

国泰沪深 300 指数证券投资基金

2009 年半年度报告

2009年6月30日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇〇九年八月二十八日

§ 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 21 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2009年1月1日起至2009年6月30日止。

1.2 目录

内容	页码
§ 1 重要提示及目录	1
§ 2 基金简介	1
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	3
§ 4 管理人报告	4
§ 5 托管人报告	7
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	8
§ 7 投资组合报告	24
§ 8 基金份额持有人信息	36
§ 9 开放式基金份额变动	36
§ 10 重大事件揭示	36
§ 11 备查文件目录	39

§ 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
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

报告期末基金份额总额	8,905,122,188.63份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%，实现对沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为以完全复制为目标的指数基金，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	90%×沪深300指数收益率+10%×银行同业存款收益率。
风险收益特征	本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	宁敏
	联系电话	021-38561600转	010-66594977
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-8688	95566
传真		021-38561800	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区峨山路91弄98号201A	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		陈勇胜	肖钢

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	国泰基金管理有限公司登记注册中心

办公地址	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼
------	----------------------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日 -2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-591,341,286.63
本期利润	2,036,762,008.46
加权平均基金份额本期利润	0.2575
本期加权平均净值利润率	50.36%
本期基金份额净值增长率	69.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日 -2009 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-553,996,382.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0622
期末基金资产净值	5,667,330,266.43
期末基金份额净值	0.636
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日 -2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-36.33%

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	14.18%	1.14%	13.20%	1.10%	0.98%	0.04%
过去三个月	25.20%	1.46%	23.46%	1.40%	1.74%	0.06%
过去六个月	69.60%	1.84%	65.21%	1.77%	4.39%	0.07%
过去一年	12.77%	2.42%	12.91%	2.31%	-0.14%	0.11%
自基金合同生效起至今	-36.33%	2.42%	-33.21%	2.43%	-3.12%	-0.01%

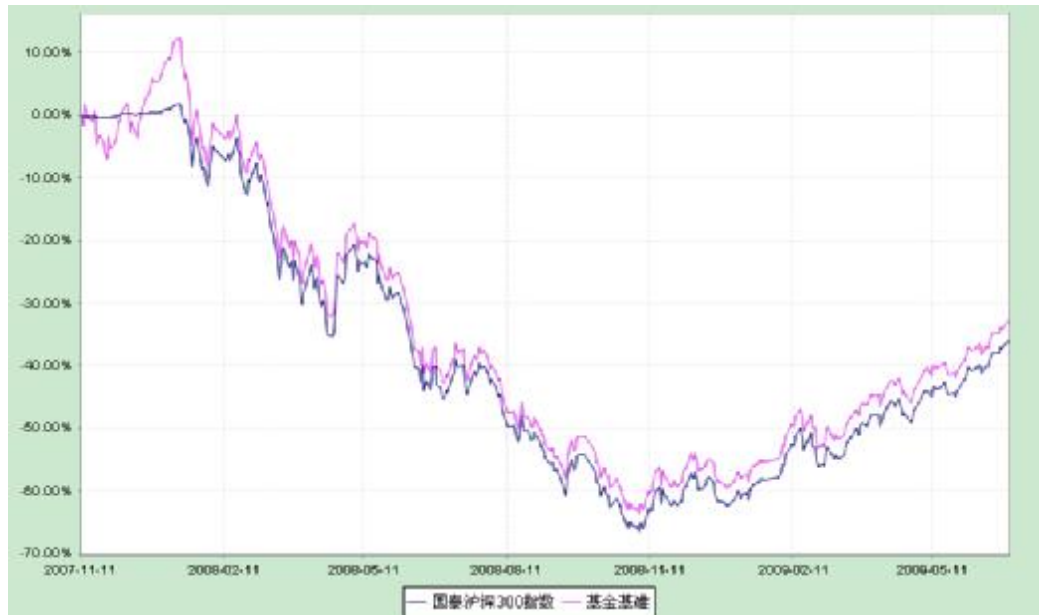
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准

收益率变动的比较

国泰沪深300指数证券投资基金

累计份额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2009年6月30日)



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2009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、金盛证券投资基金，以及11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（二期）、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。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24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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘翔	本基金的基金经理	2009-03-12	-	4	硕士研究生。曾就职于中国海员对外技术服务公司深圳分公司、Sprint AAA公司、美国通用电气公司、深圳中兴通讯股份有限公司，2005年8月至2007年7月在标准普尔信息服务公司任资深分析师，2007年7月至2007年12月在招商基金管理有限公司任高级信用分析师。2007年12月加盟国泰基金管理有限公司，任高级策略分析师，2009年3月起任国泰沪深300指数的基金经理。
黄刚	本基金的基金经理	2007-11-11	2009-4-1	16	硕士研究生。曾任职于上海社会科学院、上海金属交易所、上海期货交易所，2000年5月加盟国泰基金管理有限公司，曾任研究开发部经理、市场部经理，国泰金鹰增长股票的共同基金经理、国泰金泰封闭基金经理、社保组合的投资经理，2004年11月至2007年11月担任理财部副总监，2007

					年3月至2008年5月担任国泰金鹏蓝筹的基金经理，2007年11月至2009年3月任国泰沪深300指数的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 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的说明

2009年上半年，随着A股市场从底部的反弹，本基金单位净值也随市场反弹而大幅上涨。在此期间，我们将本基金的股票资产仓位控制在接近基金合同规定的中上水平附近。在交易策略上，全面跟踪沪深300指数，分时段平均交易，尽

