609.18	1,279,609.18
应收申购款	50,019,658.78	-	-	1,664,702.94	51,684,361.72
其他应收款	-	-	-	100,000.00	100,000.00
资产总计	543,792,306.89	4,698,648.20	-	5,806,130,436.69	6,354,621,391.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	121,494,916.86	121,494,916.86
应付赎回款	-	-	-	4,829,827.23	4,829,827.23
应付管理人报酬	-	-	-	2,259,163.75	2,259,163.75
应付托管费	-	-	-	451,832.75	451,832.75
应付交易费用	-	-	-	965,413.64	965,413.64
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	1,131,244.07	1,131,244.07
负债总计	-	-	-	131,784,402.10	131,784,402.10
利率敏感度缺口	543,792,306.89	4,698,648.20	-	5,674,346,034.59	6,222,836,989.68

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2013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0.11%(2012年12月31日：0.88%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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-	3,582,272,492.57	90.30	5,802,586,124.57	93.25

股票投资				
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,582,272,492.57	90.30	5,802,586,124.57	93.25

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 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	沪深300指数下降5%	减少约18,663	减少约28,986
	沪深300指数上升5%	增加约18,663	增加约28,986

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 2013 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 3,528,907,541.25 元，属于第二层级的余额为 57,911,543.92 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 5,650,870,697.15 元，第二层级 206,434,075.62，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	3,582,272,492.57	89.96
	其中：股票	3,582,272,492.57	89.96
2	固定收益投资	4,546,592.60	0.11
	其中：债券	4,546,592.60	0.11
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	110,020,375.01	2.76
	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	270,486,496.58	6.79

6	其他各项资产	14,824,292.32	0.37
7	合计	3,982,150,249.08	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	21,639,166.46	0.55
B	采矿业	277,378,661.74	6.99
C	制造业	1,227,908,207.46	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	76,926,658.56	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

7.2.2 积极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	-	-

B	采矿业	4,341,368.68	0.11
C	制造业	36,376,638.04	0.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,373,467.66	0.46
E	建筑业	3,825,324.72	0.10
F	批发和零售业	6,114,265.20	0.15
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,941,325.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	701,960.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	71,674,349.30	1.81

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	600016	民生银行	17,929,539	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
11	000001	平安银行	5,089,634	50,743,650.98	1.28
12	601398	工商银行	11,933,144	47,971,238.88	1.21
13	601288	农业银行	19,309,668	47,501,783.28	1.20
14	000651	格力电器	1,752,364	43,914,241.84	1.11
15	601088	中国神华	2,571,568	43,562,361.92	1.10
16	601668	中国建筑	11,833,192	38,694,537.84	0.98
17	601601	中国太保	2,382,453	37,952,476.29	0.96
18	601818	光大银行	12,098,535	34,964,766.15	0.88
19	600104	上汽集团	2,578,721	34,064,904.41	0.86
20	600048	保利地产	3,329,865	32,998,962.15	0.83
21	601939	建设银行	7,925,807	32,892,099.05	0.83
22	601169	北京银行	4,099,802	32,675,421.94	0.82
23	600887	伊利股份	1,043,185	32,630,826.80	0.82
24	600256	广汇能源	2,477,340	32,106,326.40	0.81
25	000858	五粮液	1,425,254	28,562,090.16	0.72
26	601006	大秦铁路	4,553,268	27,046,411.92	0.68
27	600900	长江电力	3,834,463	26,534,483.96	0.67
28	000776	广发证券	2,224,280	24,645,022.40	0.62
29	600015	华夏银行	2,682,011	24,191,739.22	0.61
30	600028	中国石化	5,729,824	23,950,664.32	0.60
31	600383	金地集团	3,354,352	23,010,854.72	0.58
32	600518	康美药业	1,194,999	22,979,830.77	0.58
33	600111	包钢稀土	1,099,772	22,952,241.64	0.58
34	600547	山东黄金	709,746	22,804,138.98	0.57
35	000538	云南白药	264,336	22,206,867.36	0.56
36	000527	美的电器	1,763,432	21,901,825.44	0.55
37	600585	海螺水泥	1,553,006	20,779,220.28	0.52
38	600050	中国联通	6,643,762	20,728,537.44	0.52
39	601857	中国石油	2,681,519	20,406,359.59	0.51
40	000157	中联重科	3,676,610	19,963,992.30	0.50
41	000895	双汇发展	505,086	19,415,505.84	0.49
42	600535	天士力	480,315	18,804,332.25	0.47
43	000063	中兴通讯	1,471,421	18,760,617.75	0.47
44	600999	招商证券	1,782,913	18,542,295.20	0.47

