

国泰沪深 300 指数证券投资基金
2016 年年度报告
2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十八日

§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约定，于 2017 年 3 月 24 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。

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》。

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。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 管理层对财务报表的责任	16
6.2 注册会计师的责任	16
6.3 审计意见	17
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 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	59

8.7	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.....	59
8.8	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.....	59
8.9	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.....	59
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
8.12	投资组合报告附注.....	60
§9	基金份额持有人信息	61
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
9.3	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.....	61
§10	开放式基金份额变动	62
§11	重大事件揭示	62
11.1	基金份额持有人大会决议.....	62
11.2	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.....	62
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
11.4	基金投资策略的改变.....	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
11.8	其他重大事件.....	64
§12	备查文件目录	66
12.1	备查文件目录.....	66
12.2	存放地点.....	66
12.3	查阅方式.....	66

§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	2,681,201,943.99 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》和《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	51,067,813.90	1,610,716,033.03	-187,817,424.46
本期利润	-160,232,994.88	758,563,438.59	1,500,518,386.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0590	0.1815	0.2149
本期加权平均净值利润率	-8.73%	22.93%	43.32%
本期基金份额净值增长率	-7.82%	7.27%	46.05%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	16,273,360.15	170,199,844.01	-229,996,679.33
期末可供分配基金份额利润	0.0061	0.0658	-0.0322
期末基金资产净值	1,889,147,910.08	1,975,937,135.24	5,095,426,792.38
期末基金份额净值	0.7046	0.7644	0.7126
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-29.46%	-23.48%	-28.66%

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

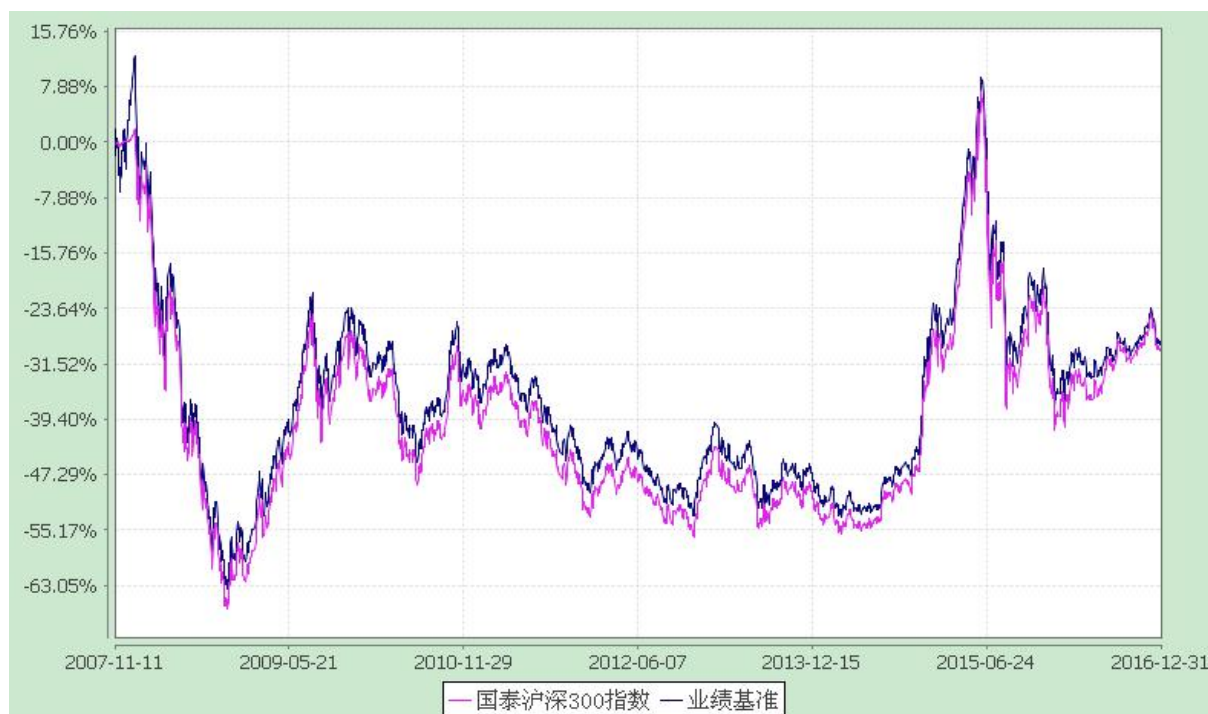
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.91%	0.68%	1.60%	0.64%	0.31%	0.04%
过去六个月	7.02%	0.73%	4.52%	0.68%	2.50%	0.05%
过去一年	-7.82%	1.36%	-9.95%	1.26%	2.13%	0.10%
过去三年	44.41%	1.71%	38.94%	1.61%	5.47%	0.10%
过去五年	46.79%	1.54%	38.84%	1.46%	7.95%	0.08%
自基金合同生效起至今	-29.46%	1.73%	-28.57%	1.67%	-0.89%	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

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的历史走势对比图
(2007 年 11 月 11 日至 2016 年 12 月 31 日)

