

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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说明.....	10
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
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说 明	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	32
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	40
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	40

7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	40
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	40
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	40
7.11	投资组合报告附注	41
8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
9	开放式基金份额变动	42
10	重大事件揭示	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	其他重大事件	44
11	影响投资者决策的其他重要信息	44
12	备查文件目录	45
12.1	备查文件目录	45
12.2	存放地点	45
12.3	查阅方式	45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰纳斯达克100指数证券投资基金
基金简称	国泰纳斯达克100指数（QDII）
基金主代码	160213
交易代码	160213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月29日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	274,528,739.70份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对纳斯达克100 指数（Nasdaq-100 Index，以下简称“标的指数”）的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况导致基金无法及时获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差不超过0.5%，年跟踪误差不超过5%（注：以美元资产计价计算）。
业绩比较基准	纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）收益率（总收益指数收益率）（注：以美元计价计算）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	尹东
	联系电话	021-38561600 转	010-67595003
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		(021) 38569000, 400-888-8688	010-67595096
传真		021-38561800	010-66275853
注册地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈勇胜	王洪章

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮政编码		02111

2.5 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》
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-864,025.08
本期利润	32,156,578.97
加权平均基金份额本期利润	0.1239
本期加权平均净值利润率	10.75%
本期基金份额净值增长率	13.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,743,111.69
期末可供分配基金份额利润	-0.0063
期末基金资产净值	316,614,903.24
期末基金份额净值	1.153
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	23.46%

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	3.04%	1.34%	3.67%	1.43%	-0.63%	-0.09%
过去三个月	-4.00%	1.13%	-4.79%	1.25%	0.79%	-0.12%
过去六个月	13.63%	0.93%	15.44%	1.03%	-1.81%	-0.10%
过去一年	8.37%	1.46%	13.72%	1.57%	-5.35%	-0.11%
自基金合同生效起至今	23.46%	1.13%	32.96%	1.39%	-9.50%	-0.26%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 4 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：(1) 本基金合同生效日为 2010 年 4 月 29 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。

(2) 同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 23 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券

投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。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		
崔涛	本基金的基金经理、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）的基金经理、国际业务部总监助理	2011-05-11	-	8	硕士研究生。曾任职于 Paloma Partners 资产管理公司、富通银行（纽约）。2009 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，任高级经理（量化研究方向），从事量化及衍生品投资、指数基金和 ETF 的投资研究以及境外市场投资研究。2011 年 5 月起任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理，2011 年 5 月起任国际业务部总监助理，2012 年

					5 月起任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)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，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年第一季度，美国的消费、就业、制造业等宏观经济数据持续良好，打消了投资

者对于经济复苏前景的担忧,推动纳斯达克 100 指数一路上扬,第一季度上涨幅度达 21.24%。而自进入第二季度以来,随着欧洲债务危机重燃,在强烈的避险情绪下,风险资产遭到大抛,欧美股市均有较大幅度的回调,纳斯达克 100 指数也下跌逾 10%。直到进入 6 月份,随着希腊大选和欧盟峰会的良好结果,避险情绪开始缓和,股票等风险资产价格展开反弹。整个报告期内纳斯达克 100 全收益指数上涨 15.44%。

本报告期内,如统一以美元资产计价计算,本基金日均跟踪误差为 0.10%,对应年化跟踪误差为 1.60%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 5%的限制。跟踪误差主要来源为股票组合最高仓位限制以及申购赎回的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2012 年上半年的净值增长率为 13.63%,同期业绩比较基准收益率为 15.44%,差异主要由于美元兑人民币汇率变化所致(注:同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应)。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

欧洲债务问题的反复是近两年来影响海外市场走势的重要因素。在避险情绪推动下,大量资金涌入美国国债,已经把美国国债收益率压至难以持续的低位。而随着 6 月底落幕的欧盟峰会出人意料地取得了良好成果,显示欧盟各国在关键时刻仍然愿意让步、避免事态恶化的态度。我们认为欧洲债务问题后续虽仍然会有反复,但全面恶化的可能性非常小。随着避险情绪的缓和,资金将逐步回流至风险资产,而和欧洲市场、新兴市场相比,宏观经济复苏态势相对最为良好的美国市场将是资金的首选,有望带动美国股市的反弹。