量减少交易冲击成本。报告期内，本基金组合跟踪效果如下：

- (1) 日跟踪偏差TD稳定在-0.26%至0.30%之间；
- (2) 年化跟踪误差TE大部分时间稳定在0.17% - 0.18%。

TD和TE变化相对稳定，表明本基金所采用的跟踪交易技术稳定可靠。

本报告期内，本基金单位净值从0.375元上涨至0.636元，增长69.60%；比较基准则增长65.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济在经历2008年四季度的“休克”式下降后，2009年一季度各相经济指标纷纷触底反弹。随着政府经济刺激政策的开始发挥作用，二季度各项宏观数据呈现环比改善的趋势。这使得股市的系统性风险降低，而充裕的流动性和对通胀的预期不断推动A股市场的上涨。我们认为A股市场下半年总体上将延续上升态势，向好的上市公司中期业绩也将有利于化解估值压力。但在市场经历了8个月的中级反弹后，沪深300指数从1606的前期最低点已上涨超过100%。一旦政府的政策开始改变或流动性减弱超预期，则股指持续上涨动力将会有所减弱。

截至2009年6月30日，沪深300的市值占全部A股总市值的77%，我们坚信沪深指数300成分股是中国经济中最有价值的核心资产，而这些股票的长期增长空间是不言而喻的。基于长期投资、价值投资的理念，投资者应积极利用沪深300指数基金这一优秀的资产配置工具，充分把握中国经济增长的机会。

最后，根据市场一致预期，沪深300指数09年动态市盈率相当于23倍左右，而PB中值水平为3.6倍，虽然高于国际成熟市场的估值水平，但仍处于A股估值的历史合理区间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人长设的估值委员会按照相关法律法规规定，并依据相关制度及流程，对基金估值相关工作进行评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。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

本基金本报告期末无可供分配利润，本基金遵守了基金合同和相关法律法规的规定。

§ 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据核对无误。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资 产：			
银行存款		382,086,336.44	200,495,070.56
结算备付金		2,192,045.93	315,541.01
存出保证金		651,853.58	473,300.22
交易性金融资产	6.4.7.1	5,397,740,174.77	2,445,722,684.37
其中：股票投资		5,357,215,473.77	2,445,722,684.37
债券投资		40,524,701.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.2	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	-
应收证券清算款		8,930,483.41	6,887,837.30
应收利息	6.4.7.4	1,090,458.04	38,596.46
应收股利		1,129,218.33	-

应收申购款		36,564,654.96	2,937,095.83
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		5,830,385,225.46	2,656,870,125.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.2	-	-
卖出回购金融资产款		39,000,000.00	-
应付证券清算款		-	5,907,541.90
应付赎回款		117,271,252.94	8,500,037.82
应付管理人报酬		2,092,832.44	1,211,306.74
应付托管费		418,566.52	242,261.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	1,468,505.46	462,968.06
应交税费		652,003.80	652,003.80
应付利润		-	-
应付利息		6,128.55	-
其他负债	6.4.7.7	2,145,669.32	1,360,806.64
负债合计		163,054,959.03	18,336,926.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	6,221,326,649.31	4,912,499,527.34
未分配利润	6.4.7.9	-553,996,382.88	-2,273,966,327.89
所有者权益合计		5,667,330,266.43	2,638,533,199.45
负债及所有者权益总计		5,830,385,225.46	2,656,870,125.75

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值0.636元，基金份额总额8,905,122,188.63份。

6.2 利润表

会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
一、收入		2,052,964,150.78	-2,843,854,479.52
1. 利息收入		1,116,649.75	4,552,115.22
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,095,745.37	4,552,115.22

债券利息收入		20,904.38	-
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“-”号填列）		-578,944,767.55	-36,070,005.20
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-609,469,396.51	-64,085,621.89
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	30,524,628.96	28,015,616.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	2,628,103,295.09	-2,813,188,324.53
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	2,688,973.49	851,734.99
二、费用（以“-”号填列）		-16,202,142.32	-40,398,528.14
1. 管理人报酬		-9,900,231.88	-12,990,586.96
2. 托管费		-1,980,046.44	-2,598,117.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.15	-4,093,040.60	-24,552,378.64
5. 利息支出		-6,128.55	-
其中：卖出回购金融资产支出		-6,128.55	-
6. 其他费用	6.4.7.16	-222,694.85	-257,445.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,036,762,008.46	-2,884,253,007.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,912,499,527.34	-2,273,966,327.89	2,638,533,199.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,036,762,008.46	2,036,762,008.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,308,827,121.97	-316,792,063.45	992,035,058.52
其中：1. 基金申购款	4,306,500,884.27	-1,042,623,912.62	3,263,876,971.65
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,997,673,762.30	725,831,849.17	-2,271,841,913.13

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,221,326,649.31	-553,996,382.88	5,667,330,266.43
项 目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,462,299,429.09	1,942,388,156.22	6,404,687,585.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,884,253,007.66	-2,884,253,007.66
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）	223,618,219.65	41,407,251.50	265,025,471.15
其中：1. 基金申购款	897,700,601.46	48,695,174.49	946,395,775.95
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-674,082,381.81	-7,287,922.99	-681,370,304.80
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）	4,685,917,648.74	-900,457,599.94	3,785,460,048.80

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金于合同生效后自2007年11月16日至2007年12月14日止期间进行集中申购，共募集净有效集中申购资金5,938,412,579.14元。根据《国泰沪深300指数证券

投资基金招募说明书》的规定，本基金集中申购期内募集的净有效集中申购资金连同申购资金产生的利息收入3,606,042.98元在本基金集中申购期结束后于2007年12月19日按上述拆分后的基金份额净值1.000元折算为基金份额，划入基金份额持有人账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰沪深300指数证券投资基金基金合同》的有关规定，自2007年11月11日起，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%。本基金转型后的业绩比较基准变更为：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2009年8月24日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《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”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰沪深300指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009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2009年6月30日的财务状况以及2009年1月1日至2009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

本基金本报告期不存在重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税

收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009年6月30日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		6,025,205,112.01	5,357,215,473.77	-667,989,638.24
债券	交易所市场	40,484,371.60	40,524,701.00	40,329.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	40,484,371.60	40,524,701.00	40,329.40
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,065,689,483.61	5,397,740,174.77	-667,949,308.84