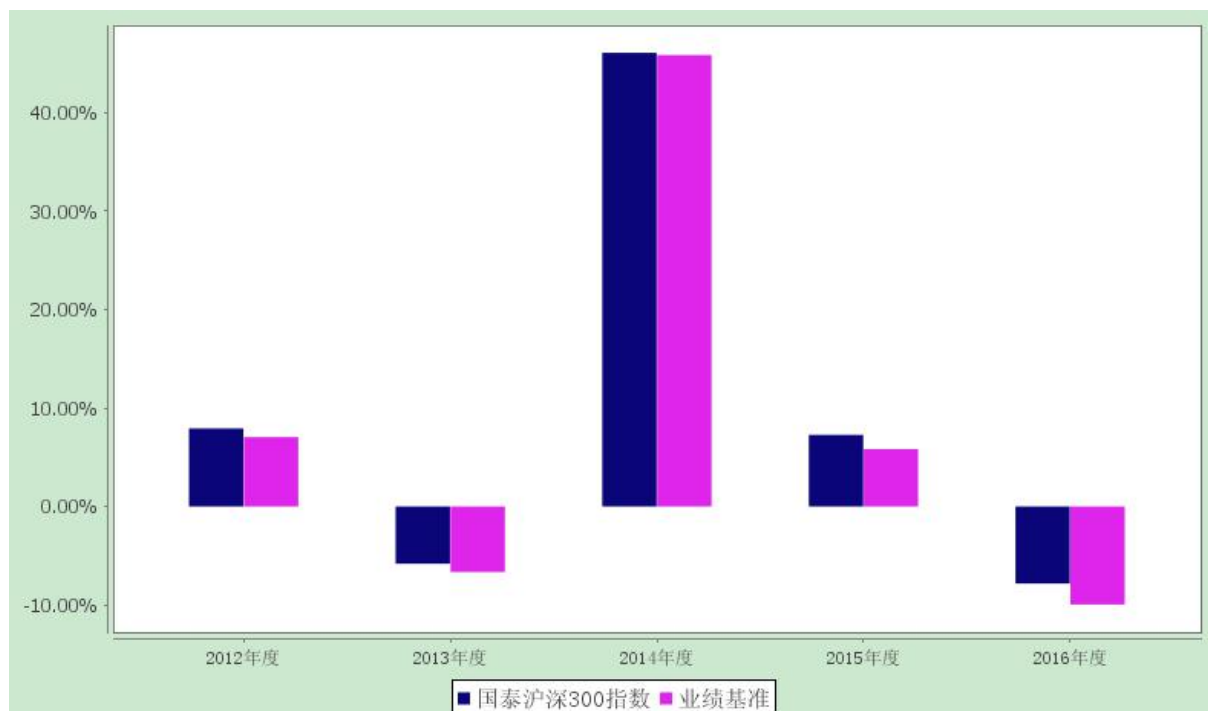


注：本基金合同生效日为 2007 年 11 月 11 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰沪深 300 指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年尚未进行利润分配。

§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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 78 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、国泰国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、国泰国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、国泰国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证券投资基金(LOF)(由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来, 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)、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金(LOF)、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰

民惠收益定期开放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，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、国泰保本混合、国泰策略收益灵活配置混合的基金经理	2015-04-10	-	16 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，2017 年 3 月起兼任国泰保本混合型证券投资基金和国泰策略收益灵活配置混合型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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、

不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

(七) 公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 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) 本基金管理人所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 ≥ 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。

4.3.3 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 年整体来看，A 股走势呈现为年初“熔断”大跌后持续近一年的修复性走势，大盘与中小板及创业板走势分化，结构性行情屡屡出现。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的影响，股市在 1 至 2 月份经历了一次较大幅度的下跌和震荡调整。之后随着“两会”召开，市场逐渐趋于理性，A 股随着波动率的下降呈现反弹态势，但 4 月份三大期交所出台措施

抑制市场过热后，A 股阶段性反弹见顶。进入下半年，尽管监管层针对借壳上市等题材炒作出台了一系列严厉措施，致使一系列题材股价格受到了压制，但随着风险事件尘埃落定，A 股整体估值洼地显现，加之全国基础设施建设的投资加大、PPI 回升、深港通开通等因素的利好，股指持续走高。其中，在资产荒的大背景下，新兴保险公司频频举牌，更是助推了行情的进一步展开，上证指数在 11 月底迎来了自 1 月份大幅调整以来的年内高位 3300 点，交易量也有所放大。上证综指 2016 年末报收于 3103.64 点，较年初下跌 12.31%；深证成指和创业板指数则表现更弱，全年下跌 19.64%和 27.71%；沪深 300 指数全年下跌 11.28%。行业年度表现上，在申万一级 28 个行业里表现最佳的是食品饮料和建筑材料行业，分别上涨 7.43%和 0.03%；表现最弱的行业则是传媒行业，下跌 32.39%。

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，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。本报告期本基金日均跟踪误差为 0.13%，低于基金合同规定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2016 年净值增长率为-7.82%，同期业绩比较基准收益率为-9.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然在金融去杠杆、通胀预期及汇率风险加大的情况下，持续三年多的债券牛市宣告终结，其产生的流动性趋紧影响对股票市场亦产生一定压力，但目前 A 股的估值水平和整体杠杆率仍在低位。此外，在央行货币政策逐渐回归中性的过程中，国内利率上行将会扩大中美利差并增强人民币资产的吸引力，缓解中国资本外流的压力，进而在较长的时期内利好国内资本市场。在严控系统性风险、供给侧结构性改革的背景下，随着市场预期逐渐修复，一些优质的股票将会迎来估值修复的契机，加上受益于房地产政策从紧、债市收益率空间缩窄造成的资金流入股市，A 股在未来整体有望得到资金面有力支持。行业板块上，随着供给侧结构改革预期升温和涨价逻辑发酵，国企混改、农业供给侧、有色油气以及大盘蓝筹等板块都有望在未来一段时间受益于配置型资金的进场。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情

况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20451 号

国泰沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国泰沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“国泰沪深 300 指数基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是国泰沪深 300 指数基金的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审

计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述国泰沪深 300 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了国泰沪深 300 指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
 许康玮 李一
 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
 2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	110,734,326.97	124,474,694.08
结算备付金		235,802.97	6,021.21