就美国宏观经济状况而言,我们认为虽然欧债危机的持续动荡和新兴市场的增速放缓对美国宏观经济造成了一定影响,导致二季度以来的经济数据较一季度有所回落,但美国宏观经济复苏的内生动力仍在,如外围市场没有极端风险事件,美国经济仍能温和复苏。近期的宏观经济数据整体而言喜忧参半,制造业仍处于扩张态势,房地产有所回暖,市场的担忧主要来自于就业数据已经连续三个月低于市场预期。而就业数据持续低迷有其结构性原因,如季节因素、产业结构调整等。事实上,尽管美国就业人口占总人口比重为近二十年最低,但企业的利润率却达到历史新高,显示就业数据的疲软并不意味着美国经济复苏遇阻。作为美国经济核心竞争力的高科技、创新行业将更大程度的从此次经济复苏中获益。因此,对纳斯达克 100 指数的中长期走势,我们维持较为乐观的态度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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

本基金已于 2012 年实施利润分配 10,428,214.84 元。

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 10,428,214.84 元。

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

本托管人复核审查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。

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：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	29,496,692.67	22,652,101.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	289,195,436.58	214,949,475.87
其中：股票投资		258,394,792.75	209,848,676.79
基金投资		30,800,643.83	5,100,799.08
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,111.21	3,658.40
应收股利		210,397.29	142,491.77
应收申购款		787,020.16	483,627.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	47,493.04	47,312.83
资产总计		319,740,150.95	238,278,667.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	2,598,848.86
应付赎回款		2,727,868.18	983,320.86
应付管理人报酬		200,205.72	157,283.49
应付托管费		62,564.28	49,151.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	134,609.53	198,889.39
负债合计		3,125,247.71	3,987,493.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	274,528,739.70	223,053,894.90
未分配利润	6.4.7.10	42,086,163.54	11,237,278.86
所有者权益合计		316,614,903.24	234,291,173.76
负债和所有者权益总计		319,740,150.95	238,278,667.47

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.153 元，基金份额总额 274,528,739.70 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		33,900,623.87	3,659,691.75
1.利息收入		85,599.33	72,838.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	85,599.33	72,838.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		724,390.06	11,243,502.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-539,321.56	10,419,468.08
基金投资收益	6.4.7.13	-	-140,541.18
债券投资收益	6.4.7.14	-	-

资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,263,711.62	964,575.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	33,020,604.05	-7,420,501.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-82,644.00	-391,194.89
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	152,674.43	155,046.60
减：二、费用		1,744,044.90	1,811,264.60
1. 管理人报酬		1,180,903.03	1,180,868.34
2. 托管费		369,032.20	369,021.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	22,985.80	91,467.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	171,123.87	169,906.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,156,578.97	1,848,427.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,156,578.97	1,848,427.15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	223,053,894.90	11,237,278.86	234,291,173.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,156,578.97	32,156,578.97
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）	51,474,844.80	9,120,520.55	60,595,365.35
其中：1. 基金申购款	168,637,926.41	28,309,478.52	196,947,404.93

2. 基金赎回款	-117,163,081.61	-19,188,957.97	-136,352,039.58
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）	-	-10,428,214.84	-10,428,214.84
五、期末所有者权益（基金净值）	274,528,739.70	42,086,163.54	316,614,903.24
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	206,301,326.87	25,009,065.67	231,310,392.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,848,427.15	1,848,427.15
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）	62,343,364.90	10,025,605.34	72,368,970.24
其中：1. 基金申购款	176,252,955.29	24,212,135.65	200,465,090.94
2. 基金赎回款	-113,909,590.39	-14,186,530.31	-128,096,120.70
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）	-	-9,754,110.29	-9,754,110.29
五、期末所有者权益（基金净值）	268,644,691.77	27,128,987.87	295,773,679.64

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 208 号《关于核准国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集