6.4.7.2 衍生金融资产/负债

截至2009年6月30日止，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3 买入返售金融资产

截至 2009 年 6 月 30 日止，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
----	-------------------

应收活期存款利息	58,811.27
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	690.48
应收债券利息	1,022,392.71
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	8,520.02
其他	43.56
合计	1,090,458.04

6.4.7.5 其他资产

截至2009年6月30日止，其他资产余额为零。

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,468,505.46
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,468,505.46

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商席位保证金	250,000.00
预提费用	213,232.48
应付赎回费	1,682,436.84
合计	2,145,669.32

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,032,099,561.45	4,912,499,527.34
本期申购	6,164,682,502.21	4,306,500,884.27
本期赎回	-4,291,659,875.03	-2,997,673,762.30
本期末	8,905,122,188.63	6,221,326,649.31

6.4.7.9 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	1,475,878,123.51	-3,749,844,451.40	-2,273,966,327.89
本期利润	-591,341,286.63	2,628,103,295.09	2,036,762,008.46
本期基金份额交易产生的变动数	282,324,849.40	-599,116,912.85	-316,792,063.45
其中：基金申购款	916,325,508.80	-1,958,949,421.42	-1,042,623,912.62
基金赎回款	-634,000,659.40	1,359,832,508.57	725,831,849.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,166,861,686.28	-1,720,858,069.16	-553,996,382.88

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
活期存款利息收入	1,037,902.49
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	14,349.84
其他	43,493.04
合计	1,095,745.37

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
卖出股票成交金额	1,030,377,985.16
卖出股票成本总额	-1,639,847,381.67
买卖股票差价收入	-609,469,396.51

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	30,524,628.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	30,524,628.96

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
1. 交易性金融资产	2, 628, 103, 295. 09
——股票投资	2, 628, 062, 965. 69
——债券投资	40, 329. 40
——资产支持证券投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	2, 628, 103, 295. 09

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
基金赎回费收入（1）	2, 128, 300. 17
基金转换费收入（2）	560, 673. 32
合计	2, 688, 973. 49

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

（2）基金之间的转换费由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
交易所市场交易费用	4, 093, 040. 60
银行间市场交易费用	—
合计	4, 093, 040. 60

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日
信息披露费	158, 684. 51
审计费用	54, 547. 97
债券托管账户服务费	9, 000. 00
银行手续费	462. 37

合计	222,694.85
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

于2009年6月30日，本基金无需要在财务报表附注中披露的重大或有事项及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（“国泰基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金管理人未通过关联方席位进行股票交易（2008年1月1日至2008年6月30日：同）。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金管理人未通过关联方席位进行权证交易（2008年1月1日至2008年6月30日：同）。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金管理人无应支付关联方席位佣金（2008年1月1日至2008年6月30日：同）。

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 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
当期应支付的管理费	9,900,231.88	12,990,586.96

其中：当期已支付	7,807,399.44	11,266,179.06
期末未支付	2,092,832.44	1,724,407.90

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
当期应支付的托管费	1,980,046.44	2,598,117.41
其中：当期已支付	1,561,479.92	2,253,235.83
期末未支付	418,566.52	344,881.58

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

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，本基金管理人无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易（2008年1月1日至2008年6月30日：同）。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金(2008年1月1日至2008年6月30日：同)。

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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末即2009年6月30日未持有本基金(2008年12月31日：同)。

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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	382,086,336.44	1,037,902.49	342,150,613.60	4,462,224.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金在承销期内未买入关联方所承销证券（2008年1月1日至2008年6月30日：同）。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2009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

截至2009年6月30日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限制的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

截至2009年6月30日止，本基金持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌：

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
600115	ST东航	09/06/08	资产重组	5.33	09/07/13	5.60	641,346	8,525,638.49	3,418,374.18
600591	*ST上航	09/06/08	资产重组	5.92	09/07/13	6.22	509,611	5,662,436.26	3,016,897.12
000792	盐湖钾肥	09/06/26	资产重组	55.14	09/07/27	60.65	540,956	38,567,668.08	29,828,313.84

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2009年6月30日止，本基金无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额39,000,000.00元，于2009年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以

实现“与市场的同步增长，获取中国经济增长的长期稳定回报”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本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银行，因而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，因此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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的10%。

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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合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，适用于本基金的包括利率风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的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、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。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。

单位：人民币元

本期末 2009年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	382,086,336.44	-	-	-	382,086,336.44
结算备付金	2,192,045.93	-	-	-	2,192,045.93
存出保证金	138,549.12	-	-	513,304.46	651,853.58
交易性金融资产	40,524,701.00	-	-	5,357,215,473.77	5,397,740,174.77
应收证券清算款	-	-	-	8,930,483.41	8,930,483.41
应收利息	-	-	-	1,090,458.04	1,090,458.04
应收股利	-	-	-	1,129,218.33	1,129,218.33
应收申购款	-	-	-	36,564,654.96	36,564,654.96
资产总计	424,941,632.49	-	-	5,405,443,592.97	5,830,385,225.46
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	39,000,000.00	39,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	117,271,252.94	117,271,252.94
应付管理人报酬	-	-	-	2,092,832.44	2,092,832.44
应付托管费	-	-	-	418,566.52	418,566.52
应付交易费用	-	-	-	1,468,505.46	1,468,505.46
应付利息	-	-	-	6,128.55	6,128.55
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	2,145,669.32	2,145,669.32
负债总计	-	-	-	163,054,959.03	163,054,959.03
利率敏感度缺口	424,941,632.49	-	-	5,242,388,633.94	5,667,330,266.43
上年度末 2008年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	200,495,070.56	-	-	-	200,495,070.56
结算备付金	315,541.01	-	-	-	315,541.01
存出保证金	138,549.12	-	-	334,751.10	473,300.22
交易性金融资产	-	-	-	2,445,722,684.37	2,445,722,684.37
应收证券清算款	-	-	-	6,887,837.30	6,887,837.30
应收利息	-	-	-	38,596.46	38,596.46
应收申购款	-	-	-	2,937,095.83	2,937,095.83
资产总计	200,949,160.69	-	-	2,455,920,965.06	2,656,870,125.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,500,037.82	8,500,037.82
应付证券清算款	-	-	-	5,907,541.90	5,907,541.90
应付管理人报酬	-	-	-	1,211,306.74	1,211,306.74
应付托管费	-	-	-	242,261.34	242,261.34
应付交易费用	-	-	-	462,968.06	462,968.06
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	1,360,806.64	1,360,806.64