存出保证金		93,798.83	1,335,240.73
交易性金融资产	7.4.7.2	1,780,326,247.90	1,853,577,148.25
其中：股票投资		1,780,326,247.90	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		70,214.07	-
应收利息	7.4.7.5	21,428.12	24,598.05
应收股利		-	-
应收申购款		205,669.44	838,594.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,891,687,488.30	1,980,256,296.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		990,814.71	2,579,482.63
应付管理人报酬		813,014.20	843,376.26
应付托管费		162,602.84	168,675.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	377,281.06	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	7.4.7.8	195,865.41	421,307.76
负债合计		2,539,578.22	4,319,161.52
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,872,874,549.93	1,805,737,291.23
未分配利润	7.4.7.10	16,273,360.15	170,199,844.01
所有者权益合计		1,889,147,910.08	1,975,937,135.24
负债和所有者权益总计		1,891,687,488.30	1,980,256,296.76

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7046 元，基金份额总额 2,681,201,943.99 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-146,447,368.05	790,018,607.74
1.利息收入		865,082.84	2,966,563.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	864,947.07	1,540,713.53
债券利息收入		135.77	1,045,385.69
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）		63,532,098.96	1,635,962,561.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	24,954,466.27	1,591,741,270.12

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	57,017.87	2,069,112.64
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	38,520,614.82	42,152,178.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-211,300,808.78	-852,152,594.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	456,258.93	3,242,077.43
减：二、费用		13,785,626.83	31,455,169.15
1. 管理人报酬		9,167,265.20	16,613,919.72
2. 托管费		1,833,453.03	3,322,783.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,995,526.87	10,391,012.94
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	7.4.7.19	789,381.73	1,106,719.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-160,232,994.88	758,563,438.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-160,232,994.88	758,563,438.59

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-160,232,994.88	-160,232,994.88
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）	67,137,258.70	6,306,511.02	73,443,769.72
其中：1.基金申购款	581,596,594.34	-9,193,099.73	572,403,494.61
2.基金赎回款	-514,459,335.64	15,499,610.75	-498,959,724.89
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）	1,872,874,549.93	16,273,360.15	1,889,147,910.08
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	-	758,563,438.59	758,563,438.59
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）	-3,189,019,729.55	-689,033,366.18	-3,878,053,095.73
其中：1.基金申购款	1,156,300,267.82	148,033,572.72	1,304,333,840.54

2.基金赎回款	-4,345,319,997.37	-837,066,938.90	-5,182,386,936.27
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）	1,805,737,291.23	170,199,844.01	1,975,937,135.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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：周向勇，会计机构负责人：倪莹

7.4 报表附注

7.4.1 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 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有

能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申

购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、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，对国债、地方政府债以及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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	110,734,326.97	124,474,694.08
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	110,734,326.97	124,474,694.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,683,069,782.12	1,780,326,247.90	97,256,465.78
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		1,683,069,782.12	1,780,326,247.90	97,256,465.78
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,544,804,373.69	1,853,361,648.25	308,557,274.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	215,500.00	215,500.00	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	215,500.00	215,500.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	1,545,019,873.69	1,853,577,148.25	308,557,274.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	21,276.93	23,959.22
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	106.10	3.02
应收债券利息	-	33.06
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	2.89	1.95
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	42.20	600.80
合计	21,428.12	24,598.05

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	377,281.06	306,319.62
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	377,281.06	306,319.62

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,933.82	2,907.68
其他应付款	-	-
预提费用	100,000.00	320,000.00
应付指数使用费	93,931.59	98,400.08
合计	195,865.41	421,307.76

7.4.7.9 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 12 月 31 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	832,618,638.98	581,596,594.34
本期赎回（以“-”号填列）	-736,510,056.81	-514,459,335.64
本期末	2,681,201,943.99	1,872,874,549.93

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	51,067,813.90	-211,300,808.78	-160,232,994.88
本期基金份额交易产生的变动数	32,359,974.94	-26,053,463.92	6,306,511.02
其中：基金申购款	280,755,735.38	-289,948,835.11	-9,193,099.73
基金赎回款	-248,395,760.44	263,895,371.19	15,499,610.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	940,328,844.04	-924,055,483.89	16,273,360.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	849,434.43	1,475,780.93
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	8,870.10	29,417.62
其他	6,642.54	35,514.98
合计	864,947.07	1,540,713.53

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	684,864,567.87	4,956,707,741.03
减：卖出股票成本总额	659,910,101.60	3,364,966,470.91
买卖股票差价收入	24,954,466.27	1,591,741,270.12

7.4.7.13 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12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	334,686.70	89,945,411.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	277,500.00	85,126,020.00
减：应收利息总额	168.83	2,750,278.66
买卖债券差价收入	57,017.87	2,069,112.64

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	38,520,614.82	42,152,178.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	38,520,614.82	42,152,178.98

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-211,300,808.78	-852,152,594.44
——股票投资	-211,300,808.78	-851,962,614.44
——债券投资	-	-189,980.00
——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	-211,300,808.78	-852,152,594.44

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	416,893.28	3,064,251.65
转换费收入	39,365.65	177,825.78
合计	456,258.93	3,242,077.43

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	1,995,526.87	10,391,012.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,995,526.87	10,391,012.94

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	100,000.00	120,000.00

信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	4,491.17	3,962.64
指数使用费	366,690.56	664,556.81
债券账户服务费	18,000.00	18,000.00
上清所证书费	200.00	200.00
合计	789,381.73	1,106,719.45

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东

国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)	受基金管理人的控股股东(中国建投)控制的公司
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	69,770,949.55	4.74%	235,603,081.06	3.84%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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12月31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	64,977.72	5.51%	60,797.49	16.11%

关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	4.44%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,167,265.20	16,613,919.72
其中：支付销售机构的客户维护费	2,116,117.82	3,379,455.18

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,833,453.03	3,322,783.81

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 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 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无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31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	110,734,326.97	849,434.43	124,474,694.08	1,475,780.93

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。

7.4.10.6 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在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 4,261,463 股，估值总额为人民币 14,659,432.72 元，占基金资产净值的比例为 0.78%。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 1,239,865 股，估值总额为人民币 7,749,156.25 元，占基金资产净值的比例为 0.41%。(2015 年 12 月 31 日：无)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下新股	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	网下新股	23.16	23.16	3,491.00	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	网下新股	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	网下新股	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	网下新股	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	网下新股	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	网下新股	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	网下新股	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	网下新股	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	网下新股	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	网下新股	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	网下新股	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	网下新股	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	网下新股	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-

