

**国泰沪深 300 指数证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 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：二〇一六年八月二十六日

## 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 2016 年 8 月 23 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的有关规定，经履行相关内部程序，协商基金托管人同意，并报中国证监会备案，国泰基金管理有限公司对本基金合同中关联交易限制内容进行修订，删除基金禁止买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券的条款。具体内容可查阅本基金管理人于 2016 年 2 月 25 日披露的《国泰基金管理有限公司关于旗下完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示 .....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	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 .....	11
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	34
7.1 期末基金资产组合情况 .....	34
7.2 报告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 .....	36
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 .....	36
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	43
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序的前五名债券投资明细 .....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	47
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	48
<b>10 重大事件揭示</b> .....	48
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>11 备查文件目录</b> .....	51
11.1 备查文件目录 .....	51
11.2 存放地点 .....	51
11.3 查阅方式 .....	51

## 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	2,719,620,971.88 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	李永梅	王永民
	联系电话	021-31081600转	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	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	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200082	100818
法定代表人	唐建光	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	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

## 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	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

## 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(2016年1月1日至2016年6月30日)
本期已实现收益	10,284,257.89
本期利润	-279,637,433.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0993
本期加权平均净值利润率	-15.36%
本期基金份额净值增长率	-13.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-109,053,068.78
期末可供分配基金份额利润	-0.0401
期末基金资产净值	1,790,655,580.64
期末基金份额净值	0.6584
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-34.09%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	0.43%	0.96%	-0.43%	0.88%	0.86%	0.08%
过去三个月	-0.93%	1.01%	-1.75%	0.91%	0.82%	0.10%
过去六个月	-13.87%	1.80%	-13.84%	1.66%	-0.03%	0.14%
过去一年	-26.52%	2.23%	-26.49%	2.07%	-0.03%	0.16%
过去三年	43.76%	1.75%	40.13%	1.65%	3.63%	0.10%
自基金合同生效起至今	-34.09%	1.77%	-31.65%	1.71%	-2.44%	0.06%

#### 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

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 2016 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 62 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、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、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（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、国泰价值经典混合型证券投资基金（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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、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、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（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、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰中证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型



证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来，自 2016 年 7 月 1 日起转型为国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
艾小军	本基金的基金经理、国泰黄金 ETF、国泰上证 180 金融 ETF、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰深证 TMT50 指数分级、国泰黄金 ETF 联接、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF 的基金经理	2015-04-10	-	15 年	硕士研究生。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的

					基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，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 $\geq 30$ ），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的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，A 股年初受到汇率波动、资金面紧张、保险监管政策以及熔断新政等多重利空因素的影响下，1 月份至 2 月份经历了一次较大幅度的下跌和震荡调整。3 月份以后，随着“两会”召开，市场逐渐趋于理性，股市波动率有所下降，但风险事件仍然频频发生：4 月，三大期交所出台措施抑制市场过热，A 股阶段性反弹见顶；5 月，权威人士发文，跨界定增被叫停；6 月 A 股未能纳入 MSCI，英国意外脱欧。诸多风险事件的发生和中国经济增长的不确定性使得第二季度的行情以回调震荡为主，风险偏好的下行和存量博弈的格局则让股市行情震荡低迷。2016 年上半年上证指数下跌 17.22%，沪深 300 指数和创业板指数分别下跌 15.47%和 17.92%。申万一级 28 个行业中表现不一，涨幅最大的是食品饮料行业，上涨 0.74%；跌幅最大的为传媒行业，下跌 25.42%。

本报告期内，我们根据市场行情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，由于市场之前的大幅波动对基金的跟踪误差管理带来较大的挑战，我们严格按照基金合同规定全面跟踪沪深 300 指数，避免不必要的主动操作，减少了交易冲击成本。报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.1931%，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 2016 年上半年净值增长率为-13.87%，同期业绩比较基准收益率为-13.84%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际方面，随着美国经济数据不及预期和英国脱欧造成的负面影响扩散，美联储将不得不减缓

加息步伐，国际金融市场仍将面临风险压力；同时，由于全球经济仍维持疲软增长态势，预期全球主要经济体仍将持续货币宽松。国内方面，国内经济需求疲软，财政金融风险增大，短期内经济明显好转的可能性不大。但由于上半年市场风险已经得到较大程度的释放和美国加息概率降低，将使得国内经济能在下半年企稳并有所回升。此外，目前流动性仍然较为宽松，人民币贬值幅度也尚在合理范围内，通胀压力较小。A 股方面，虽然大概率上仍将持续震荡行情，但在国企改革、供给侧改革、新兴经济等三大主题的促进下，仍将出现结构性行情，新能源汽车、虚拟现实、食品饮料、TMT 和航天军工等概念板块将受益最多。沪深 300 这一中国经济最具代表性的指数的长期增长空间不言而喻。基于长期投资、价值投资的理念，投资者可积极利用沪深 300 指数基金这一优良的资产配置工具，把握中国经济长期增长机会。