不包括认购资金利息共募集人民币 555,798,507.70 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 098 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 555,982,545.46 份基金份额,其中认购资金利息折合 184,037.76 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为道富银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰纳斯达克 100 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 Nasdaq-100 指数成份股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的、以 Nasdaq-100 指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)(以下简称“目标基金”)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%;本基金至少 80%的资产投资于 Nasdaq-100 指数的成份股和目标基金,其中,本基金持有的目标基金的市值合计不超过本基金资产净值的 10%。本基金的业绩比较基准为:纳斯达克 100 指数(Nasdaq-100 Index)收益率(总收益指数收益率)。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

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《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》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	29,496,692.67
定期存款	-
其他存款	-
合计	29,496,692.67

注:于本报告期末,活期存款包括人民币活期存款 17,209,085.47 元,美元活期存款 1,942,735.41 元(折合人民币 12,287,607.20 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	220,348,336.75	258,394,792.75	38,046,456.00
债券交易所市场	-	-	-
债券银行间市场	-	-	-

债券合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	29,665,798.05	30,800,643.83	1,134,845.78
其他	-	-	-
合计	250,014,134.80	289,195,436.58	39,181,301.78

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 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,097.28
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	13.93
其他	-
合计	3,111.21

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
其他应收款	47,493.04
待摊费用	-
合计	47,493.04

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,056.38
预提费用	79,561.30
指数使用费	46,991.85
合计	134,609.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,053,894.90	223,053,894.90
本期申购	168,637,926.41	168,637,926.41
本期赎回（以“-”号填列）	-117,163,081.61	-117,163,081.61
本期末	274,528,739.70	274,528,739.70

注：申购含红利再投。

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	8,013,192.87	3,224,085.99	11,237,278.86
本期利润	-864,025.08	33,020,604.05	32,156,578.97
本期基金份额交易产生的变动数	1,535,935.36	7,584,585.19	9,120,520.55
其中：基金申购款	2,986,360.18	25,323,118.34	28,309,478.52
基金赎回款	-1,450,424.82	-17,738,533.15	-19,188,957.97
本期已分配利润	-10,428,214.84	-	-10,428,214.84
本期末	-1,743,111.69	43,829,275.23	42,086,163.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	84,651.99
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	-
其他	947.34
合计	85,599.33

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,510,072.61
减：卖出股票成本总额	12,049,394.17
买卖股票差价收入	-539,321.56

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,157,428.94
基金投资产生的股利收益	106,282.68
合计	1,263,711.62

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	33,020,604.05
——股票投资	31,899,843.17
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,120,760.88
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	33,020,604.05

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	147,062.67
其它	5,611.76

合计	152,674.43
----	------------

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	22,985.80
银行间市场交易费用	-
合计	22,985.80

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	49,726.04
指数使用费	88,567.71
银行汇划费用	1,435.75
注册费	1,559.11
合计	171,123.87

注：根据《国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》，本基金的指数使用费从基金财产中列支。在通常情况下，指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.06% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：

每日指数使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.06% / 当年天数。

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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期和本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
道富银行（State Street Bank and Trust Company）	境外资产托管人

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,180,903.03	1,180,868.34
其中：支付销售机构的客户维护费	390,371.76	214,057.88

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 0.8% 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 × 0.8% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	369,032.20	369,021.41

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 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

本基金本报告期末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

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	-	20,000,750.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	-	20,000,750.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	7.45%

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	17,209,577.55	83,949.25	10,095,950.26	69,194.92
美国道富银行	12,287,115.12	702.74	7,273,643.90	677.43

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	利润分配 合计	备
1	2012-03-07	2012-03-06	0.400	6,629,286.79	3,798,928.05	10,428,214.84	-
合计	-	-	0.400	6,629,286.79	3,798,928.05	10,428,214.84	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

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

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止, 本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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基金投资等。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。本基金属于股票型基金, 预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金, 跟踪标的指数市场表现, 目标为获取市场平均收益, 是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

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

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

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同责任, 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。

本公司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建设银行以及境外次托管行道富银行, 因而与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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算, 因此信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险, 且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日, 本基金未持有信用类债券 (2011 年 12 月 31 日, 同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的