45	600406	国电南瑞	1,227,618	18,328,336.74	0.46
46	600031	三一重工	2,382,078	17,889,405.78	0.45
47	002241	歌尔声学	486,499	17,655,048.71	0.45
48	601688	华泰证券	2,144,686	17,286,169.16	0.44
49	002024	苏宁云商	3,441,480	17,241,814.80	0.43
50	600011	华能国际	3,176,297	16,961,425.98	0.43
51	601989	中国重工	3,733,947	16,877,440.44	0.43
52	600089	特变电工	2,070,815	16,670,060.75	0.42
53	600315	上海家化	356,337	16,031,601.63	0.40
54	000423	东阿阿胶	403,035	15,589,393.80	0.39
55	601628	中国人寿	1,137,829	15,576,879.01	0.39
56	600019	宝钢股份	3,895,457	15,309,146.01	0.39
57	000100	TCL 集团	6,712,601	15,237,604.27	0.38
58	600795	国电电力	6,602,027	15,052,621.56	0.38
59	601899	紫金矿业	6,303,744	15,002,910.72	0.38
60	601117	中国化学	1,542,380	14,683,457.60	0.37
61	000069	华侨城 A	2,820,943	14,584,275.31	0.37
62	002236	大华股份	380,492	14,546,209.16	0.37
63	600276	恒瑞医药	537,815	14,176,803.40	0.36
64	000625	长安汽车	1,453,159	13,499,847.11	0.34
65	600739	辽宁成大	1,019,003	13,369,319.36	0.34
66	601009	南京银行	1,584,967	13,361,271.81	0.34
67	600690	青岛海尔	1,211,636	13,218,948.76	0.33
68	600309	万华化学	819,991	13,136,255.82	0.33
69	601901	方正证券	2,315,635	12,805,461.55	0.32
70	601766	中国南车	3,543,248	12,755,692.80	0.32
71	000725	京东方 A	5,742,767	12,748,942.74	0.32
72	000024	招商地产	524,178	12,727,041.84	0.32
73	002304	洋河股份	230,240	12,502,032.00	0.32
74	002038	双鹭药业	212,758	12,467,618.80	0.31
75	002081	金螳螂	436,926	12,439,283.22	0.31
76	000568	泸州老窖	521,020	12,389,855.60	0.31
77	002353	杰瑞股份	177,478	12,245,982.00	0.31
78	000338	潍柴动力	703,115	12,199,045.25	0.31
79	600066	宇通客车	662,566	12,144,834.78	0.31
80	600637	百视通	427,761	11,977,308.00	0.30

81	601299	中国北车	3,159,460	11,879,569.60	0.30
82	601788	光大证券	1,133,336	11,560,027.20	0.29
83	002415	海康威视	317,131	11,207,409.54	0.28
84	600703	三安光电	562,889	11,055,139.96	0.28
85	600804	鹏博士	1,041,204	11,026,350.36	0.28
86	600085	同仁堂	496,675	10,867,249.00	0.27
87	601377	兴业证券	1,190,902	10,813,390.16	0.27
88	600489	中金黄金	1,161,346	10,788,904.34	0.27
89	000581	威孚高科	317,739	10,609,305.21	0.27
90	002594	比亚迪	353,656	10,577,850.96	0.27
91	601633	长城汽车	295,843	10,478,759.06	0.26
92	600362	江西铜业	661,078	10,405,367.72	0.26
93	601336	新华保险	417,632	10,319,686.72	0.26
94	600010	包钢股份	2,504,441	10,268,208.10	0.26
95	000009	中国宝安	933,049	10,263,539.00	0.26
96	000983	西山煤电	1,237,434	10,097,461.44	0.25
97	000783	长江证券	1,274,380	10,080,345.80	0.25
98	601186	中国铁建	2,387,609	10,027,957.80	0.25
99	002422	科伦药业	185,875	9,908,996.25	0.25
100	600600	青岛啤酒	260,161	9,880,914.78	0.25
101	601390	中国中铁	3,982,586	9,717,509.84	0.24
102	600583	海油工程	1,500,013	9,705,084.11	0.24
103	000999	华润三九	325,342	9,630,123.20	0.24
104	000402	金融街	1,909,231	9,565,247.31	0.24
105	600196	复星医药	898,012	9,411,165.76	0.24
106	000768	中航飞机	1,057,320	9,410,148.00	0.24
107	002142	宁波银行	1,096,872	9,290,505.84	0.23
108	000012	南玻 A	999,542	9,265,754.34	0.23
109	600252	中恒集团	666,858	9,255,989.04	0.23
110	600100	同方股份	1,306,017	8,959,276.62	0.23
111	601669	中国水电	3,007,382	8,661,260.16	0.22
112	600009	上海机场	718,091	8,559,644.72	0.22
113	601699	潞安环能	713,239	8,530,338.44	0.22
114	600348	阳泉煤业	942,383	8,519,142.32	0.21
115	000970	中科三环	646,348	8,428,377.92	0.21
116	600340	华夏幸福	257,765	8,387,673.10	0.21