#### 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，并制定了相关制度及流程。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的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## 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合规守信、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“金融工具风险及管理”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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	113,256,864.96	124,474,694.08
结算备付金		443,571.50	6,021.21
存出保证金		117,738.60	1,335,240.73
交易性金融资产	6.4.7.2	1,679,989,309.67	1,853,577,148.25
其中：股票投资		1,679,989,309.67	1,853,361,648.25
基金投资		-	-
债券投资		-	215,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		406,315.84	-
应收利息	6.4.7.5	20,397.71	24,598.05
应收股利		-	-
应收申购款		236,272.71	838,594.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,794,470,470.99</b>	<b>1,980,256,296.76</b>

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>		-	-
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		-	-
应付赎回款		2,121,109.49	2,579,482.63
应付管理人报酬		726,405.26	843,376.26
应付托管费		145,281.06	168,675.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	411,122.37	306,319.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	410,972.17	421,307.76
<b>负债合计</b>		<b>3,814,890.35</b>	<b>4,319,161.52</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,899,708,649.42	1,805,737,291.23
未分配利润	6.4.7.10	-109,053,068.78	170,199,844.01
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,790,655,580.64</b>	<b>1,975,937,135.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,794,470,470.99</b>	<b>1,980,256,296.76</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6584 元，基金份额总额 2,719,620,971.88 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-272,683,938.44</b>	<b>1,220,346,676.01</b>
1.利息收入		480,977.91	2,382,978.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	480,842.14	957,190.70
债券利息收入		135.77	1,045,323.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	380,463.79
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		16,445,771.66	1,443,903,535.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	341,103.63	1,418,869,931.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	57,017.87	1,898,354.19
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	16,047,650.16	23,135,249.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-289,921,691.03	-228,239,403.15
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	311,003.02	2,299,565.78
<b>减：二、费用</b>		<b>6,953,494.70</b>	<b>22,934,789.40</b>
1. 管理人报酬		4,530,528.30	11,365,312.70
2. 托管费		906,105.65	2,273,062.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,125,056.35	8,600,402.06
5. 利息支出		-	20,733.23
其中：卖出回购金融资产支出		-	20,733.23
6. 其他费用	6.4.7.19	391,804.40	675,278.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-279,637,433.14</b>	<b>1,197,411,886.61</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-279,637,433.14</b>	<b>1,197,411,886.61</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,805,737,291.23	170,199,844.01	1,975,937,135.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-279,637,433.14	-279,637,433.14
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）	93,971,358.19	384,520.35	94,355,878.54
其中：1.基金申购款	400,799,332.25	-17,108,950.76	383,690,381.49
2.基金赎回款	-306,827,974.06	17,493,471.11	-289,334,502.95

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）	1,899,708,649.42	-109,053,068.78	1,790,655,580.64
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	4,994,757,020.78	100,669,771.60	5,095,426,792.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,197,411,886.61	1,197,411,886.61
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）	-2,549,672,057.79	-607,001,855.19	-3,156,673,912.98
其中：1.基金申购款	925,429,375.74	125,197,229.15	1,050,626,604.89
2.基金赎回款	-3,475,101,433.53	-732,199,084.34	-4,207,300,517.87
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）	2,445,084,962.99	691,079,803.02	3,136,164,766.01

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：周向勇，主管会计工作负责人：李辉，会计机构负责人：倪莹

## 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，划入基金份额持有者账户。

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 2016 年 8 月 24 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	113,256,864.96
定期存款	-

其他存款	-
合计	113,256,864.96

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,661,353,726.14	1,679,989,309.67	18,635,583.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,661,353,726.14	1,679,989,309.67	18,635,583.53

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	20,168.90
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	179.84
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.27
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	47.70
合计	20,397.71

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	411,122.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	411,122.37

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,872.86
其他应付款	-
预提费用	318,904.16
应付指数使用费	88,195.15
合计	410,972.17

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,585,093,361.82	1,805,737,291.23
本期申购	573,796,634.33	400,799,332.25
本期赎回（以“-”号填列）	-439,269,024.27	-306,827,974.06
本期末	2,719,620,971.88	1,899,708,649.42

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	856,901,055.20	-686,701,211.19	170,199,844.01
本期利润	10,284,257.89	-289,921,691.03	-279,637,433.14
本期基金份额交易产生的变动数	44,601,518.54	-44,216,998.19	384,520.35
其中：基金申购款	190,247,976.04	-207,356,926.80	-17,108,950.76
基金赎回款	-145,646,457.50	163,139,928.61	17,493,471.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	911,786,831.63	-1,020,839,900.41	-109,053,068.78

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	469,945.83
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	5,391.92
其他	5,504.39
合计	480,842.14

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	375,593,971.94
减：卖出股票成本总额	375,252,868.31
买卖股票差价收入	341,103.63

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	334,686.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	277,500.00
减：应收利息总额	168.83
买卖债券差价收入	57,017.87

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,047,650.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,047,650.16

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-289,921,691.03
——股票投资	-289,921,691.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-289,921,691.03

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	280,889.02
转换费收入	30,114.00
合计	311,003.02

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,125,056.35
银行间市场交易费用	-
合计	1,125,056.35

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	2,479.16
指数使用费	181,221.08
债券账户服务费	9,000.00
CA 证书费	200.00
合计	391,804.40

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 50,000.00 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）	受基金管理人控股股东中国建投控制的公司

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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	-	-	235,603,081.06	4.60%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	214,493.24	5.40%	214,493.24	9.31%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。