基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市,均能以合理价格适时变现。

本基金所持有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。

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,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款,面临的利率风险很有限。市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,496,692.67	-	-	-	29,496,692.67
交易性金融资产	-	-	-	289,195,436.58	289,195,436.58
应收利息	-	-	-	3,111.21	3,111.21
应收股利	-	-	-	210,397.29	210,397.29
应收申购款	74,167.12	-	-	712,853.04	787,020.16
其他资产	-	-	-	47,493.04	47,493.04
资产总计	29,570,859.79	-	-	290,169,291.16	319,740,150.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,727,868.18	2,727,868.18
应付管理人报酬	-	-	-	200,205.72	200,205.72
应付托管费	-	-	-	62,564.28	62,564.28
其他负债	-	-	-	134,609.53	134,609.53

负债总计	-	-	-	3,125,247.71	3,125,247.71
利率敏感度缺口	29,570,859.79	-	-	287,044,043.45	316,614,903.24
上年度末2011年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,652,101.14	-	-	-	22,652,101.14
交易性金融资产	-	-	-	214,949,475.87	214,949,475.87
应收利息	-	-	-	3,658.40	3,658.40
应收股利	-	-	-	142,491.77	142,491.77
应收申购款	67,990.13	-	-	415,637.33	483,627.46
其他资产	-	-	-	47,312.83	47,312.83
资产总计	22,720,091.27	-	-	215,558,576.20	238,278,667.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	983,320.86	983,320.86
应付管理人报酬	-	-	-	157,283.49	157,283.49
应付托管费	-	-	-	49,151.11	49,151.11
其他负债	-	-	-	198,889.39	198,889.39
应付证券清算款	-	-	-	2,598,848.86	2,598,848.86
负债总计	-	-	-	3,987,493.71	3,987,493.71
利率敏感度缺口	22,720,091.27	-	-	211,571,082.49	234,291,173.76

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	美元折合人民币	合计

以外币计价的资产		
银行存款	12,287,607.20	12,287,607.20
交易性金融资产	289,195,436.58	289,195,436.58
应收利息	3.42	3.42
应收股利	210,397.29	210,397.29
其他资产	47,493.04	47,493.04
资产合计	301,740,937.53	301,740,937.53
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	301,740,937.53	301,740,937.53
项目	上年度末 2011年12月31日	
	美元折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	5,555,379.22	5,555,379.22
交易性金融资产	214,949,475.87	214,949,475.87
应收利息	1.51	1.51
应收股利	142,491.77	142,491.77
其他资产	47,312.83	47,312.83
资产合计	220,694,661.20	220,694,661.20
以外币计价的负债		
应付证券清算款	2,598,848.86	2,598,848.86
负债合计	2,598,848.86	2,598,848.86
资产负债表外汇风险敞口净额	218,095,812.34	218,095,812.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	美元相对人民币贬值5%	减少约567	减少约1,090
	美元相对人民币升值5%	增加约567	增加约1,090

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的股票和基金，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。

本基金的基金管理人通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对纳斯达克 100 指数(Nasdaq-100 Index)的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票和目标基金投资比例不低于基金资产的 80%，目标基金的比例不超过 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	258,394,792.75	81.61	209,848,676.79	89.57
交易性金融资产-基金投资	30,800,643.83	9.73	5,100,799.08	2.18
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	289,195,436.58	91.34	214,949,475.87	91.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降5%	减少约1,330	减少约1,054

	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升5%	增加约1,330	增加约1,054
--	-------------------------	----------	----------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1） 公允价值

（a） 不以公允价值计量的金融工具

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

（b） 以公允价值计量的金融工具

（i） 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

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

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

（ii） 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 289,195,436.58 元，无属于第二层级和第三层级的余额（2011 年 12 月 31 日：第一层级 214,949,475.87 元，无第二层级和无第三层）。