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。

7.4.12.2 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
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项	6.25	2017-01-26	6.29	1,239,865.00	7,272,409.06	7,749,156.25	-
300104	乐视网	2016-12-07	重大事项	32.96	2017-01-16	36.88	191,315.00	12,175,943.30	6,305,742.40	-
600649	城投控股	2016-12-06	重大事项	19.00	-	-	280,367.00	2,530,403.68	5,326,973.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.60	-	-	324,234.00	7,096,122.45	4,733,816.40	-
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项	6.97	2017-01-20	6.27	668,856.00	6,191,838.30	4,661,926.32	-
601727	上海电气	2016-08-31	重大事项	8.42	-	-	550,763.00	5,987,979.38	4,637,424.46	-
600406	国电南瑞	2016-12-29	重大事项	16.63	-	-	265,342.00	4,087,774.91	4,412,637.46	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大事项	6.22	2017-01-03	7.00	514,937.00	4,386,035.89	3,202,908.14	-
600654	中安消	2016-12-14	重大事项	17.43	-	-	144,688.00	2,788,587.42	2,521,911.84	-
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项	10.79	-	-	224,805.00	3,534,786.05	2,425,645.95	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	9.22	-	-	262,160.00	2,759,065.97	2,417,115.20	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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分别由副总经理和督察长分管，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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债

券(2015 年 12 月 31 日: 本基金持有信用类债券 0.01%)。

7.4.13.3 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。本基金所持证券均在证券交易所交易, 因此除附注 7.4.12 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, 其余均能以合理价格适时变现。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 12 月 31 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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, 并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	110,734,326.97	-	-	-	110,734,326.97
结算备付金	235,802.97	-	-	-	235,802.97
存出保证金	93,798.83	-	-	-	93,798.83
交易性金融资产	-	-	-	1,780,326,247.90	1,780,326,247.90
应收利息	-	-	-	21,428.12	21,428.12
应收证券清算款	-	-	-	70,214.07	70,214.07
应收申购款	564.15	-	-	205,105.29	205,669.44
资产总计	111,064,492.92	-	-	1,780,622,995.38	1,891,687,488.30
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	813,014.20	813,014.20
应付托管费	-	-	-	162,602.84	162,602.84
应付赎回款	-	-	-	990,814.71	990,814.71
应付交易费用	-	-	-	377,281.06	377,281.06
其他负债	-	-	-	195,865.41	195,865.41
负债总计	-	-	-	2,539,578.22	2,539,578.22
利率敏感度缺口	111,064,492.92	-	-	1,778,083,417.16	1,889,147,910.08
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账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 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 0.00%(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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	1,780,326,247.90	94.24	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	-	-	-	-
合计	1,780,326,247.90	94.24	1,853,361,648.25	93.80

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 92,052,258.36	增加约 94,681,086.17
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 92,052,258.36	减少约 94,681,086.17

7.4.14 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 12 月 31 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 1,731,451,711.65 元，属于第二层次的余额为 48,874,536.25 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)。

(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和债券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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于

2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2), 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 12 月 31 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,780,326,247.90	94.11
	其中: 股票	1,780,326,247.90	94.11
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	110,970,129.94	5.87
7	其他各项资产	391,110.46	0.02
8	合计	1,891,687,488.30	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,547,994.48	0.08
B	采矿业	57,610,840.63	3.05
C	制造业	546,911,041.09	28.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,247,177.61	2.61
E	建筑业	81,636,392.43	4.32
F	批发和零售业	35,305,927.91	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	52,095,748.23	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,682,617.92	5.38
J	金融业	633,378,496.95	33.53
K	房地产业	85,207,464.85	4.51
L	租赁和商务服务业	20,120,880.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,250,221.63	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,214,663.10	0.12
R	文化、体育和娱乐业	25,185,658.36	1.33
S	综合	7,965,409.58	0.42
	合计	1,713,360,534.77	90.69

8.2.2 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	4,493,796.00	0.24
B	采矿业	2,501,622.00	0.13
C	制造业	30,102,202.41	1.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	4,473,684.23	0.24
F	批发和零售业	2,615,080.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	892,638.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,045,335.65	0.64
J	金融业	3,489,010.00	0.18
K	房地产业	6,304,968.50	0.33
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	-	-

S	综合	-	-
	合计	66,965,713.13	3.54

8.3 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

8.3.1 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	2,080,137	73,699,253.91	3.90
2	601166	兴业银行	2,588,737	41,782,215.18	2.21
3	600016	民生银行	4,552,300	41,334,884.00	2.19
4	600036	招商银行	1,989,234	35,010,518.40	1.85
5	600519	贵州茅台	96,294	32,176,640.10	1.70
6	601328	交通银行	5,428,988	31,325,260.76	1.66
7	601668	中国建筑	3,143,768	27,853,784.48	1.47
8	600000	浦发银行	1,629,829	26,419,528.09	1.40
9	000333	美的集团	903,350	25,447,369.50	1.35
10	000002	万科 A	1,232,581	25,329,539.55	1.34
11	000651	格力电器	961,216	23,665,137.92	1.25
12	601288	农业银行	7,622,466	23,629,644.60	1.25
13	600837	海通证券	1,494,389	23,536,626.75	1.25
14	600030	中信证券	1,457,751	23,411,481.06	1.24
15	601169	北京银行	2,272,485	22,179,453.60	1.17
16	600887	伊利股份	1,152,647	20,286,587.20	1.07
17	601398	工商银行	4,311,605	19,014,178.05	1.01
18	601766	中国中车	1,680,613	16,419,589.01	0.87
19	601211	国泰君安	878,952	16,339,717.68	0.86
20	601601	中国太保	587,903	16,326,066.31	0.86
21	600900	长江电力	1,239,134	15,687,436.44	0.83
22	600104	上汽集团	653,861	15,333,040.45	0.81
23	000001	平安银行	1,658,360	15,091,076.00	0.80
24	601988	中国银行	4,261,463	14,659,432.72	0.78
25	601818	光大银行	3,491,395	13,651,354.45	0.72
26	000725	京东方 A	4,559,968	13,041,508.48	0.69
27	600048	保利地产	1,409,259	12,866,534.67	0.68
28	601390	中国中铁	1,391,793	12,331,285.98	0.65
29	000858	五粮液	356,347	12,286,844.56	0.65
30	600050	中国联通	1,658,953	12,126,946.43	0.64
31	601989	中国重工	1,696,723	12,029,766.07	0.64
32	600015	华夏银行	1,084,565	11,767,530.25	0.62