117	000792	盐湖股份	493,933	8,367,225.02	0.21
118	000623	吉林敖东	562,788	8,205,449.04	0.21
119	600649	城投控股	1,173,320	8,119,374.40	0.20
120	601168	西部矿业	1,483,042	8,023,257.22	0.20
121	601607	上海医药	754,613	8,021,536.19	0.20
122	000800	一汽轿车	652,085	8,020,645.50	0.20
123	002570	贝因美	284,524	7,952,445.80	0.20
124	601998	中信银行	2,143,147	7,951,075.37	0.20
125	002146	荣盛发展	561,312	7,920,112.32	0.20
126	600674	川投能源	774,903	7,880,763.51	0.20
127	600886	国投电力	2,314,650	7,823,517.00	0.20
128	600660	福耀玻璃	1,084,369	7,796,613.11	0.20
129	000629	攀钢钒钛	3,292,571	7,737,541.85	0.20
130	600029	南方航空	2,735,748	7,714,809.36	0.19
131	600352	浙江龙盛	817,812	7,671,076.56	0.19
132	000425	徐工机械	963,560	7,563,946.00	0.19
133	600694	大商股份	257,623	7,453,033.39	0.19
134	000060	中金岭南	1,115,728	7,386,119.36	0.19
135	601800	中国交建	1,818,293	7,364,086.65	0.19
136	601898	中煤能源	1,495,163	7,311,347.07	0.18
137	002310	东方园林	188,332	7,211,232.28	0.18
138	600369	西南证券	937,593	7,191,338.31	0.18
139	002375	亚厦股份	232,735	7,168,238.00	0.18
140	601600	中国铝业	2,238,474	7,051,193.10	0.18
141	600642	申能股份	1,849,098	7,026,572.40	0.18
142	600497	驰宏锌锗	716,918	6,989,950.50	0.18
143	600108	亚盛集团	1,061,442	6,920,601.84	0.17
144	600123	兰花科创	546,332	6,911,099.80	0.17
145	000039	中集集团	668,322	6,903,766.26	0.17
146	600150	中国船舶	421,457	6,814,959.69	0.17
147	600005	武钢股份	3,031,613	6,790,813.12	0.17
148	600549	厦门钨业	252,744	6,748,264.80	0.17
149	002385	大北农	640,440	6,609,340.80	0.17
150	600153	建发股份	1,048,721	6,596,455.09	0.17
151	002344	海宁皮城	343,784	6,569,712.24	0.17
152	600068	葛洲坝	1,656,090	6,524,994.60	0.16