（iii） 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

（iv） 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	258,394,792.75	80.81
	其中:普通股	258,394,792.75	80.81
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	30,800,643.83	9.63
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,496,692.67	9.23
8	其他各项资产	1,048,021.70	0.33
9	合计	319,740,150.95	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	258,394,792.75	81.61
合计	258,394,792.75	81.61

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	174,759,397.20	55.20
非必需消费品	42,388,493.76	13.39
保健	26,635,548.98	8.41
必需消费品	6,640,487.21	2.10
工业	4,582,174.81	1.45
电信服务	2,227,054.85	0.70
材料	1,161,635.94	0.37
合计	258,394,792.75	81.61

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克	美国	13,246	48,927,301.23	15.45
2	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克	美国	118,035	22,837,257.29	7.21
3	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克	美国	3,711	13,615,231.28	4.30
4	ORACLE CORP	甲骨文公司	ORCL US	纳斯达克	美国	70,479	13,239,447.02	4.18
5	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克	美国	70,596	11,899,561.87	3.76
6	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	6,422	9,275,236.26	2.93

7	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	24,137	8,500,337.72	2.68
8	CISCO SYSTEMS INC	思科公司	CSCO US	纳斯达克	美国	77,046	8,367,082.57	2.64
9	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克	美国	29,531	5,971,376.48	1.89
10	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克	美国	11,185	5,157,945.51	1.63
11	EBAY INC	电子湾	EBAY US	纳斯达克	美国	18,317	4,866,992.65	1.54
12	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST US	纳斯达克	美国	6,240	3,749,400.72	1.18
13	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克	美国	10,476	3,532,964.67	1.12
14	GILEAD SCIENCES INC	吉利德公司	GILD US	纳斯达克	美国	10,608	3,440,607.97	1.09
15	NEWS CORP-CL A	新闻集团	NWSA US	纳斯达克	美国	23,706	3,342,119.79	1.06
16	BIOGEN IDEC INC	生物基因艾迪公司	BIIB US	纳斯达克	美国	3,346	3,055,530.60	0.97
17	PRICELINE.COM INC	-	PCLN US	纳斯达克	美国	704	2,958,927.87	0.93
18	TEXAS INSTRUMENT INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克	美国	16,200	2,939,674.37	0.93
19	DIRECTV-CLASS A	直播电视集团	DTV US	纳斯达克	美国	9,472	2,924,779.49	0.92
20	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	纳斯达克	美国	3,743	2,722,048.10	0.86
21	CELGENE CORP	-	CELG US	纳斯达克	美国	6,187	2,510,719.15	0.79
22	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP US	纳斯达克	美国	6,993	2,461,843.23	0.78
23	EXPRESS SCRIPTS INC	快捷药方	ESRX US	纳斯达克	美国	6,927	2,446,056.47	0.77
24	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	沃达丰	VOD US	纳斯达克	美国	12,495	2,227,054.85	0.70

25	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科	ISRG US	纳斯达克	美国	585	2,049,059.83	0.65
26	VIACOM INC	维亚康姆公司	VIAB US	纳斯达克	美国	6,800	2,022,298.23	0.64
27	DELL INC	戴尔	DELL US	纳斯达克	美国	25,522	2,019,415.46	0.64
28	YAHOO! INC	雅虎	YHOO US	纳斯达克	美国	17,482	1,750,353.21	0.55
29	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	-	ALXN US	纳斯达克	美国	2,600	1,632,962.68	0.52
30	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科技公司	CTSH US	纳斯达克	美国	4,270	1,620,439.38	0.51
31	INTUIT INC	英图易软件	INTU US	纳斯达克	美国	4,170	1,565,346.34	0.49
32	WHOLE FOODS MARKET INC	全食超市	WFM US	纳斯达克	美国	2,500	1,507,223.67	0.48
33	BROADCOM CORP-CL A	博通	BRCM US	纳斯达克	美国	6,996	1,493,846.25	0.47
34	ADOBE SYSTEMS INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克	美国	7,015	1,436,230.15	0.45
35	CITRIX SYSTEMS INC	思杰系统	CTXS US	纳斯达克	美国	2,641	1,402,138.87	0.44
36	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克	美国	18,355	1,328,690.59	0.42
37	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克	美国	5,108	1,266,134.42	0.40
38	CERNER CORP	塞纳公司	CERN US	纳斯达克	美国	2,384	1,246,393.90	0.39
39	ROSS STORES INC	罗斯商店	ROST US	纳斯达克	美国	3,146	1,243,036.52	0.39
40	BED BATH & BEYOND INC	-	BBBY US	纳斯达克	美国	3,128	1,222,668.95	0.39
41	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪	ATVI US	纳斯达克	美国	16,106	1,221,407.38	0.39
42	CA INC	冠群国际	CA US	纳斯达克	美国	6,904	1,182,942.00	0.37
43	DOLLAR TREE INC	-	DLTR US	纳斯达克	美国	3,200	1,088,894.78	0.34