### 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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,530,528.30	11,365,312.70
其中：支付销售机构的客户维护费	1,016,758.16	2,173,812.24

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	906,105.65	2,273,062.47

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	113,256,864.96	469,945.83	186,985,600.30	918,015.44

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 4,026,400 股，估值总额为人民币 12,924,744.00 元，占基金资产净值的比例为 0.72%。持有申万宏源集团股份有限公司(受基金管理人控股股东中国建投控制的公司)的 A 股普通股 865,521 股，估值总额为人民币 7,279,031.61 元，占基金资产净值的比例为 0.41%。(2015 年 6 月 30 日：无)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2016 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
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下新股	12.98	12.98	13,149.00	170,674.02	170,674.02	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下新股	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下新股	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下新股	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015-12-18	重大事项	18.20	2016-07-04	21.99	1,493,025.00	15,371,860.30	27,173,055.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项	22.07	-	-	1,058,398.00	14,966,224.45	23,358,843.86	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90	-	-	980,283.00	6,466,131.14	4,803,386.70	-
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项	14.36	-	-	294,536.00	2,543,043.60	4,229,536.96	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	229,860.00	3,877,726.44	3,843,259.20	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项	12.44	-	-	292,964.00	2,902,479.35	3,644,472.16	-
002065	东华软件	2015-12-21	重大事项	18.72	2016-07-04	22.59	150,500.00	3,628,525.28	2,817,360.00	-
000415	渤海金控	2016-02-01	重大事项	6.82	2016-08-11	7.50	389,316.00	3,378,710.56	2,655,135.12	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.29	-	-	262,160.00	2,759,065.97	2,173,306.40	-
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项	2.76	-	-	770,354.00	4,710,004.91	2,126,177.04	-
000629	*ST 钒钛	2016-05-26	重大事项	2.39	-	-	851,227.00	3,052,823.91	2,034,432.53	-
601611	中国核建	2016-06-30	临时停牌	20.92	2016-07-01	23.01	37,059.00	128,594.73	775,274.28	-

注：本基金截至 2016 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 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风险管理部和稽核监察部负责，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。风险管理部和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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2015 年 12 月 31 日：0.01%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。本基金所持全部证券均在证券交易所上市，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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担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 2016 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	113,256,864.96	-	-	-	113,256,864.96
结算备付金	443,571.50	-	-	-	443,571.50
存出保证金	117,738.60	-	-	-	117,738.60
交易性金融资产	-	-	-	1,679,989,309.67	1,679,989,309.67
应收利息	-	-	-	20,397.71	20,397.71
应收证券清算款	-	-	-	406,315.84	406,315.84
应收申购款	29,644.27	-	-	206,628.44	236,272.71
资产总计	113,847,819.33	-	-	1,680,622,651.66	1,794,470,470.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	726,405.26	726,405.26
应付赎回款	-	-	-	2,121,109.49	2,121,109.49
应付托管费	-	-	-	145,281.06	145,281.06
应付交易费用	-	-	-	411,122.37	411,122.37
其他负债	-	-	-	410,972.17	410,972.17
负债总计	-	-	-	3,814,890.35	3,814,890.35
利率敏感度缺口	113,847,819.33	-	-	1,676,807,761.31	1,790,655,580.64
上年度末 2015 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	124,474,694.08	-	-	-	124,474,694.08
结算备付金	6,021.21	-	-	-	6,021.21
存出保证金	1,335,240.73	-	-	-	1,335,240.73
交易性金融资产	-	-	215,500.00	1,853,361,648.25	1,853,577,148.25
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	5,283.26	-	-	833,311.18	838,594.44
应收利息	-	-	-	24,598.05	24,598.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	125,821,239.28	-	215,500.00	1,854,219,557.48	1,980,256,296.76
负债					
应付托管费	-	-	-	168,675.25	168,675.25
应付赎回款	-	-	-	2,579,482.63	2,579,482.63
应付管理人报酬	-	-	-	843,376.26	843,376.26
应付交易费用	-	-	-	306,319.62	306,319.62
其他负债	-	-	-	421,307.76	421,307.76
负债总计	-	-	-	4,319,161.52	4,319,161.52
利率敏感度缺口	125,821,239.28	-	215,500.00	1,849,900,395.96	1,975,937,135.24

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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,679,989,309. 67	93.82	1,853,361,648 .25	93.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,679,989,309. 67	93.82	1,853,361,648 .25	93.80

#### 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 8,676	增加约 9,468
沪深 300 指数下降 5%	减少约 8,676	减少约 9,468	

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,600,155,857.32 元，属于第二层次的余额为 79,833,452.35 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,740,817,866.91 元，第二层次 112,759,281.34 元，无第三层次)。于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (ii) 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，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，本基金不会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将相关股票的公允价值列入第一层次；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次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日同)。

##### (d) 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。

(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	1,679,989,309.67	93.62
	其中：股票	1,679,989,309.67	93.62
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	113,700,436.46	6.34
7	其他各项资产	780,724.86	0.04
8	合计	1,794,470,470.99	100.00