33	600276	恒瑞医药	255,662	11,632,621.00	0.62
34	601688	华泰证券	613,168	10,951,180.48	0.58
35	600028	中国石化	1,986,773	10,748,441.93	0.57
36	601186	中国铁建	874,555	10,459,677.80	0.55
37	600518	康美药业	570,565	10,184,585.25	0.54
38	000776	广发证券	558,668	9,419,142.48	0.50
39	002450	康得新	482,307	9,216,886.77	0.49
40	600958	东方证券	579,467	8,999,122.51	0.48
41	002415	海康威视	359,998	8,571,552.38	0.45
42	002304	洋河股份	119,476	8,435,005.60	0.45
43	601939	建设银行	1,516,346	8,248,922.24	0.44
44	601009	南京银行	750,678	8,137,349.52	0.43
45	601377	兴业证券	1,049,380	8,027,757.00	0.42
46	601006	大秦铁路	1,129,731	7,998,495.48	0.42
47	002024	苏宁云商	694,827	7,955,769.15	0.42
48	601628	中国人寿	325,386	7,838,548.74	0.41
49	000166	申万宏源	1,239,865	7,749,156.25	0.41
50	000538	云南白药	100,022	7,616,675.30	0.40
51	000063	中兴通讯	476,000	7,592,200.00	0.40
52	001979	招商蛇口	452,462	7,415,852.18	0.39
53	002736	国信证券	475,667	7,396,621.85	0.39
54	601857	中国石油	907,103	7,211,468.85	0.38
55	601901	方正证券	948,001	7,204,807.60	0.38
56	002142	宁波银行	424,101	7,057,040.64	0.37
57	601336	新华保险	161,142	7,054,796.76	0.37
58	601899	紫金矿业	2,080,108	6,947,560.72	0.37
59	000783	长江证券	678,715	6,943,254.45	0.37
60	600585	海螺水泥	408,458	6,927,447.68	0.37
61	600795	国电电力	2,180,097	6,910,907.49	0.37
62	600999	招商证券	418,758	6,838,318.14	0.36
63	000625	长安汽车	457,694	6,837,948.36	0.36
64	300059	东方财富	389,933	6,601,565.69	0.35
65	601099	太平洋	1,269,102	6,535,875.30	0.35
66	601669	中国电建	885,382	6,427,873.32	0.34
67	600019	宝钢股份	995,568	6,321,856.80	0.33
68	300104	乐视网	191,315	6,305,742.40	0.33
69	600690	青岛海尔	632,806	6,252,123.28	0.33
70	601088	中国神华	381,195	6,167,735.10	0.33
71	601985	中国核电	857,302	6,052,552.12	0.32
72	601555	东吴证券	446,243	5,921,644.61	0.31
73	300070	碧水源	337,876	5,919,587.52	0.31
74	600029	南方航空	839,357	5,892,286.14	0.31
75	600886	国投电力	883,141	5,890,550.47	0.31
76	000503	海虹控股	137,854	5,796,760.70	0.31

77	601788	光大证券	361,060	5,773,349.40	0.31
78	600705	中航资本	926,320	5,669,078.40	0.30
79	600637	东方明珠	240,284	5,598,617.20	0.30
80	600383	金地集团	425,163	5,510,112.48	0.29
81	600718	东软集团	278,598	5,477,236.68	0.29
82	000768	中航飞机	256,835	5,460,312.10	0.29
83	600089	特变电工	597,517	5,455,330.21	0.29
84	600109	国金证券	412,888	5,379,930.64	0.28
85	002673	西部证券	257,377	5,345,720.29	0.28
86	600649	城投控股	280,367	5,326,973.00	0.28
87	000423	东阿阿胶	97,757	5,266,169.59	0.28
88	601600	中国铝业	1,240,988	5,236,969.36	0.28
89	600547	山东黄金	141,222	5,156,015.22	0.27
90	002202	金风科技	299,986	5,132,760.46	0.27
91	600535	天士力	123,571	5,126,960.79	0.27
92	600010	包钢股份	1,824,423	5,090,140.17	0.27
93	600023	浙能电力	929,750	5,048,542.50	0.27
94	600068	葛洲坝	544,307	5,002,181.33	0.26
95	600703	三安光电	372,532	4,988,203.48	0.26
96	600111	北方稀土	405,124	4,970,871.48	0.26
97	002594	比亚迪	99,962	4,966,112.16	0.26
98	002456	欧菲光	143,969	4,935,257.32	0.26
99	600660	福耀玻璃	264,696	4,931,286.48	0.26
100	600309	万华化学	224,376	4,830,815.28	0.26
101	600066	宇通客车	243,211	4,764,503.49	0.25
102	600485	信威集团	324,234	4,733,816.40	0.25
103	601618	中国中冶	1,010,207	4,707,564.62	0.25
104	000686	东北证券	379,578	4,691,584.08	0.25
105	600009	上海机场	176,811	4,689,027.72	0.25
106	600100	同方股份	338,072	4,682,297.20	0.25
107	000750	国海证券	668,856	4,661,926.32	0.25
108	600340	华夏幸福	195,055	4,661,814.50	0.25
109	601607	上海医药	237,191	4,639,455.96	0.25
110	601727	上海电气	550,763	4,637,424.46	0.25
111	002241	歌尔股份	174,438	4,626,095.76	0.24
112	002739	万达院线	85,445	4,620,011.15	0.24
113	000623	吉林敖东	148,990	4,617,200.10	0.24
114	600804	鹏博士	209,730	4,599,378.90	0.24
115	600741	华域汽车	287,701	4,588,830.95	0.24
116	600893	中航动力	140,092	4,586,612.08	0.24
117	600196	复星医药	197,769	4,576,374.66	0.24
118	000839	中信国安	497,387	4,566,012.66	0.24
119	600031	三一重工	744,693	4,542,627.30	0.24
120	002230	科大讯飞	167,561	4,539,227.49	0.24