153	600177	雅戈尔	1,067,636	6,523,255.96	0.16
154	600832	东方明珠	1,179,358	6,498,262.58	0.16
155	601111	中国国航	1,520,870	6,448,488.80	0.16
156	000728	国元证券	760,913	6,437,323.98	0.16
157	002202	金风科技	1,182,257	6,372,365.23	0.16
158	600893	航空动力	383,703	6,323,425.44	0.16
159	601808	中海油服	446,444	6,290,395.96	0.16
160	601018	宁波港	3,088,104	6,237,970.08	0.16
161	600741	华域汽车	793,255	6,187,389.00	0.16
162	000630	铜陵有色	571,827	6,164,295.06	0.16
163	601618	中国中冶	3,788,994	6,100,280.34	0.15
164	000709	河北钢铁	3,291,297	6,088,899.45	0.15
165	601555	东吴证券	887,180	6,077,183.00	0.15
166	601958	金钼股份	764,557	6,062,937.01	0.15
167	000729	燕京啤酒	1,055,502	6,026,916.42	0.15
168	600498	烽火通信	365,375	6,021,380.00	0.15
169	600208	新湖中宝	1,921,017	5,935,942.53	0.15
170	600143	金发科技	1,226,834	5,925,608.22	0.15
171	601888	中国国旅	200,307	5,848,964.40	0.15
172	600655	豫园商城	880,343	5,731,032.93	0.14
173	600316	洪都航空	364,289	5,682,908.40	0.14
174	600166	福田汽车	1,109,238	5,657,113.80	0.14
175	600271	航天信息	426,047	5,632,341.34	0.14
176	600881	亚泰集团	1,423,524	5,537,508.36	0.14
177	601933	永辉超市	470,913	5,495,554.71	0.14
178	600062	华润双鹤	274,462	5,494,729.24	0.14
179	600863	内蒙华电	956,529	5,404,388.85	0.14
180	000878	云南铜业	555,854	5,391,783.80	0.14
181	600718	东软集团	650,966	5,298,863.24	0.13
182	600875	东方电气	513,248	5,296,719.36	0.13
183	600415	小商品城	1,043,016	5,277,660.96	0.13
184	600118	中国卫星	371,340	5,265,601.20	0.13
185	002106	莱宝高科	341,935	5,248,702.25	0.13
186	000876	新希望	525,843	5,179,553.55	0.13
187	600811	东方集团	1,047,298	5,163,179.14	0.13
188	600157	永泰能源	879,434	5,144,688.90	0.13

189	600839	四川长虹	2,864,575	5,127,589.25	0.13
190	600115	东方航空	1,974,830	5,055,564.80	0.13
191	600598	北大荒	603,602	5,040,076.70	0.13
192	600516	方大炭素	619,317	5,016,467.70	0.13
193	601333	广深铁路	2,165,441	4,980,514.30	0.13
194	601928	凤凰传媒	589,750	4,959,797.50	0.13
195	000046	泛海建设	1,007,691	4,917,532.08	0.12
196	600267	海正药业	385,845	4,907,948.40	0.12
197	601992	金隅股份	971,896	4,859,480.00	0.12
198	002007	华兰生物	214,384	4,840,790.72	0.12
199	000061	农产品	798,214	4,797,266.14	0.12
200	000758	中色股份	469,000	4,750,970.00	0.12
201	600188	兖州煤业	502,110	4,719,834.00	0.12
202	000422	湖北宜化	698,631	4,715,759.25	0.12
203	601238	广汽集团	638,587	4,700,000.32	0.12
204	000937	冀中能源	528,971	4,670,813.93	0.12
205	600376	首开股份	835,753	4,638,429.15	0.12
206	601666	平煤股份	888,075	4,617,990.00	0.12
207	600809	山西汾酒	187,510	4,593,995.00	0.12
208	000839	中信国安	706,102	4,554,357.90	0.11
209	002155	辰州矿业	551,744	4,436,021.76	0.11
210	000960	锡业股份	361,987	4,416,241.40	0.11
211	600546	山煤国际	371,834	4,402,514.56	0.11
212	002500	山西证券	740,807	4,385,577.44	0.11
213	600664	哈药股份	736,864	4,376,972.16	0.11
214	600027	华电国际	1,376,653	4,336,456.95	0.11
215	600219	南山铝业	922,878	4,328,297.82	0.11
216	600372	中航电子	206,476	4,325,672.20	0.11
217	000750	国海证券	411,446	4,246,122.72	0.11
218	601106	中国一重	2,080,194	4,201,991.88	0.11
219	002001	新 和 成	281,032	4,142,411.68	0.10
220	600216	浙江医药	201,782	4,140,566.64	0.10
221	000528	柳 工	636,230	4,135,495.00	0.10
222	601717	郑煤机	651,471	4,071,693.75	0.10
223	601098	中南传媒	432,370	4,021,041.00	0.10
224	600827	友谊股份	584,014	4,012,176.18	0.10