负债总计	-	-	-	18,336,926.30	18,336,926.30
利率敏感度缺口	200,949,160.69	-	-	2,437,584,038.76	2,638,533,199.45

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2009年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.72%(2008年12月31日：无)，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 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或成份股发生配股、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。

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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

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%，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%。于2009年6月30日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日		上年度末 2008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	5,357,215,473.77	94.53	2,445,722,684.37	92.69
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,357,215,473.77	94.53	2,445,722,684.37	92.69

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(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(2009年6月30日)	上年度末(2008年12月31日)
	1. 业绩比较基准(6.4.1)上升5%	增加约26,535	增加约12,005
	2. 业绩比较基准(6.4.1)下降5%	下降约26,535	下降约12,005

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	5,357,215,473.77	91.88
	其中:股票	5,357,215,473.77	91.88
2	固定收益投资	40,524,701.00	0.70
	其中:债券	40,524,701.00	0.70
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	384,278,382.37	6.59
6	其他资产	48,366,668.32	0.83
7	合计	5,830,385,225.46	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资部分

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	23,867,888.04	0.42
B	采掘业	643,216,752.21	11.35
C	制造业	1,371,892,866.40	24.21
C0	食品、饮料	194,255,862.84	3.43
C1	纺织、服装、皮毛	32,989,303.64	0.58
C2	木材、家具	116,580.31	0.00
C3	造纸、印刷	21,247,353.66	0.37
C4	石油、化学、塑胶、塑料	123,799,801.63	2.18
C5	电子	25,238,866.82	0.45
C6	金属、非金属	499,986,505.75	8.82
C7	机械、设备、仪表	358,428,842.39	6.32
C8	医药、生物制品	85,558,076.28	1.51
C99	其他制造业	30,271,673.08	0.53
D	电力、煤气及水的生产和供应业	195,663,160.04	3.45
E	建筑业	128,296,881.38	2.26
F	交通运输、仓储业	295,063,879.45	5.21
G	信息技术业	154,287,630.26	2.72
H	批发和零售贸易	169,566,957.17	2.99
I	金融、保险业	1,719,130,142.40	30.33
J	房地产业	425,025,476.73	7.50
K	社会服务业	86,512,128.87	1.53
L	传播与文化产业	14,527,082.07	0.26
M	综合类	130,164,628.75	2.30
	合计	5,357,215,473.77	94.53

7.2.2 积极投资部分

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 指数投资部分

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	600036	招商银行	9,827,472	220,233,647.52	3.89
2	600016	民生银行	22,066,492	174,766,616.64	3.08
3	601318	中国平安	3,400,880	168,207,524.80	2.97
4	601328	交通银行	18,054,349	162,669,684.49	2.87
5	600030	中信证券	5,462,540	154,371,380.40	2.72
6	601166	兴业银行	4,074,508	151,204,991.88	2.67

7	600000	浦发银行	6,428,684	147,988,305.68	2.61
8	000002	万科A	11,490,909	146,509,089.75	2.59
9	601088	中国神华	3,877,602	115,979,075.82	2.05
10	601398	工商银行	18,312,682	99,254,736.44	1.75
11	601169	北京银行	5,203,654	84,611,414.04	1.49
12	000001	深发展A	3,560,476	77,689,586.32	1.37
13	600050	中国联通	9,877,174	67,757,413.64	1.20
14	601857	中国石油	4,636,459	67,135,926.32	1.18
15	600519	贵州茅台	435,784	64,500,389.84	1.14
16	601939	建设银行	10,420,982	62,838,521.46	1.11
17	600900	长江电力	4,469,455	61,589,089.90	1.09
18	600028	中国石化	4,862,555	51,834,836.30	0.91
19	002024	苏宁电器	3,204,529	51,496,781.03	0.91
20	601628	中国人寿	1,761,261	48,522,740.55	0.86
21	601006	大秦铁路	4,575,337	48,452,818.83	0.85
22	000983	西山煤电	1,522,379	45,519,132.10	0.80
23	600019	宝钢股份	6,390,831	44,991,450.24	0.79
24	600048	保利地产	1,598,826	44,591,257.14	0.79
25	000858	五粮液	2,246,894	44,331,218.62	0.78
26	600383	金地集团	2,719,414	43,836,953.68	0.77
27	601601	中国太保	1,832,219	41,005,061.22	0.72
28	601390	中国中铁	5,999,694	40,737,922.26	0.72
29	601186	中国铁建	3,584,270	36,882,138.30	0.65
30	601919	中国远洋	2,647,691	35,929,166.87	0.63
31	600739	辽宁成大	1,068,213	35,379,214.56	0.62
32	600001	邯郸钢铁	6,103,584	33,996,962.88	0.60
33	000402	金融街	2,407,312	33,124,613.12	0.58
34	000651	格力电器	1,525,984	31,893,065.60	0.56
35	000069	华侨城A	1,513,622	31,634,699.80	0.56
36	600089	特变电工	1,698,124	30,634,156.96	0.54
37	000792	盐湖钾肥	540,956	29,828,313.84	0.53
38	000024	招商地产	937,161	29,754,861.75	0.53
39	600489	中金黄金	448,737	29,562,793.56	0.52
40	600015	华夏银行	2,344,069	29,371,184.57	0.52
41	000898	鞍钢股份	2,217,789	29,252,636.91	0.52
42	600005	武钢股份	3,672,101	28,936,155.88	0.51
43	000629	攀钢钢钒	3,536,320	28,891,734.40	0.51
44	600018	上港集团	4,988,399	28,583,526.27	0.50
45	000063	中兴通讯	1,011,334	28,418,485.40	0.50
46	000623	吉林敖东	696,460	28,185,736.20	0.50
47	601009	南京银行	1,534,036	27,597,307.64	0.49
48	601600	中国铝业	2,265,257	27,568,177.69	0.49