121	000100	TCL 集团	1,369,282	4,518,630.60	0.24
122	600115	东方航空	636,506	4,500,097.42	0.24
123	300017	网宿科技	83,057	4,452,685.77	0.24
124	600406	国电南瑞	265,342	4,412,637.46	0.23
125	601800	中国交建	289,796	4,402,001.24	0.23
126	600674	川投能源	504,240	4,386,888.00	0.23
127	000568	泸州老窖	132,136	4,360,488.00	0.23
128	000728	国元证券	219,055	4,359,194.50	0.23
129	000895	双汇发展	207,824	4,349,756.32	0.23
130	600415	小商品城	500,906	4,332,836.90	0.23
131	000338	潍柴动力	433,825	4,320,897.00	0.23
132	300024	机器人	201,167	4,300,950.46	0.23
133	002252	上海莱士	186,150	4,298,203.50	0.23
134	000793	华闻传媒	379,366	4,283,042.14	0.23
135	601198	东兴证券	212,883	4,270,432.98	0.23
136	000069	华侨城 A	606,491	4,215,112.45	0.22
137	600606	绿地控股	483,004	4,206,964.84	0.22
138	002236	大华股份	307,469	4,206,175.92	0.22
139	000009	中国宝安	400,874	4,153,054.64	0.22
140	600570	恒生电子	87,947	4,145,821.58	0.22
141	000630	铜陵有色	1,337,472	4,119,413.76	0.22
142	600816	安信信托	173,636	4,101,282.32	0.22
143	002065	东华软件	174,949	4,076,311.70	0.22
144	600352	浙江龙盛	442,568	4,076,051.28	0.22
145	600739	辽宁成大	226,333	4,064,940.68	0.22
146	600221	海南航空	1,246,565	4,063,801.90	0.22
147	600271	航天信息	202,437	4,038,618.15	0.21
148	601111	中国国航	556,634	4,007,764.80	0.21
149	600867	通化东宝	182,389	3,999,790.77	0.21
150	600177	雅戈尔	286,003	3,998,321.94	0.21
151	600369	西南证券	559,195	3,987,060.35	0.21
152	601998	中信银行	611,746	3,921,291.86	0.21
153	601888	中国国旅	89,761	3,895,627.40	0.21
154	600489	中金黄金	321,136	3,882,534.24	0.21
155	000413	东旭光电	344,712	3,881,457.12	0.21
156	600820	隧道股份	348,413	3,836,027.13	0.20
157	000157	中联重科	832,930	3,781,502.20	0.20
158	600157	永泰能源	929,694	3,728,072.94	0.20
159	002007	华兰生物	103,915	3,714,961.25	0.20
160	601018	宁波港	729,679	3,692,175.74	0.20
161	002465	海格通信	316,670	3,689,205.50	0.20
162	601933	永辉超市	750,949	3,687,159.59	0.20
163	601919	中远海控	700,341	3,669,786.84	0.19
164	600150	中国船舶	132,621	3,661,665.81	0.19

165	300124	汇川技术	175,806	3,574,135.98	0.19
166	002008	大族激光	155,536	3,515,113.60	0.19
167	600118	中国卫星	110,706	3,458,455.44	0.18
168	000060	中金岭南	308,628	3,441,202.20	0.18
169	600005	武钢股份	1,005,306	3,428,093.46	0.18
170	000963	华东医药	46,832	3,375,182.24	0.18
171	600170	上海建工	711,806	3,366,842.38	0.18
172	600959	江苏有线	297,482	3,361,546.60	0.18
173	300027	华谊兄弟	303,702	3,340,722.00	0.18
174	300315	掌趣科技	360,269	3,328,885.56	0.18
175	300058	蓝色光标	326,095	3,316,386.15	0.18
176	600153	建发股份	309,366	3,310,216.20	0.18
177	002081	金螳螂	331,885	3,249,154.15	0.17
178	600085	同仁堂	102,297	3,210,079.86	0.17
179	000540	中天城投	514,937	3,202,908.14	0.17
180	601333	广深铁路	630,941	3,198,870.87	0.17
181	600688	上海石化	493,688	3,179,350.72	0.17
182	002475	立讯精密	152,853	3,171,699.75	0.17
183	600061	国投安信	202,905	3,167,347.05	0.17
184	000876	新希望	389,373	3,134,452.65	0.17
185	000826	启迪桑德	94,467	3,115,521.66	0.16
186	600018	上港集团	595,395	3,048,422.40	0.16
187	000917	电广传媒	210,879	3,034,548.81	0.16
188	600663	陆家嘴	136,508	3,020,922.04	0.16
189	600583	海油工程	404,811	2,987,505.18	0.16
190	002183	怡亚通	272,361	2,957,840.46	0.16
191	600839	四川长虹	705,454	2,948,797.72	0.16
192	000559	万向钱潮	212,167	2,813,334.42	0.15
193	600373	中文传媒	139,236	2,812,567.20	0.15
194	600588	用友网络	134,710	2,804,662.20	0.15
195	600256	广汇能源	589,171	2,751,428.57	0.15
196	603993	洛阳钼业	732,748	2,725,822.56	0.14
197	601718	际华集团	295,569	2,722,190.49	0.14
198	601633	长城汽车	246,030	2,721,091.80	0.14
199	600060	海信电器	158,611	2,715,420.32	0.14
200	600362	江西铜业	161,237	2,697,495.01	0.14
201	300168	万达信息	132,715	2,683,497.30	0.14
202	002385	大北农	377,208	2,678,176.80	0.14
203	000709	河钢股份	801,156	2,675,861.04	0.14
204	600037	歌华有线	173,906	2,664,239.92	0.14
205	000792	盐湖股份	138,756	2,646,076.92	0.14
206	600208	新潮中宝	635,542	2,643,854.72	0.14
207	000425	徐工机械	779,336	2,634,155.68	0.14
208	300144	宋城演艺	123,401	2,584,016.94	0.14