225	601118	海南橡胶	932,336	3,859,871.04	0.10
226	601158	重庆水务	748,241	3,853,441.15	0.10
227	600058	五矿发展	347,300	3,785,570.00	0.10
228	600125	铁龙物流	709,232	3,758,929.60	0.09
229	002092	中泰化学	736,494	3,741,389.52	0.09
230	000778	新兴铸管	752,752	3,696,012.32	0.09
231	600221	海南航空	1,816,933	3,670,204.66	0.09
232	000718	苏宁环球	616,968	3,627,771.84	0.09
233	600259	广晟有色	98,486	3,621,330.22	0.09
234	000686	东北证券	221,476	3,596,770.24	0.09
235	601258	庞大集团	604,590	3,573,126.90	0.09
236	000869	张裕 A	104,382	3,563,601.48	0.09
237	601918	国投新集	471,492	3,559,764.60	0.09
238	600170	上海建工	520,002	3,556,813.68	0.09
239	600395	盘江股份	386,082	3,532,650.30	0.09
240	600266	北京城建	344,042	3,519,549.66	0.09
241	600109	国金证券	301,165	3,463,397.50	0.09
242	601866	中海集运	1,799,021	3,454,120.32	0.09
243	000401	冀东水泥	419,320	3,446,810.40	0.09
244	601099	太平洋	676,263	3,394,840.26	0.09
245	600132	重庆啤酒	224,567	3,375,242.01	0.09
246	000933	神火股份	754,728	3,366,086.88	0.08
247	600588	用友软件	369,230	3,300,916.20	0.08
248	600160	巨化股份	558,611	3,256,702.13	0.08
249	002299	圣农发展	355,152	3,210,574.08	0.08
250	600096	云天化	395,935	3,163,520.65	0.08
251	600895	张江高科	585,154	3,101,316.20	0.08
252	600169	太原重工	1,328,826	3,096,164.58	0.08
253	000969	安泰科技	398,722	3,094,082.72	0.08
254	600997	开滦股份	533,914	3,043,309.80	0.08
255	601001	大同煤业	520,719	2,983,719.87	0.08
256	600779	水井坊	260,069	2,980,390.74	0.08
257	600550	天威保变	543,318	2,966,516.28	0.07
258	600971	恒源煤电	382,441	2,944,795.70	0.07
259	600859	王府井	181,255	2,920,018.05	0.07
260	600970	中材国际	317,313	2,919,279.60	0.07

261	601101	昊华能源	363,564	2,883,062.52	0.07
262	002128	露天煤业	321,468	2,809,630.32	0.07
263	600528	中铁二局	573,868	2,777,521.12	0.07
264	002431	棕榈园林	146,075	2,769,582.00	0.07
265	600432	吉恩镍业	316,224	2,754,311.04	0.07
266	000807	云铝股份	725,425	2,698,581.00	0.07
267	002069	獐子岛	220,088	2,608,042.80	0.07
268	601369	陕鼓动力	380,391	2,567,639.25	0.06
269	600582	天地科技	389,549	2,500,904.58	0.06
270	000961	中南建设	254,116	2,485,254.48	0.06
271	600783	鲁信创投	180,857	2,401,780.96	0.06
272	600508	上海能源	238,123	2,314,555.56	0.06
273	000703	恒逸石化	255,683	2,201,430.63	0.06
274	002399	海普瑞	120,719	2,148,798.20	0.05
275	002673	西部证券	184,803	2,141,866.77	0.05
276	600873	梅花集团	522,951	2,076,115.47	0.05
277	000059	辽通化工	454,684	2,059,718.52	0.05
278	002603	以岭药业	87,533	1,992,251.08	0.05
279	000596	古井贡酒	86,608	1,808,375.04	0.05
280	000780	平庄能源	315,631	1,694,938.47	0.04
281	002378	章源钨业	65,037	1,212,940.05	0.03
282	000883	湖北能源	167,842	810,676.86	0.02

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	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	10,338,596.00	0.26
4	600060	海信电器	589,990	6,129,996.10	0.15
5	000963	华东医药	153,432	6,114,265.20	0.15
6	002294	信立泰	145,726	4,217,310.44	0.11
7	002051	中工国际	137,256	3,825,324.72	0.10
8	600403	大有能源	389,084	3,314,995.68	0.08

9	000027	深圳能源	594,200	2,988,826.00	0.08
10	601139	深圳燃气	295,494	2,626,941.66	0.07
11	000539	粤电力 A	535,200	2,419,104.00	0.06
12	000656	金科股份	167,500	1,941,325.00	0.05
13	002269	美邦服饰	141,100	1,247,324.00	0.03
14	603993	洛阳钼业	153,190	1,026,373.00	0.03
15	000156	华数传媒	43,600	701,960.00	0.02