49	601898	中煤能源	2,192,394	27,054,141.96	0.48
50	600585	海螺水泥	616,537	25,980,869.18	0.46
51	000825	太钢不锈	3,360,785	25,810,828.80	0.46
52	601899	紫金矿业	2,497,549	25,474,999.80	0.45
53	600550	天威保变	701,868	25,042,650.24	0.44
54	601666	平煤股份	855,901	24,744,097.91	0.44
55	600011	华能国际	2,959,613	23,558,519.48	0.42
56	600104	上海汽车	1,511,670	22,599,466.50	0.40
57	600547	山东黄金	372,823	22,406,662.30	0.40
58	601699	潞安环能	566,608	22,375,349.92	0.39
59	000568	泸州老窖	775,531	22,257,739.70	0.39
60	600795	国电电力	3,180,701	22,169,485.97	0.39
61	601168	西部矿业	1,396,211	21,278,255.64	0.38
62	600320	振华重工	2,023,749	21,046,989.60	0.37
63	600832	东方明珠	1,855,202	20,277,357.86	0.36
64	000157	中联重科	883,489	19,728,309.37	0.35
65	600325	华发股份	863,836	19,514,055.24	0.34
66	600348	国阳新能	642,200	19,497,192.00	0.34
67	000937	金牛能源	493,285	19,090,129.50	0.34
68	000060	中金岭南	882,873	18,972,940.77	0.33
69	002142	宁波银行	1,465,175	18,842,150.50	0.33
70	600031	三一重工	648,523	18,658,006.71	0.33
71	600649	城投控股	1,350,168	18,618,816.72	0.33
72	601001	大同煤业	499,151	18,159,113.38	0.32
73	601958	金钼股份	1,104,662	17,840,291.30	0.31
74	600583	海油工程	1,503,705	17,788,830.15	0.31
75	600177	雅戈尔	1,283,932	17,705,422.28	0.31
76	600009	上海机场	1,130,071	17,357,890.56	0.31
77	601333	广深铁路	3,355,610	17,147,167.10	0.30
78	600635	大众公用	1,436,712	16,823,897.52	0.30
79	600895	张江高科	1,079,268	16,717,861.32	0.30
80	600415	小商品城	404,715	16,649,975.10	0.29
81	000839	中信国安	1,119,368	16,499,484.32	0.29
82	600642	申能股份	1,668,404	16,450,463.44	0.29
83	601998	中信银行	2,693,445	16,079,866.65	0.28
84	000630	铜陵有色	757,692	15,903,955.08	0.28
85	600123	兰花科创	447,895	15,797,256.65	0.28
86	000878	云南铜业	730,343	15,760,801.94	0.28
87	600309	烟台万华	982,279	15,490,539.83	0.27
88	000527	美的电器	1,078,974	15,429,328.20	0.27
89	600675	中华企业	928,062	14,811,869.52	0.26
90	000425	徐工科技	439,101	14,481,550.98	0.26

91	000800	一汽轿车	929,868	14,357,161.92	0.25
92	600997	开滦股份	759,474	14,194,569.06	0.25
93	600881	亚泰集团	1,733,866	13,749,557.38	0.24
94	600808	马钢股份	2,830,804	13,701,091.36	0.24
95	601111	中国国航	1,848,668	12,977,649.36	0.23
96	000895	双汇发展	360,329	12,971,844.00	0.23
97	000009	中国宝安	1,090,948	12,938,643.28	0.23
98	600362	江西铜业	384,008	12,929,549.36	0.23
99	000338	潍柴动力	353,904	12,892,722.72	0.23
100	600875	东方电气	330,205	12,844,974.50	0.23
101	600196	复星医药	879,289	12,740,897.61	0.22
102	000768	西飞国际	1,180,751	12,610,420.68	0.22
103	600655	豫园商城	724,535	12,519,964.80	0.22
104	600663	陆家嘴	485,437	12,402,915.35	0.22
105	600690	青岛海尔	930,548	12,339,066.48	0.22
106	601588	北辰实业	2,040,208	12,302,454.24	0.22
107	600029	南方航空	2,267,849	12,291,741.58	0.22
108	601866	中海集运	2,784,934	12,281,558.94	0.22
109	600010	包钢股份	3,057,877	12,109,192.92	0.21
110	000031	中粮地产	1,080,434	12,036,034.76	0.21
111	600717	天津港	985,179	11,950,221.27	0.21
112	600153	建发股份	867,477	11,736,963.81	0.21
113	600068	葛洲坝	962,921	11,709,119.36	0.21
114	000046	泛海建设	582,454	11,590,834.60	0.20
115	600331	宏达股份	722,288	11,477,156.32	0.20
116	000933	神火股份	567,246	11,344,920.00	0.20
117	601808	中海油服	694,299	11,240,700.81	0.20
118	600100	同方股份	710,810	11,188,149.40	0.20
119	600741	华域汽车	1,380,009	11,178,072.90	0.20
120	600188	兖州煤业	714,366	11,144,109.60	0.20
121	600208	新湖中宝	986,914	11,004,091.10	0.19
122	600111	包钢稀土	564,254	10,935,242.52	0.19
123	000100	TCL 集团	2,768,816	10,604,565.28	0.19
124	600694	大商股份	322,157	10,563,528.03	0.19
125	600748	上实发展	610,129	10,543,029.12	0.19
126	600811	东方集团	1,230,705	10,448,685.45	0.18
127	000686	东北证券	343,714	10,338,917.12	0.18
128	600631	百联股份	787,059	10,278,990.54	0.18
129	600598	北大荒	805,908	10,259,208.84	0.18
130	600664	哈药股份	732,952	10,232,009.92	0.18