44	MONSTER BEVERAGE CORP	怪 兽 饮 料 公 司	MNST US	纳 斯 达 克	美 国	2,400	1,080,798.91	0.34
45	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷	STX US	纳 斯 达 克	美 国	6,848	1,071,128.39	0.34
46	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	福 泰 制 药 公 司	VRTX US	纳 斯 达 克	美 国	3,017	1,067,077.93	0.34
47	FASTENAL CO	美 国 快 扣	FAST US	纳 斯 达 克	美 国	4,148	1,057,560.47	0.33
48	NETAPP INC	网 域 存 储	NTAP US	纳 斯 达 克	美 国	5,239	1,054,392.33	0.33
49	PAYCHEX INC	沛齐	PAYX US	纳 斯 达 克	美 国	5,141	1,021,337.33	0.32
50	MATTEL INC	美泰	MAT US	纳 斯 达 克	美 国	4,845	994,095.92	0.31
51	ALTERA CORP	阿 尔 特 拉 公 司	ALTR US	纳 斯 达 克	美 国	4,571	978,352.23	0.31
52	PERRIGO COMPANY	-	PRGO US	纳 斯 达 克	美 国	1,300	969,664.09	0.31
53	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	奥 赖 利 汽 车 公 司	ORLY US	纳 斯 达 克	美 国	1,811	959,534.58	0.30
54	SYMANTEC CORP	赛 门 铁 克	SYMC US	纳 斯 达 克	美 国	10,337	955,208.98	0.30
55	CHECK POINT SOFTWARE TECH	-	CHKP US	纳 斯 达 克	美 国	2,980	934,682.34	0.30
56	WYNN RESORTS LTD	永 利 度 假	WYNN US	纳 斯 达 克	美 国	1,362	893,497.37	0.28
57	LIBERTY MEDIA CORP-INTER A	自 由 媒 体 公 司	LINTA US	纳 斯 达 克	美 国	7,694	864,998.70	0.27
58	FISERV INC	费 哲 金 融	FISV US	纳 斯 达 克	美 国	1,868	853,273.03	0.27
59	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗 宾 逊 全 球 物 流	CHRW US	纳 斯 达 克	美 国	2,303	852,562.30	0.27
60	MYLAN INC	迈 兰 实 验 室	MYL US	纳 斯 达 克	美 国	6,262	846,391.41	0.27