### 7.2 报告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	1,257,850.62	0.07
B	采矿业	59,184,018.07	3.31

C	制造业	519,050,088.07	28.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,193,690.60	3.70
E	建筑业	55,668,489.99	3.11
F	批发和零售业	34,327,267.59	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	52,106,914.84	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,307,249.33	5.04
J	金融业	595,578,064.57	33.26
K	房地产业	80,394,086.79	4.49
L	租赁和商务服务业	14,519,828.30	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,405,603.98	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,772,590.47	0.15
R	文化、体育和娱乐业	33,756,585.20	1.89
S	综合	8,091,005.54	0.45
	合计	1,624,613,333.96	90.73

### 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	1,323,648.00	0.07
C	制造业	17,762,398.85	0.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,220,420.48	0.07
E	建筑业	775,274.28	0.04
F	批发和零售业	2,051,337.60	0.11
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	13,564,906.91	0.76
J	金融业	9,215,287.21	0.51
K	房地产业	4,074,374.96	0.23
L	租赁和商务服务业	5,368,201.32	0.30
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,375,975.71	3.09

### 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	2,116,687	67,818,651.48	3.79
2	600016	民生银行	4,516,180	40,329,487.40	2.25
3	601166	兴业银行	2,601,717	39,650,167.08	2.21
4	600036	招商银行	1,970,010	34,475,175.00	1.93
5	601328	交通银行	5,247,826	29,545,260.38	1.65
6	600519	贵州茅台	96,359	28,129,119.28	1.57
7	000002	万科 A	1,493,025	27,173,055.00	1.52
8	600000	浦发银行	1,651,652	25,716,221.64	1.44
9	600030	中信证券	1,503,168	24,396,416.64	1.36
10	601288	农业银行	7,538,766	24,124,051.20	1.35
11	600837	海通证券	1,545,188	23,826,798.96	1.33
12	000651	格力电器	1,058,398	23,358,843.86	1.30
13	601398	工商银行	4,634,391	20,576,696.04	1.15
14	601169	北京银行	1,936,640	20,082,956.80	1.12
15	600887	伊利股份	1,165,178	19,423,517.26	1.08
16	601668	中国建筑	3,292,151	17,514,243.32	0.98
17	601601	中国太保	599,825	16,219,268.00	0.91
18	601766	中国中车	1,750,969	16,056,385.73	0.90
19	600900	长江电力	1,260,800	15,747,392.00	0.88

20	000333	美的集团	649,128	15,397,316.16	0.86
21	600104	上汽集团	672,743	13,649,955.47	0.76
22	601818	光大银行	3,625,691	13,632,598.16	0.76
23	601988	中国银行	4,026,400	12,924,744.00	0.72
24	601688	华泰证券	623,136	11,789,733.12	0.66
25	000858	五粮液	362,186	11,781,910.58	0.66
26	601989	中国重工	1,822,745	11,537,975.85	0.64
27	000001	平安银行	1,311,979	11,414,217.30	0.64
28	600276	恒瑞医药	268,731	10,778,800.41	0.60
29	600048	保利地产	1,232,912	10,640,030.56	0.59
30	000725	京东方 A	4,538,617	10,484,205.27	0.59
31	600015	华夏银行	1,019,858	10,086,395.62	0.56
32	600028	中国石化	2,007,856	9,477,080.32	0.53
33	002304	洋河股份	131,626	9,466,541.92	0.53
34	000776	广发证券	564,649	9,463,517.24	0.53
35	300104	乐视网	176,960	9,362,953.60	0.52
36	600518	康美药业	615,407	9,348,032.33	0.52
37	601009	南京银行	976,814	9,172,283.46	0.51
38	600999	招商证券	554,055	9,141,907.50	0.51
39	300059	东方财富	407,287	9,041,771.40	0.50
40	002415	海康威视	406,837	8,730,722.02	0.49
41	600637	东方明珠	350,849	8,515,105.23	0.48
42	600958	东方证券	503,856	8,469,819.36	0.47
43	002450	康得新	491,875	8,411,062.50	0.47
44	002142	宁波银行	553,205	8,176,369.90	0.46
45	002736	国信证券	469,095	8,091,888.75	0.45
46	601939	建设银行	1,695,315	8,052,746.25	0.45
47	000783	长江证券	676,786	7,850,717.60	0.44
48	002024	苏宁云商	710,583	7,716,931.38	0.43
49	601901	方正证券	989,235	7,577,540.10	0.42
50	000625	长安汽车	546,672	7,473,006.24	0.42
51	601390	中国中铁	1,067,025	7,437,164.25	0.42
52	600011	华能国际	985,800	7,413,216.00	0.41
53	002594	比亚迪	120,072	7,325,592.72	0.41
54	601006	大秦铁路	1,135,912	7,315,273.28	0.41
55	000166	申万宏源	865,521	7,279,031.61	0.41
56	002739	万达院线	89,562	7,156,003.80	0.40
57	002673	西部证券	266,576	6,893,655.36	0.38
58	000063	中兴通讯	475,765	6,822,470.10	0.38
59	601857	中国石油	927,030	6,702,426.90	0.37
60	601377	兴业证券	901,836	6,664,568.04	0.37
61	601628	中国人寿	317,787	6,616,325.34	0.37
62	600795	国电电力	2,252,101	6,598,655.93	0.37
63	601186	中国铁建	658,576	6,559,416.96	0.37