131	600528	中铁二局	857,307	10,047,638.04	0.18
132	600150	中国船舶	156,310	9,919,432.60	0.18
133	600500	中化国际	830,298	9,863,940.24	0.17
134	600026	中海发展	763,633	9,858,502.03	0.17
135	600611	大众交通	706,421	9,480,169.82	0.17
136	000932	华菱钢铁	1,274,419	9,443,444.79	0.17
137	600660	福耀玻璃	1,150,123	9,442,509.83	0.17
138	000718	苏宁环球	647,667	9,339,358.14	0.16
139	000959	首钢股份	1,540,405	9,273,238.10	0.16
140	600058	五矿发展	502,018	9,181,909.22	0.16
141	600688	S上石化	1,100,355	9,165,957.15	0.16
142	600220	江苏阳光	1,477,981	9,104,362.96	0.16
143	601872	招商轮船	1,584,891	9,081,425.43	0.16
144	600643	爱建股份	693,736	8,997,755.92	0.16
145	000652	泰达股份	1,203,951	8,993,513.97	0.16
146	600497	驰宏锌锗	453,412	8,973,023.48	0.16
147	600596	新安股份	241,378	8,926,158.44	0.16
148	000039	中集集团	896,589	8,813,469.87	0.16
149	000423	东阿阿胶	490,826	8,805,418.44	0.16
150	000538	云南白药	251,536	8,803,760.00	0.16
151	000667	名流置业	1,290,752	8,777,113.60	0.15
152	600601	方正科技	2,037,130	8,739,287.70	0.15
153	600256	广汇股份	567,747	8,731,948.86	0.15
154	000897	津滨发展	1,577,198	8,721,904.94	0.15
155	000027	深圳能源	780,724	8,712,879.84	0.15
156	600037	歌华有线	753,802	8,676,261.02	0.15
157	000729	燕京啤酒	570,854	8,648,438.10	0.15
158	000960	锡业股份	372,898	8,457,326.64	0.15
159	600108	亚盛集团	1,676,568	8,382,840.00	0.15
160	600600	青岛啤酒	308,159	8,193,947.81	0.14
161	600428	中远航运	783,712	8,127,093.44	0.14
162	600812	华北制药	959,080	8,065,862.80	0.14
163	000488	晨鸣纸业	1,043,250	8,033,025.00	0.14
164	600653	申华控股	1,711,548	7,838,889.84	0.14
165	600432	吉恩镍业	347,478	7,835,628.90	0.14
166	600096	云天化	349,149	7,806,971.64	0.14
167	000401	冀东水泥	561,597	7,750,038.60	0.14
168	600886	国投电力	741,160	7,730,298.80	0.14
169	600638	新黄浦	554,151	7,686,074.37	0.14
170	000969	安泰科技	308,931	7,593,523.98	0.13

171	600266	北京城建	444,708	7,568,930.16	0.13
172	000680	山推股份	682,378	7,512,981.78	0.13
173	002128	露天煤业	280,513	7,495,307.36	0.13
174	600269	赣粤高速	684,444	7,487,817.36	0.13
175	600839	四川长虹	1,572,994	7,408,801.74	0.13
176	600859	王府井	276,491	7,332,541.32	0.13
177	000422	湖北宜化	638,569	7,311,615.05	0.13
178	000783	长江证券	416,427	7,291,636.77	0.13
179	600170	上海建工	431,349	7,246,663.20	0.13
180	000012	南玻A	462,179	7,242,344.93	0.13
181	600143	金发科技	811,306	7,220,623.40	0.13
182	600820	隧道股份	602,838	7,167,743.82	0.13
183	000778	新兴铸管	839,453	7,143,745.03	0.13
184	600737	中粮屯河	585,113	7,103,271.82	0.13
185	000725	京东方A	1,394,092	7,068,046.44	0.12
186	601918	国投新集	426,592	7,034,502.08	0.12
187	600132	重庆啤酒	355,461	7,023,909.36	0.12
188	600674	川投能源	377,571	7,000,166.34	0.12
189	600879	火箭股份	506,338	6,952,020.74	0.12
190	000758	中色股份	434,088	6,936,726.24	0.12
191	000528	柳工	416,656	6,933,155.84	0.12
192	600271	航天信息	434,406	6,902,711.34	0.12
193	000690	宝新能源	802,742	6,831,334.42	0.12
194	600779	水井坊	411,317	6,803,183.18	0.12
195	600022	济南钢铁	1,491,155	6,784,755.25	0.12
196	600008	首创股份	1,035,213	6,780,645.15	0.12
197	000717	韶钢松山	1,397,232	6,706,713.60	0.12
198	000625	长安汽车	802,691	6,533,904.74	0.12
199	600125	铁龙物流	828,238	6,526,515.44	0.12
200	000968	煤气化	357,607	6,379,708.88	0.11
201	600219	南山铝业	616,286	6,316,931.50	0.11
202	000807	云铝股份	728,653	6,222,696.62	0.11
203	600307	酒钢宏兴	456,654	6,205,927.86	0.11
204	000301	东方市场	1,021,408	6,179,518.40	0.11
205	601991	大唐发电	760,951	6,171,312.61	0.11
206	600158	中体产业	651,486	6,163,057.56	0.11
207	000089	深圳机场	785,859	6,066,831.48	0.11
208	600508	上海能源	332,421	6,053,386.41	0.11
209	600835	上海机电	474,397	6,024,841.90	0.11
210	600110	中科英华	842,510	6,023,946.50	0.11