209	600895	张江高科	144,135	2,554,072.20	0.14
210	600332	白云山	104,732	2,511,473.36	0.13
211	601928	凤凰传媒	238,514	2,497,241.58	0.13
212	002500	山西证券	206,723	2,484,810.46	0.13
213	000415	渤海金控	346,209	2,475,394.35	0.13
214	002146	荣盛发展	314,379	2,467,875.15	0.13
215	601258	庞大集团	884,119	2,449,009.63	0.13
216	300002	神州泰岳	264,477	2,443,767.48	0.13
217	601216	君正集团	524,347	2,438,213.55	0.13
218	600737	中粮屯河	195,090	2,430,821.40	0.13
219	600875	东方电气	224,805	2,425,645.95	0.13
220	002129	中环股份	262,160	2,417,115.20	0.13
221	601866	中远海发	590,238	2,408,171.04	0.13
222	600873	梅花生物	366,945	2,392,481.40	0.13
223	002470	金正大	300,578	2,374,566.20	0.13
224	000977	浪潮信息	111,666	2,367,319.20	0.13
225	600074	保千里	178,676	2,365,670.24	0.13
226	600252	中恒集团	511,572	2,342,999.76	0.12
227	600376	首开股份	194,444	2,296,383.64	0.12
228	600666	奥瑞德	84,497	2,277,194.15	0.12
229	600446	金证股份	90,043	2,262,780.59	0.12
230	000402	金融街	219,360	2,259,408.00	0.12
231	600827	百联股份	155,917	2,238,968.12	0.12
232	600704	物产中大	214,454	2,215,309.82	0.12
233	300015	爱尔眼科	74,069	2,214,663.10	0.12
234	601872	招商轮船	446,937	2,207,868.78	0.12
235	000778	新兴铸管	418,760	2,164,989.20	0.11
236	002292	奥飞娱乐	94,041	2,134,730.70	0.11
237	000039	中集集团	145,331	2,124,739.22	0.11
238	000712	锦龙股份	88,043	2,063,727.92	0.11
239	000738	中航动控	83,273	2,060,174.02	0.11
240	002195	二三四五	178,769	2,023,665.08	0.11
241	600038	中直股份	41,733	2,020,711.86	0.11
242	002152	广电运通	149,334	1,983,155.52	0.10
243	000156	华数传媒	109,670	1,964,189.70	0.10
244	600021	上海电力	158,060	1,918,848.40	0.10
245	603000	人民网	105,793	1,868,304.38	0.10
246	600372	中航电子	99,262	1,842,302.72	0.10
247	600685	中船防务	61,899	1,838,400.30	0.10
248	300146	汤臣倍健	152,843	1,824,945.42	0.10
249	600008	首创股份	443,718	1,823,680.98	0.10
250	601225	陕西煤业	365,315	1,771,777.75	0.09
251	600582	天地科技	351,505	1,746,979.85	0.09
252	300251	光线传媒	169,105	1,650,464.80	0.09

253	000800	一汽轿车	150,299	1,633,750.13	0.09
254	601021	春秋航空	43,520	1,598,924.80	0.08
255	002027	分众传媒	110,639	1,578,818.53	0.08
256	000061	农产品	126,433	1,563,976.21	0.08
257	601118	海南橡胶	222,413	1,547,994.48	0.08
258	000027	深圳能源	222,383	1,527,771.21	0.08
259	002424	贵州百灵	77,167	1,461,542.98	0.08
260	002153	石基信息	59,172	1,442,021.64	0.08
261	300133	华策影视	126,291	1,433,402.85	0.08
262	601958	金钼股份	181,477	1,388,299.05	0.07
263	600648	外高桥	69,398	1,369,916.52	0.07
264	601608	中信重工	242,059	1,357,950.99	0.07
265	600871	石化油服	330,902	1,356,698.20	0.07
266	600783	鲁信创投	55,627	1,258,282.74	0.07
267	603885	吉祥航空	48,071	1,120,054.30	0.06
268	300085	银之杰	50,993	1,065,753.70	0.06
269	600188	兖州煤业	72,512	787,480.32	0.04
270	002568	百润股份	32,997	667,859.28	0.04

8.3.2 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	300072	三聚环保	112,112	5,189,664.48	0.27
2	002466	天齐锂业	119,592	3,880,760.40	0.21
3	002085	万丰奥威	165,595	3,272,157.20	0.17
4	002310	东方园林	200,500	2,837,075.00	0.15
5	002714	牧原股份	119,200	2,774,976.00	0.15
6	002426	胜利精密	334,900	2,769,623.00	0.15
7	300033	同花顺	39,000	2,682,420.00	0.14
8	000718	苏宁环球	305,450	2,636,033.50	0.14
9	600297	广汇汽车	305,500	2,615,080.00	0.14
10	600654	中安消	144,688	2,521,911.84	0.13
11	000983	西山煤电	295,700	2,501,622.00	0.13
12	002074	国轩高科	80,400	2,491,596.00	0.13
13	600498	烽火通信	95,648	2,411,286.08	0.13
14	002049	紫光国芯	71,200	2,345,328.00	0.12
15	600482	中国动力	67,200	2,052,288.00	0.11
16	300182	捷成股份	198,031	2,041,699.61	0.11
17	601155	新城控股	169,800	1,995,150.00	0.11
18	002131	利欧股份	118,500	1,890,075.00	0.10
19	000627	天茂集团	240,600	1,840,590.00	0.10
20	002299	圣农发展	81,000	1,718,820.00	0.09