61	STAPLES INC	史泰公司	SPLS US	纳斯达克	美国	9,842	812,358.14	0.26
62	SANDISK CORP	晟碟	SNDK US	纳斯达克	美国	3,505	808,716.89	0.26
63	XILINX INC	赛灵思	XLNX US	纳斯达克	美国	3,691	783,698.56	0.25
64	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	-	AVGO US	纳斯达克	美国	3,400	772,017.29	0.24
65	SIGMA-ALDRICH	西格玛-奥德里奇	SIAL US	纳斯达克	美国	1,632	763,122.97	0.24
66	NVIDIA CORP	英伟达科技	NVDA US	纳斯达克	美国	8,702	760,642.85	0.24
67	EXPEDITORS INTL WASH INC	康捷国际	EXPD US	纳斯达克	美国	3,030	742,622.32	0.23
68	LIFE TECHNOLOGIES CORP	生命科技公司	LIFE US	纳斯达克	美国	2,551	725,905.55	0.23
69	KLA-TENCOR CORPORATION	科天公司	KLAC US	纳斯达克	美国	2,328	725,175.08	0.23
70	AUTODESK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达克	美国	3,205	709,292.94	0.22
71	F5 NETWORKS INC	-	FFIV US	纳斯达克	美国	1,100	692,677.75	0.22
72	GARMIN LTD	佳明公司	GRMN US	纳斯达克	美国	2,759	668,175.78	0.21
73	STERICYCLE INC	-	SRCL US	纳斯达克	美国	1,144	663,295.30	0.21
74	NUANCE COMMUNICATIONS INC	-	NUAN US	纳斯达克	美国	4,400	662,900.12	0.21
75	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	美信	MXIM US	纳斯达克	美国	4,074	660,682.36	0.21
76	LINEAR TECHNOLOGY CORP	凌特	LLTC US	纳斯达克	美国	3,272	648,376.63	0.20
77	BMC SOFTWARE INC	-	BMC US	纳斯达克	美国	2,328	628,435.99	0.20
78	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克	美国	1,244	617,573.10	0.20

79	VIRGIN MEDIA INC	维珍传媒公司	VMED US	纳斯达克	美国	3,964	611,503.73	0.19
80	SIRIUS XM RADIO INC	-	SIRI US	纳斯达克	美国	52,000	608,455.38	0.19
81	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	迈威尔科技有限公司	MRVL US	纳斯达克	美国	8,354	596,015.06	0.19
82	VERISIGN INC	维圣公司	VRSN US	纳斯达克	美国	2,149	592,212.59	0.19
83	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微晶科技	MCHP US	纳斯达克	美国	2,761	577,677.66	0.18
84	MICRON TECHNOLOGY INC	美光技术	MU US	纳斯达克	美国	14,200	566,723.69	0.18
85	SEARS HOLDINGS CORP	西尔斯控股	SHLD US	纳斯达克	美国	1,484	560,353.25	0.18
86	EXPEDIA INC	艾派迪	EXPE US	纳斯达克	美国	1,699	516,560.47	0.16
87	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	-	AKAM US	纳斯达克	美国	2,500	502,038.94	0.16
88	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	登士国际公司	XRAY US	纳斯达克	美国	1,964	469,679.74	0.15
89	APOLLO GROUP INC-CL A	阿波罗	APOL US	纳斯达克	美国	1,763	403,547.40	0.13
90	WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	华纳齐特公司	WCRX US	纳斯达克	美国	3,527	399,981.05	0.13
91	RANDGOLD RESOURCES LTD-ADR	-	GOLD US	纳斯达克	美国	700	398,512.97	0.13
92	LAM RESEARCH CORP	拉姆研究	LRCX US	纳斯达克	美国	1,661	396,483.57	0.13
93	FOSSIL INC	-	FOSL US	纳斯达克	美国	800	387,286.28	0.12
94	FLEXTRONICS INTL LTD	伟创力公司	FLEX US	纳斯达克	美国	9,797	384,183.28	0.12

95	ELECTRONIC ARTS INC	电 子 艺 界	EA US	纳 斯 达 克	美 国	4,662	364,160.54	0.12
96	RESEARCH IN MOTION	-	RIMM US	纳 斯 达 克	美 国	7,472	349,248.83	0.11
97	INFOSYS TECHNOLOGIES-SP ADR	印 孚 瑟 斯 科 技 有 限 公 司	INFY US	纳 斯 达 克	美 国	1,095	312,074.99	0.10
98	NETFLIX INC	-	NFLX US	纳 斯 达 克	美 国	700	303,212.54	0.10
99	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	-	GMCR US	纳 斯 达 克	美 国	2,200	303,063.91	0.10
100	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	携 程	CTRP US	纳 斯 达 克	美 国	2,100	222,611.18	0.07