211	000061	农 产 品	527, 446	6, 002, 335. 48	0. 11
212	000917	电广传媒	380, 665	5, 850, 821. 05	0. 10
213	600549	厦门钨业	314, 462	5, 833, 270. 10	0. 10
214	600456	宝钛股份	254, 547	5, 829, 126. 30	0. 10
215	000900	现代投资	318, 449	5, 824, 432. 21	0. 10
216	000021	长城开发	519, 642	5, 819, 990. 40	0. 10
217	600087	长航油运	932, 183	5, 770, 212. 77	0. 10
218	600027	华电国际	1, 087, 392	5, 676, 186. 24	0. 10
219	600210	紫江企业	1, 007, 150	5, 650, 111. 50	0. 10
220	600804	鹏博士	686, 095	5, 646, 561. 85	0. 10
221	002001	新 和 成	161, 631	5, 624, 758. 80	0. 10
222	600236	桂冠电力	701, 625	5, 556, 870. 00	0. 10
223	600426	华鲁恒升	337, 769	5, 532, 656. 22	0. 10
224	600588	用友软件	281, 345	5, 342, 741. 55	0. 09
225	600117	西宁特钢	525, 676	5, 335, 611. 40	0. 09
226	600109	国金证券	237, 338	5, 290, 264. 02	0. 09
227	600066	宇通客车	428, 373	5, 251, 852. 98	0. 09
228	600251	冠农股份	210, 380	5, 225, 839. 20	0. 09
229	600418	江淮汽车	892, 483	5, 221, 025. 55	0. 09
230	600004	白云机场	538, 568	5, 154, 095. 76	0. 09
231	002202	金风科技	170, 638	5, 139, 616. 56	0. 09
232	600616	金枫酒业	296, 878	5, 121, 145. 50	0. 09
233	600085	同仁堂	304, 991	5, 078, 100. 15	0. 09
234	600569	安阳钢铁	1, 137, 855	5, 052, 076. 20	0. 09
235	002155	辰州矿业	255, 418	4, 852, 942. 00	0. 09
236	000793	华闻传媒	970, 260	4, 744, 571. 40	0. 08
237	600033	福建高速	704, 132	4, 717, 684. 40	0. 08
238	600282	南钢股份	817, 770	4, 636, 755. 90	0. 08
239	600376	首开股份	216, 606	4, 583, 382. 96	0. 08
240	600770	综艺股份	329, 445	4, 579, 285. 50	0. 08
241	000951	中国重汽	191, 410	4, 574, 699. 00	0. 08
242	600837	海通证券	274, 611	4, 517, 350. 95	0. 08
243	000876	新 希 望	439, 164	4, 510, 214. 28	0. 08
244	000822	山东海化	633, 393	4, 490, 756. 37	0. 08
245	600183	生益科技	663, 735	4, 480, 211. 25	0. 08
246	600350	山东高速	791, 730	4, 449, 522. 60	0. 08
247	600006	东风汽车	930, 556	4, 392, 224. 32	0. 08
248	600316	洪都航空	204, 860	4, 384, 004. 00	0. 08
249	600151	航天机电	353, 809	4, 358, 926. 88	0. 08
250	600685	广船国际	194, 050	4, 321, 493. 50	0. 08

251	000612	焦作万方	331,085	4,307,415.85	0.08
252	600221	海南航空	778,945	4,182,934.65	0.07
253	600809	山西汾酒	158,969	4,182,474.39	0.07
254	600639	浦东金桥	281,566	4,153,098.50	0.07
255	600595	中孚实业	383,018	3,983,387.20	0.07
256	000927	一汽夏利	564,407	3,945,204.93	0.07
257	600308	华泰股份	360,798	3,874,970.52	0.07
258	600017	日照港	599,705	3,820,120.85	0.07
259	000912	泸天化	345,271	3,670,230.73	0.06
260	600118	中国卫星	206,467	3,619,366.51	0.06
261	000059	辽通化工	426,723	3,601,542.12	0.06
262	600299	蓝星新材	311,100	3,586,983.00	0.06
263	600102	莱钢股份	325,567	3,584,492.67	0.06
264	000559	万向钱潮	486,068	3,523,993.00	0.06
265	600270	外运发展	434,241	3,473,928.00	0.06
266	600115	ST东航	641,346	3,418,374.18	0.06
267	600380	健康元	503,686	3,248,774.70	0.06
268	600591	*ST上航	509,611	3,016,897.12	0.05
269	000543	皖能电力	360,936	2,865,831.84	0.05
270	000728	国元证券	148,518	2,729,760.84	0.05
271	600597	光明乳业	373,667	2,626,879.01	0.05
272	600874	创业环保	380,845	2,445,024.90	0.04
273	601005	重庆钢铁	423,346	2,226,799.96	0.04
274	600548	深高速	340,537	2,002,357.56	0.04
275	600887	*ST伊利	74,433	1,102,352.73	0.02
276	600020	中原高速	109,381	445,180.67	0.01
277	600062	双鹤药业	16,577	397,516.46	0.01
278	600098	广州控股	60,073	390,474.50	0.01
279	600863	内蒙华电	71,826	366,312.60	0.01
280	000539	粤电力A	38,705	272,483.20	0.00
281	002152	广电运通	6,828	175,479.60	0.00
282	002097	山河智能	9,238	161,665.00	0.00
283	600747	大连控股	26,552	157,453.36	0.00
284	000088	盐田港	16,855	124,221.35	0.00
285	600978	宜华木业	21,629	116,580.31	0.00
286	000503	海虹控股	15,288	105,640.08	0.00
287	600007	中国国贸	8,807	102,161.20	0.00
288	000829	天音控股	14,412	89,642.64	0.00
289	600961	株冶集团	6,460	87,145.40	0.00
290	600780	通宝能源	13,811	83,004.11	0.00

291	600021	上海电力	16,280	82,702.40	0.00
292	601003	柳钢股份	13,848	81,426.24	0.00
293	002146	荣盛发展	4,619	75,890.17	0.00
294	000755	山西三维	8,424	65,538.72	0.00
295	600761	安徽合力	6,304	64,237.76	0.00
296	000767	漳泽电力	13,385	59,295.55	0.00
297	000709	唐钢股份	146	1,141.72	0.00
298	600357	承德钒钛	111	933.51	0.00