64	001979	招商蛇口	452,605	6,449,621.25	0.36
65	000538	云南白药	100,022	6,431,414.60	0.36
66	601336	新华保险	159,003	6,423,721.20	0.36
67	600570	恒生电子	94,941	6,339,210.57	0.35
68	600690	青岛海尔	710,297	6,307,437.36	0.35
69	601985	中国核电	921,471	6,293,646.93	0.35
70	600050	中国联通	1,619,485	6,170,237.85	0.34
71	600029	南方航空	873,464	6,166,655.84	0.34
72	300017	网宿科技	90,912	6,109,286.40	0.34
73	601899	紫金矿业	1,810,299	6,100,707.63	0.34
74	002230	科大讯飞	172,509	5,666,920.65	0.32
75	000423	东阿阿胶	107,073	5,656,666.59	0.32
76	600585	海螺水泥	381,706	5,550,005.24	0.31
77	600111	北方稀土	415,885	5,535,429.35	0.31
78	000503	海虹控股	137,234	5,518,179.14	0.31
79	000686	东北证券	424,049	5,474,472.59	0.31
80	600547	山东黄金	138,891	5,404,248.81	0.30
81	601555	东吴证券	400,441	5,365,909.40	0.30
82	600010	包钢股份	1,865,934	5,336,571.24	0.30
83	601088	中国神华	377,887	5,316,870.09	0.30
84	601099	太平洋	866,941	5,314,348.33	0.30
85	601211	国泰君安	297,528	5,293,023.12	0.30
86	300024	机器人	208,458	5,292,748.62	0.30
87	000413	东旭光电	603,856	5,187,123.04	0.29
88	600893	中航动力	148,783	5,155,330.95	0.29
89	600153	建发股份	423,670	5,084,040.00	0.28
90	600100	同方股份	339,386	5,077,214.56	0.28
91	600271	航天信息	211,693	5,038,293.40	0.28
92	300027	华谊兄弟	372,049	5,037,543.46	0.28
93	600705	中航资本	856,082	5,033,762.16	0.28
94	600066	宇通客车	253,381	5,016,943.80	0.28
95	002241	歌尔股份	174,902	5,016,189.36	0.28
96	600703	三安光电	243,112	4,854,946.64	0.27
97	600221	海南航空	1,516,643	4,807,758.31	0.27
98	600019	宝钢股份	980,283	4,803,386.70	0.27
99	600009	上海机场	183,847	4,789,214.35	0.27
100	600109	国金证券	346,181	4,666,519.88	0.26
101	601198	东兴证券	190,893	4,665,424.92	0.26
102	600485	信威集团	259,460	4,628,766.40	0.26
103	600583	海油工程	669,102	4,623,494.82	0.26
104	000100	TCL 集团	1,399,682	4,604,953.78	0.26
105	601607	上海医药	251,950	4,547,697.50	0.25
106	002202	金风科技	298,603	4,517,863.39	0.25
107	601669	中国电建	787,452	4,496,350.92	0.25

108	600886	国投电力	678,710	4,479,486.00	0.25
109	600535	天士力	124,623	4,456,518.48	0.25
110	600383	金地集团	429,442	4,449,019.12	0.25
111	300070	碧水源	296,346	4,409,628.48	0.25
112	000402	金融街	443,747	4,313,220.84	0.24
113	600115	东方航空	647,137	4,277,575.57	0.24
114	601727	上海电气	564,058	4,264,278.48	0.24
115	600649	城投控股	294,536	4,229,536.96	0.24
116	600089	特变电工	495,625	4,222,725.00	0.24
117	600340	华夏幸福	173,165	4,221,762.70	0.24
118	000009	中国宝安	304,014	4,164,991.80	0.23
119	000568	泸州老窖	140,249	4,165,395.30	0.23
120	600196	复星医药	218,826	4,162,070.52	0.23
121	000768	中航飞机	211,218	4,158,882.42	0.23
122	601888	中国国旅	93,099	4,094,494.02	0.23
123	002456	欧菲光	137,649	4,060,645.50	0.23
124	600177	雅戈尔	292,856	4,038,484.24	0.23
125	000069	华侨城 A	626,384	4,008,857.60	0.22
126	002252	上海莱士	105,983	3,993,439.44	0.22
127	600023	浙能电力	778,568	3,962,911.12	0.22
128	000895	双汇发展	189,015	3,946,633.20	0.22
129	601600	中国铝业	1,045,379	3,941,078.83	0.22
130	600804	鹏博士	215,876	3,935,419.48	0.22
131	600373	中文传媒	189,337	3,928,742.75	0.22
132	600369	西南证券	538,325	3,908,239.50	0.22
133	300315	掌趣科技	370,577	3,887,352.73	0.22
134	000793	华闻传媒	391,407	3,867,101.16	0.22
135	000728	国元证券	229,860	3,843,259.20	0.21
136	000917	电广传媒	230,900	3,816,777.00	0.21
137	600118	中国卫星	113,509	3,813,902.40	0.21
138	601618	中国中冶	1,032,598	3,810,286.62	0.21
139	601788	光大证券	223,546	3,786,869.24	0.21
140	600867	通化东宝	181,913	3,763,779.97	0.21
141	600352	浙江龙盛	434,586	3,746,131.32	0.21
142	600660	福耀玻璃	267,569	3,745,966.00	0.21
143	002008	大族激光	163,514	3,734,659.76	0.21
144	000338	潍柴动力	477,347	3,728,080.07	0.21
145	600406	国电南瑞	278,039	3,717,381.43	0.21
146	601919	中国远洋	728,700	3,701,796.00	0.21
147	600489	中金黄金	329,197	3,700,174.28	0.21
148	000623	吉林敖东	147,696	3,685,015.20	0.21
149	600208	新潮中宝	868,434	3,673,475.82	0.21
150	600031	三一重工	726,782	3,648,445.64	0.20
151	600027	华电国际	736,618	3,646,259.10	0.20