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	600036	招商银行	29,432,479.54	0.47
2	600104	上汽集团	21,958,141.78	0.35
3	000776	广发证券	20,640,146.37	0.33
4	000001	平安银行	16,522,223.68	0.27
5	600332	广州药业	12,355,454.11	0.20
6	002450	康得新	10,363,595.95	0.17
7	601991	大唐发电	10,048,447.43	0.16
8	000651	格力电器	9,774,486.12	0.16
9	601688	华泰证券	8,663,392.50	0.14
10	002594	比亚迪	8,398,357.04	0.13
11	600016	民生银行	8,035,057.88	0.13
12	601901	方正证券	7,873,476.45	0.13
13	601336	新华保险	7,557,642.95	0.12
14	601818	光大银行	6,381,131.52	0.10
15	000963	华东医药	6,257,256.02	0.10
16	600060	海信电器	6,219,221.69	0.10
17	601318	中国平安	6,013,360.56	0.10
18	600028	中国石化	5,359,115.25	0.09
19	601166	兴业银行	5,161,052.46	0.08
20	600000	浦发银行	4,459,473.09	0.07

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	83,686,428.06	1.34
2	600036	招商银行	68,027,507.80	1.09
3	601328	交通银行	64,776,827.33	1.04
4	601318	中国平安	58,712,100.39	0.94
5	601166	兴业银行	51,938,057.15	0.83
6	600000	浦发银行	43,351,972.74	0.70
7	000002	万 科 A	38,370,443.47	0.62
8	600030	中信证券	37,484,906.38	0.60
9	600837	海通证券	34,225,640.82	0.55
10	600519	贵州茅台	32,558,819.34	0.52
11	601088	中国神华	28,083,073.65	0.45
12	000651	格力电器	27,155,146.49	0.44
13	601398	工商银行	27,052,279.85	0.43
14	601288	农业银行	25,980,020.05	0.42
15	601601	中国太保	25,012,780.87	0.40
16	600887	伊利股份	22,872,325.28	0.37
17	601668	中国建筑	20,709,654.56	0.33
18	600048	保利地产	19,876,085.35	0.32
19	600104	上汽集团	18,685,313.17	0.30
20	000858	五 粮 液	18,401,608.38	0.30

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	420,282,999.20
卖出股票的收入（成交）总额	2,123,558,931.16

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	-	-
	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

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	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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，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、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“中国平安”公告其子公司情况以及“贵州茅台”外）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。

（1）根据 2013 年 5 月 21 日中国平安发布的相关公告，该公司控股子公司平安证券有限责任公司（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“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 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股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就中国平安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问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资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 23 日贵州茅台发布的相关公告，该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》（黔价处[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最低价格进行限定，违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。

根据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚，限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万元人民币上交国库。

本基金管理人此前投资贵州茅台股票时，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股票池，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受处罚事件进行了及时分析和研究，认为贵州茅台存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	1,440,243.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,466,677.04
4	应收利息	112,534.97
5	应收申购款	1,804,836.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,824,292.32

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	3,112,620.80	0.08
2	113002	工行转债	1,433,971.80	0.04

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
229,842	37,655.88	1,145,401,599.49	13.23%	7,509,501,299.97	86.77%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	8,488,940.97	0.1%

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
本报告期期初基金份额总额	12,023,972,985.88
本报告期基金总申购份额	644,464,931.79
减：本报告期基金总赎回份额	4,013,535,018.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,654,902,899.46

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

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2013年3月6日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》刊登了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十四次会议审议通过，同意梁之平先生因工作需要离职。

2013年6月25日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过，同意李志坚先生出任公司副总经理。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司

董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚的情况

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	
申银万国证券股份有限公司	1	311,696,192.82	12.27%	283,768.59	12.36%	-
中国银河证券有限责任公司	1	546,489,811.13	21.52%	489,650.52	21.32%	-
安信证券股份有限公司	1	189,179,092.94	7.45%	172,228.21	7.50%	-
瑞银证券股份有限公司	1	144,064,965.24	5.67%	131,157.02	5.71%	-
万联证券股份有限公司	1	1,308,635,782.75	51.52%	1,191,380.70	51.88%	-
红塔证券股份有限公司	1	39,970,617.08	1.57%	28,394.88	1.24%	-
国金证券	1	-	-	-	-	新增

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，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
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券股份有限公司	21,248,287.40	100.00%	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2013-03-14

		报》、《证券日报》	
2	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-04-26
3	国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-05-31

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
二〇一三年八月二十四日