7.3.2 积极投资部分

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	103,536,431.78	3.92
2	600036	招商银行	54,833,118.63	2.08
3	600016	民生银行	54,652,773.77	2.07
4	600030	中信证券	54,372,847.33	2.06
5	601318	中国平安	52,553,285.20	1.99
6	601169	北京银行	47,483,048.99	1.80
7	600000	浦发银行	40,650,110.89	1.54
8	601398	工商银行	36,764,610.43	1.39
9	000002	万科A	34,726,449.37	1.32
10	601088	中国神华	34,517,934.94	1.31
11	601166	兴业银行	34,059,005.90	1.29
12	601186	中国铁建	26,565,106.25	1.01
13	000001	深发展A	25,713,890.83	0.97
14	600001	邯郸钢铁	22,578,996.22	0.86
15	600050	中国联通	20,215,742.71	0.77
16	002024	苏宁电器	19,326,970.03	0.73
17	601857	中国石油	19,053,940.10	0.72
18	600519	贵州茅台	18,932,757.30	0.72
19	000623	吉林敖东	18,583,353.74	0.70
20	601899	紫金矿业	17,494,043.80	0.66

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	31,526,919.84	1.19

2	601318	中国平安	31,025,487.34	1.18
3	600036	招商银行	28,430,221.97	1.08
4	600000	浦发银行	24,970,392.54	0.95
5	601088	中国神华	21,322,987.49	0.81
6	601166	兴业银行	17,783,716.13	0.67
7	600016	民生银行	17,327,268.36	0.66
8	601328	交通银行	16,379,772.22	0.62
9	000002	万科A	16,238,250.37	0.62
10	600887	*ST伊利	15,518,140.48	0.59
11	000709	唐钢股份	15,417,431.26	0.58
12	000792	盐湖钾肥	12,594,383.33	0.48
13	600050	中国联通	12,230,440.98	0.46
14	600519	贵州茅台	11,456,024.87	0.43
15	601857	中国石油	11,264,925.98	0.43
16	000001	深发展A	11,066,583.33	0.42
17	000651	格力电器	10,645,744.72	0.40
18	600028	中国石化	10,588,633.13	0.40
19	601398	工商银行	10,292,838.19	0.39
20	601628	中国人寿	9,648,760.21	0.37

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,923,277,205.38
卖出股票收入（成交）总额	1,030,377,985.16

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,524,701.00	0.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	40,524,701.00	0.72

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	009908	99国债(8)	402,430	40,524,701.00	0.72
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	651,853.58
2	应收证券清算款	8,930,483.41
3	应收股利	1,129,218.33
4	应收利息	1,090,458.04
5	应收申购款	36,564,654.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,366,668.32

7.9.4 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。

7.9.5 期末指数投资或积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资或积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
246,602	36,111.31	1,412,346,821.04	15.86%	7,492,775,367.59	84.14%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	6,824,293.08	0.08%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年11月11日）基金份额总额	347,989,794.67
报告期期初基金份额总额	7,032,099,561.45
报告期期间基金总申购份额	6,164,682,502.21
报告期期间基金总赎回份额	4,291,659,875.03
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	8,905,122,188.63

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2009年1月17日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》，经本基金管理人

第四届董事会第九次会议审议通过，同意聘任初伟斌先生担任公司副总经理。初伟斌先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准（证监许可[2008]1481号文）。

报告期内，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

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、托管人机构及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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	1,241,196,351.77	42.02%	1,055,013.12	42.49%	
中国银河证券有限责任公司	1	738,873,542.26	25.02%	600,340.77	24.18%	
安信证券股份有限公司	1	973,585,296.51	32.96%	827,546.19	33.33%	
合计	3	2,953,655,190.54	100.00%	2,482,900.08	100.00%	

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	40,484,371.60	100%	39,000,000.00	100%	-	-
中国银河证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
合计	40,484,371.60	100%	39,000,000.00	100%	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

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

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

10.8 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	刊登了《国泰基金管理有限公司恢复旗下基金持有的邯郸钢铁等股票市价估值方法的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2008年12月30日起对本基金所持有的邯郸钢铁股票及承德钒钛股票恢复按市价估值法进行估值，自2008年12月31日起对本基金所持有的唐钢股份股票恢复按市价估值法进行估值。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2009年1月4日
2	刊登了《国泰基金管理有限公司恢复旗下基金持有的盐湖钾肥股票市价估值方法的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2009年1月5日起对本基金所持有的盐湖钾肥股票恢复按市价估值法进行估值。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2009年1月7日
3	刊登了《国泰基金管理有限公司深圳分公司成立公告》，根据中国证券监督管理委员会《关于核准国泰基金管理公司设立深圳分公司的批复》（证监许可[2009]31号），本基金管理人深圳分公司已在深圳市工商行政管理局办理完成工商注册登记，取得营业执照。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2009年2月18日
4	刊登了《国泰基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》，增聘刘翔先生担任本基金的基金经理，与黄刚先生共同管理本基金。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2009年3月12日
5	刊登了《国泰基金管理有限公司关于基金经理离任的公告》，黄刚先生不再担任本基金的基金经理，现任基金经理刘翔先生继续担任本基金的基金经理。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2009年4月1日
6	刊登了《国泰基金管理有限公司恢复旗下基金持有的长江电力股票市价估值方法的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2009年5月18日起对本基金所持有的长江电力股票恢复按市价	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2009年5月19日

	估值法进行估值。		
--	----------	--	--

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、 关于核准国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复
- 2、 国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同
- 3、 国泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议
- 4、 国泰沪深 300 指数证券投资基金半年度报告、年度报告
- 5、 报告期内披露的各项公告
- 6、 国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

11.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼。

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人，部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 38569000，400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>