152	002465	海格通信	292,964	3,644,472.16	0.20
153	600739	辽宁成大	233,372	3,633,602.04	0.20
154	601018	宁波港	732,821	3,627,463.95	0.20
155	002236	大华股份	276,603	3,623,499.30	0.20
156	002500	山西证券	215,788	3,573,449.28	0.20
157	600309	万华化学	206,235	3,567,865.50	0.20
158	300124	汇川技术	182,927	3,548,783.80	0.20
159	000876	新希望	425,622	3,541,175.04	0.20
160	002475	立讯精密	179,936	3,535,742.40	0.20
161	600718	东软集团	189,605	3,473,563.60	0.19
162	600674	川投能源	419,987	3,469,092.62	0.19
163	000157	中联重科	838,552	3,463,219.76	0.19
164	601098	中南传媒	189,586	3,433,402.46	0.19
165	000559	万向钱潮	218,752	3,412,531.20	0.19
166	600741	华域汽车	242,285	3,394,412.85	0.19
167	600398	海澜之家	299,423	3,383,479.90	0.19
168	000540	中天城投	536,715	3,343,734.45	0.19
169	601998	中信银行	584,854	3,316,122.18	0.19
170	601111	中国国航	488,026	3,299,055.76	0.18
171	000630	铜陵有色	1,278,349	3,247,006.46	0.18
172	600415	小商品城	519,376	3,209,743.68	0.18
173	601933	永辉超市	776,260	3,205,953.80	0.18
174	600663	陆家嘴	139,840	3,181,360.00	0.18
175	600018	上港集团	619,199	3,157,914.90	0.18
176	002385	大北农	391,242	3,153,410.52	0.18
177	000963	华东医药	46,551	3,137,537.40	0.18
178	600085	同仁堂	104,585	3,115,587.15	0.17
179	600839	四川长虹	704,490	3,113,845.80	0.17
180	603993	洛阳钼业	747,425	3,101,813.75	0.17
181	000060	中金岭南	295,610	3,083,212.30	0.17
182	600068	葛洲坝	527,290	3,068,827.80	0.17
183	000750	国海证券	415,372	3,069,599.08	0.17
184	601800	中国交建	291,307	3,067,462.71	0.17
185	300003	乐普医疗	167,716	3,059,139.84	0.17
186	600060	海信电器	172,661	3,052,646.48	0.17
187	002081	金螳螂	302,473	3,030,779.46	0.17
188	000046	泛海控股	297,475	3,007,472.25	0.17
189	000792	盐湖股份	141,770	2,991,347.00	0.17
190	002292	奥飞娱乐	99,772	2,988,171.40	0.17
191	000826	启迪桑德	97,778	2,987,117.90	0.17
192	600150	中国船舶	132,134	2,941,302.84	0.16
193	300144	宋城演艺	114,715	2,857,550.65	0.16
194	002065	东华软件	150,500	2,817,360.00	0.16
195	600157	永泰能源	711,456	2,803,136.64	0.16



196	600688	上海石化	458,799	2,798,673.90	0.16
197	002007	华兰生物	88,640	2,783,296.00	0.16
198	300015	爱尔眼科	75,899	2,772,590.47	0.15
199	600588	用友网络	139,712	2,735,560.96	0.15
200	600895	张江高科	148,743	2,689,273.44	0.15
201	000415	渤海金控	389,316	2,655,135.12	0.15
202	601106	中国一重	499,038	2,599,987.98	0.15
203	300058	蓝色光标	267,076	2,593,307.96	0.14
204	002422	科伦药业	164,889	2,540,939.49	0.14
205	600332	白云山	103,006	2,538,067.84	0.14
206	601333	广深铁路	647,255	2,530,767.05	0.14
207	600820	隧道股份	299,911	2,516,253.29	0.14
208	600642	申能股份	434,317	2,492,979.58	0.14
209	000425	徐工机械	811,180	2,482,210.80	0.14
210	002470	金正大	306,436	2,466,809.80	0.14
211	600256	广汇能源	597,904	2,451,406.40	0.14
212	300002	神州泰岳	227,760	2,423,366.40	0.14
213	601866	中海集运	605,494	2,397,756.24	0.13
214	601258	庞大集团	865,888	2,381,192.00	0.13
215	000738	中航动控	88,065	2,324,916.00	0.13
216	600252	中恒集团	530,548	2,302,578.32	0.13
217	601718	际华集团	294,474	2,249,781.36	0.13
218	600875	东方电气	228,627	2,245,117.14	0.13
219	000709	河钢股份	810,753	2,245,785.81	0.13
220	601991	大唐发电	572,329	2,226,359.81	0.12
221	000039	中集集团	156,032	2,210,973.44	0.12
222	600873	梅花生物	355,830	2,209,704.30	0.12
223	601021	春秋航空	45,826	2,196,898.44	0.12
224	002129	中环股份	262,160	2,173,306.40	0.12
225	600362	江西铜业	158,323	2,134,194.04	0.12
226	600005	武钢股份	770,354	2,126,177.04	0.12
227	600827	百联股份	173,526	2,096,194.08	0.12
228	600170	上海建工	544,537	2,085,576.71	0.12
229	300133	华策影视	134,036	2,086,940.52	0.12
230	601117	中国化学	376,515	2,082,127.95	0.12
231	000729	燕京啤酒	268,834	2,040,450.06	0.11
232	000629	*ST 钒钛	851,227	2,034,432.53	0.11
233	601179	中国西电	391,140	1,983,079.80	0.11
234	601633	长城汽车	234,131	1,976,065.64	0.11
235	601225	陕西煤业	381,730	1,973,544.10	0.11
236	600372	中航电子	101,151	1,969,409.97	0.11
237	000061	农产品	161,772	1,967,147.52	0.11
238	300251	光线传媒	168,257	1,945,050.92	0.11
239	000778	新兴铸管	417,142	1,935,538.88	0.11