21	000671	阳光城	300,500	1,673,785.00	0.09
22	601877	正泰电器	82,300	1,646,000.00	0.09
23	601611	中国核建	94,300	1,621,017.00	0.09
24	002174	游族网络	60,800	1,608,160.00	0.09
25	000938	紫光股份	27,000	1,549,530.00	0.08
26	002797	第一创业	44,300	1,541,640.00	0.08
27	000008	神州高铁	152,200	1,418,504.00	0.08
28	000555	神州信息	49,900	1,059,377.00	0.06
29	600754	锦江股份	30,300	892,638.00	0.05
30	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
31	601127	小康股份	6,500	173,810.00	0.01
32	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
33	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
34	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
35	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
36	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
37	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
38	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
39	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
40	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
41	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
42	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
43	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
44	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
45	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
46	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
47	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
48	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
49	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
50	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
51	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
52	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
53	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
54	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
55	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
56	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	19,045,722.97	0.96
2	601988	中国银行	16,835,664.58	0.85
3	600016	民生银行	13,818,752.18	0.70
4	601211	国泰君安	13,084,243.01	0.66
5	000333	美的集团	12,539,650.23	0.63
6	601166	兴业银行	11,767,087.50	0.60
7	601328	交通银行	11,367,755.68	0.58
8	000166	申万宏源	9,752,319.50	0.49
9	601668	中国建筑	9,741,626.71	0.49
10	600000	浦发银行	9,317,249.32	0.47
11	600036	招商银行	9,054,710.53	0.46
12	601009	南京银行	9,039,032.70	0.46
13	600958	东方证券	7,849,981.33	0.40
14	601398	工商银行	7,352,065.00	0.37
15	601288	农业银行	7,190,561.00	0.36
16	600816	安信信托	6,987,142.16	0.35
17	601818	光大银行	6,958,301.00	0.35
18	600900	长江电力	6,900,164.41	0.35
19	601169	北京银行	6,577,388.23	0.33
20	002739	万达院线	6,330,481.01	0.32

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。

8.4.2 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	23,660,576.56	1.20
2	601318	中国平安	18,290,964.89	0.93
3	600000	浦发银行	14,752,256.79	0.75
4	601166	兴业银行	10,764,353.38	0.54
5	600011	华能国际	9,380,388.81	0.47
6	601009	南京银行	8,733,237.06	0.44
7	600036	招商银行	8,591,728.38	0.43
8	601668	中国建筑	8,118,975.46	0.41
9	000002	万科A	7,465,099.10	0.38
10	601169	北京银行	7,072,402.51	0.36
11	600030	中信证券	6,689,724.89	0.34

12	601398	工商银行	6,485,475.51	0.33
13	600519	贵州茅台	6,483,524.33	0.33
14	600837	海通证券	6,269,131.62	0.32
15	601288	农业银行	6,138,152.00	0.31
16	601328	交通银行	5,853,926.55	0.30
17	600887	伊利股份	5,496,077.70	0.28
18	000651	格力电器	5,280,853.14	0.27
19	601818	光大银行	5,175,577.57	0.26
20	600637	东方明珠	4,948,851.95	0.25

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。

8.4.3 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	798,929,312.97
卖出股票的收入（成交）总额	684,864,567.87

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	93,798.83
2	应收证券清算款	70,214.07
3	应收股利	-
4	应收利息	21,428.12
5	应收申购款	205,669.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	391,110.46
---	----	------------

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
94,094	28,494.93	2,531,435,571.38	94.41%	149,766,372.61	5.59%

9.2 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	1,085,263.59	0.04%

9.3 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

§10 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	832,618,638.98
减：本报告期基金总赎回份额	736,510,056.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,681,201,943.99

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

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。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 100,000 元，目前的审计机构已提供审计服务的年限为 10 年。

11.6 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、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	638,673,021.41	43.38%	467,062.22	39.58%	-
银河证券	1	237,152,334.56	16.11%	220,860.79	18.72%	-
安信证券	1	149,743,101.88	10.17%	139,455.52	11.82%	-
东方证券	1	133,570,690.54	9.07%	97,680.72	8.28%	-
中信建投	3	104,386,136.42	7.09%	88,485.72	7.50%	-
长江证券	1	73,910,864.65	5.02%	54,051.39	4.58%	-
申万宏源	1	69,770,949.55	4.74%	64,977.72	5.51%	-
国金证券	1	63,120,178.39	4.29%	46,160.26	3.91%	-
中金证券	2	1,805,815.23	0.12%	1,320.61	0.11%	-

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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	86,215.20	25.76%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	248,471.50	74.24%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	公司官网	2016-01-04

	安排的临时公告		
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》	2016-03-19
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	国泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-06-18
15	国泰基金管理有限公司关于旗下香港子公司国泰全球投资有限公司开展业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-07-09
16	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
17	国泰基金管理有限公司关于调整旗下部分基金产品网上直销渠道申购金额下限及最低持有金额下限的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-08-02
18	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估	《中国证券报》、《上海	2016-08-16

	值方法的公告	证券报》、《证券时报》	
19	国泰基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金单笔申购、定期定额投资最低金额限制及单笔赎回、转换最低份额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2016-09-23
20	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》	2016-10-12
21	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》	2016-11-30
22	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》	2016-12-14
23	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》	2016-12-21
24	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》	2016-12-27

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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 层-19 层

12.3 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

二〇一七年三月二十八日