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.4.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	5,189,333.47	2.21
2	TEXAS INSTRUMENT INC	TXN US	3,262,457.19	1.39
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	2,142,995.49	0.91
4	VIACOM INC	VIAB US	2,006,779.78	0.86
5	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	1,580,911.59	0.67
6	ORACLE CORP	ORCL US	1,138,491.82	0.49
7	QUALCOMM INC	QCOM US	1,103,934.11	0.47
8	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	1,075,144.23	0.46
9	INTEL CORP	INTC US	986,229.60	0.42
10	AMAZON.COM INC	AMZN US	707,861.06	0.30
11	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	534,386.15	0.23
12	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	469,531.20	0.20

13	EBAY INC	EBAY US	435,176.41	0.19
14	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	387,781.01	0.17
15	STARBUCKS CORP	SBUX US	334,769.11	0.14
16	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	292,360.02	0.12
17	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	TEVA US	281,088.72	0.12
18	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	275,631.17	0.12
19	SEAGATE TECHNOLOGY	STX US	268,365.01	0.11
20	DELL INC	DELL US	265,804.93	0.11

注：1. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2. 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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	TEVA US	2,543,124.88	1.09
2	APPLE INC	AAPL US	1,873,389.88	0.80
3	ORACLE CORP	ORCL US	828,185.14	0.35
4	AMGEN INC	AMGN US	644,197.82	0.27
5	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	621,901.51	0.27
6	INTEL CORP	INTC US	589,094.04	0.25
7	AMAZON.COM INC	AMZN US	560,485.10	0.24
8	QUALCOMM INC	QCOM US	508,146.39	0.22
9	GOOGLE INC-CL A	GOOG US	380,128.14	0.16
10	MICROSOFT CORP	MSFT US	333,387.87	0.14
11	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	306,605.98	0.13
12	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	300,158.10	0.13
13	NEWS CORP-CL A	NWSA US	287,053.02	0.12
14	WYNN RESORTS LTD	WYNN US	234,313.52	0.10
15	FIRST SOLAR INC	FSLR US	153,783.44	0.07
16	DIRECTV-CLASS A	DTV US	143,723.10	0.06
17	DELL INC	DELL US	137,328.19	0.06
18	GILEAD SCIENCES	GILD US	103,656.60	0.04

	INC			
19	YAHOO! INC	YHOO US	95,978.75	0.04
20	CELGENE CORP	CELG US	95,017.01	0.04

注：1. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2. 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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	28,695,666.96
卖出收入（成交）总额	11,510,072.61

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF 基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Management, LLC	30,800,643.83	9.73

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	210,397.29
4	应收利息	3,111.21
5	应收申购款	787,020.16
6	其他应收款	47,493.04
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,048,021.70

7.11.4 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处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末持有的股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 报告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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

无。

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

18,956	14,482.42	18,244,499.54	6.65%	256,284,240.16	93.35%
--------	-----------	---------------	-------	----------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,649,718.83	0.60%

注：1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 4 月 29 日）基金份额总额	555,982,545.46
本报告期初基金份额总额	223,053,894.90
本报告期基金总申购份额	168,637,926.41
减：本报告期基金总赎回份额	117,163,081.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	274,528,739.70

注：如果本报告期间发生红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Morgan Stanley & Co. International plc	-	27,518,115.59	68.44%	12,888.41	56.62%	-
Goldman Sachs International	-	12,686,653.60	31.55%	9,867.63	43.35%	-
State Street Global Markets	-	743.51	0.00%	7.83	0.03%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务;能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

选择程序是:根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果,符合席位券商标准的,由公司研究部提出席位券商的调整意见(调整名单及调整原因),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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	-	-	-	-	14,491,586.16	58.96%
Goldman Sachs International	-	-	-	-	-	-	10,087,497.71	41.04%
State Street Global Markets	-	-	-	-	-	-	-	-

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	国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金分红公告	《中国证券报》	2012-03-05

11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日,本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自 2012 年 1 月 16 日起,王洪章先生就任中国建设银行股份有限公司董事长、执行董事。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 关于同意国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复
2. 国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同
3. 国泰纳斯达克 100 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

- 1、本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。
- 2、本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

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)38569000，400-888-8688

客户投诉电话：(021)38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司
二〇一二年八月二十七日