240	601928	凤凰传媒	182,462	1,923,149.48	0.11
241	601872	招商轮船	404,559	1,893,336.12	0.11
242	600038	中直股份	45,327	1,880,163.96	0.10
243	300146	汤臣倍健	138,864	1,880,218.56	0.11
244	601992	金隅股份	238,759	1,850,382.25	0.10
245	000999	华润三九	75,219	1,821,804.18	0.10
246	601216	君正集团	241,426	1,803,452.22	0.10
247	601898	中煤能源	349,241	1,802,083.56	0.10
248	002195	二三四五	145,874	1,792,791.46	0.10
249	600008	首创股份	460,112	1,789,835.68	0.10
250	000712	锦龙股份	85,941	1,784,135.16	0.10
251	603000	人民网	106,179	1,763,633.19	0.10
252	000883	湖北能源	378,083	1,750,524.29	0.10
253	000800	一汽轿车	155,137	1,687,890.56	0.09
254	600021	上海电力	163,301	1,677,101.27	0.09
255	600863	内蒙华电	554,248	1,673,828.96	0.09
256	002146	荣盛发展	249,005	1,673,313.60	0.09
257	002294	信立泰	60,276	1,639,507.20	0.09
258	002153	石基信息	61,296	1,616,988.48	0.09
259	600959	江苏有线	114,856	1,603,389.76	0.09
260	600600	青岛啤酒	53,186	1,546,117.02	0.09
261	000156	华数传媒	82,000	1,521,100.00	0.08
262	601958	金钼股份	184,614	1,504,604.10	0.08
263	000027	深圳能源	226,838	1,447,226.44	0.08
264	600648	外高桥	71,823	1,415,631.33	0.08
265	601808	中海油服	113,518	1,379,243.70	0.08
266	000825	太钢不锈	434,852	1,374,132.32	0.08
267	000898	鞍钢股份	352,082	1,348,474.06	0.08
268	601608	中信重工	248,550	1,334,713.50	0.07
269	002399	海普瑞	72,218	1,260,926.28	0.07
270	601118	海南橡胶	225,018	1,257,850.62	0.07
271	600317	营口港	370,573	1,245,125.28	0.07
272	600783	鲁信创投	57,230	1,236,740.30	0.07
273	600578	京能电力	264,281	1,131,122.68	0.06
274	600998	九州通	63,306	1,108,488.06	0.06
275	600188	兖州煤业	73,926	808,750.44	0.05
276	603885	吉祥航空	26,679	700,323.75	0.04
277	601016	节能风电	39,683	394,052.19	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	600816	安信信托	323,035	5,449,600.45	0.30
2	000839	中信国安	209,540	4,465,297.40	0.25
3	600061	国投安信	211,318	3,765,686.76	0.21
4	002183	怡亚通	240,281	3,440,823.92	0.19
5	600446	金证股份	95,543	3,434,770.85	0.19
6	600376	首开股份	298,690	3,321,432.80	0.19
7	000977	浪潮信息	114,470	2,684,321.50	0.15
8	600074	保千里	175,904	2,624,487.68	0.15
9	002152	广电运通	152,848	2,512,821.12	0.14
10	600737	中粮屯河	195,642	2,259,665.10	0.13
11	600037	歌华有线	146,346	2,225,922.66	0.12
12	600704	物产中大	219,160	2,051,337.60	0.11
13	002027	分众传媒	116,740	1,927,377.40	0.11
14	300168	万达信息	69,800	1,814,102.00	0.10
15	300085	银之杰	51,984	1,554,321.60	0.09
16	600666	奥瑞德	43,898	1,525,894.48	0.09
17	600582	天地科技	315,843	1,421,293.50	0.08
18	002424	贵州百灵	80,675	1,387,610.00	0.08
19	600871	石化油服	344,700	1,323,648.00	0.07
20	600098	广州发展	156,064	1,220,420.48	0.07
21	600685	中船防务	46,993	1,191,742.48	0.07
22	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
23	600022	山东钢铁	321,345	761,587.65	0.04
24	600606	绿地控股	69,588	752,942.16	0.04
25	002568	百润股份	34,095	750,090.00	0.04
26	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
27	601966	玲珑轮胎	13,149	170,674.02	0.01
28	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
29	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
30	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
31	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
32	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
33	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
34	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
35	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
36	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
37	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

#### 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	601988	中国银行	15,073,765.58	0.76
2	601318	中国平安	15,013,691.97	0.76
3	600016	民生银行	10,982,923.18	0.56
4	601166	兴业银行	8,977,777.00	0.45
5	601328	交通银行	8,444,422.68	0.43
6	600000	浦发银行	7,981,798.32	0.40
7	000166	申万宏源	7,934,355.50	0.40
8	601009	南京银行	7,887,500.70	0.40
9	600036	招商银行	6,550,120.94	0.33
10	002739	万达院线	6,139,133.01	0.31
11	600900	长江电力	6,034,500.41	0.31
12	600958	东方证券	5,992,566.33	0.30
13	601668	中国建筑	5,464,298.71	0.28
14	600816	安信信托	5,445,377.50	0.28
15	601288	农业银行	5,324,170.00	0.27
16	601398	工商银行	5,170,396.00	0.26
17	600030	中信证券	4,874,122.75	0.25
18	601818	光大银行	4,468,538.00	0.23
19	002736	国信证券	4,336,661.08	0.22
20	600837	海通证券	4,177,293.00	0.21

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	21,171,632.90	1.07
2	601318	中国平安	13,135,738.96	0.66
3	600000	浦发银行	13,095,262.80	0.66
4	601166	兴业银行	7,848,239.08	0.40
5	600036	招商银行	6,537,831.60	0.33
6	601009	南京银行	5,173,024.26	0.26
7	600030	中信证券	5,053,975.92	0.26
8	600519	贵州茅台	4,674,330.30	0.24
9	601288	农业银行	4,553,535.00	0.23
10	600837	海通证券	4,523,859.45	0.23
11	601328	交通银行	4,068,535.00	0.21
12	601169	北京银行	3,908,591.66	0.20
13	002024	苏宁云商	3,449,880.20	0.17

14	600887	伊利股份	3,438,636.72	0.17
15	600315	上海家化	3,413,632.69	0.17
16	601766	中国中车	3,227,243.21	0.16
17	601668	中国建筑	3,146,534.08	0.16
18	601601	中国太保	3,124,510.31	0.16
19	601238	广汽集团	2,876,175.82	0.15
20	601398	工商银行	2,848,859.00	0.14

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	491,802,220.76
卖出股票的收入（成交）总额	375,593,971.94

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	117,738.60
2	应收证券清算款	406,315.84
3	应收股利	-
4	应收利息	20,397.71
5	应收申购款	236,272.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	780,724.86

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	000002	万科 A	27,173,055.00	1.52	重大事项

7.12.5.2 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
98,051	27,736.80	91,302,866.02	3.36%	2,628,318,105.86	96.64%

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	551,541.94	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## 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	2,585,093,361.82
本报告期基金总申购份额	573,796,634.33
减：本报告期基金总赎回份额	439,269,024.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,719,620,971.88

## 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

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，聘任李永梅女士担任公司督察长；

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理，且不再代为履行督察长职务；

2016 年 6 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过，张峰先生不再担任本基金管理人总经理，由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务。

2016 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理，公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

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，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	383,125,248.16	44.46%	280,179.36	41.63%	-
安信证券	1	148,990,873.20	17.29%	138,754.92	20.62%	-
东方证券	1	133,570,690.54	15.50%	97,680.72	14.51%	-
银河证券	1	65,314,467.21	7.58%	60,827.85	9.04%	-
国金证券	1	63,120,178.39	7.33%	46,160.26	6.86%	-
中信建投	3	43,644,808.47	5.07%	31,917.61	4.74%	-
长江证券	1	22,106,660.11	2.57%	16,166.77	2.40%	-
中金证券	2	1,805,815.23	0.21%	1,320.61	0.20%	-
申万宏源	2	-	-	-	0.00%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，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：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

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
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	86,215.20	25.76%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	248,471.50	74.24%	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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关于指数熔断当日调整旗下部分基金开放时间及申购、赎回等业务安排的临时公告	公司官网	2016-01-04
2	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》、《证券时报》	2016-01-07
3	国泰基金管理有限公司关于指数熔断当日调整旗下部分基金开放时间及申购、赎回等业务安排的临时公告	公司官网	2016-01-07
4	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》、《证券时报》	2016-01-21
5	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》、《证券时报》、《证券日报》	2016-01-30
6	国泰基金管理有限公司关于旗下完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-02-25

7	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》、《证券时报》、《证券日报》	2016-02-27
8	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》、《证券时报》	2016-03-22
9	国泰基金管理有限公司督察长任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-03-26
10	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-03-26
11	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》、《证券时报》	2016-05-11
12	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-06-08
13	国泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-06-18
14	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-07-12

## 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——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16-19 层。

### 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) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十六日