

国泰沪深 300 指数证券投资基金

2009 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.4 信息披露方式

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

§ 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

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

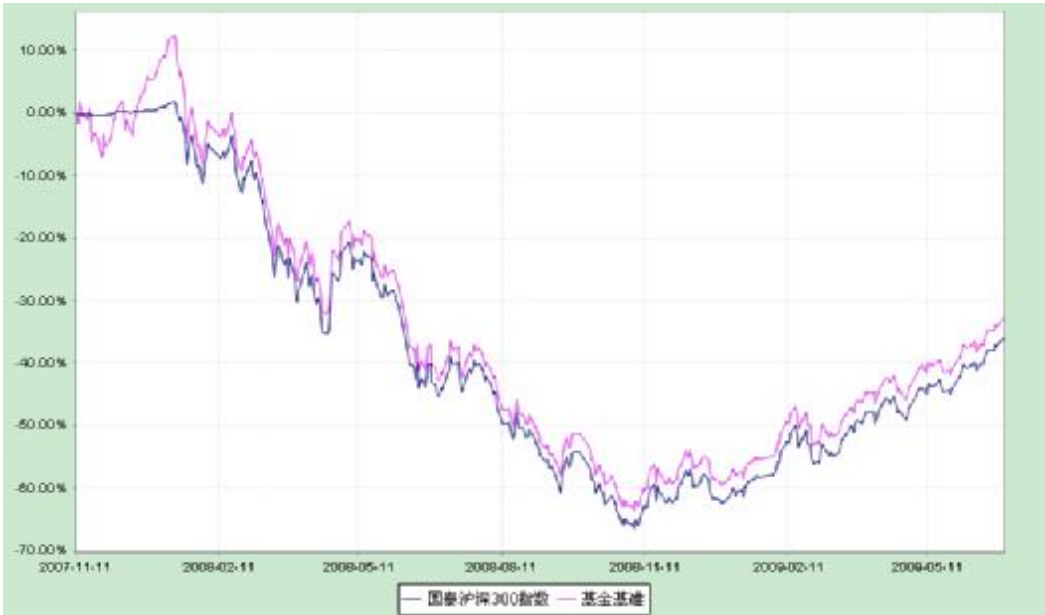
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	14.18%	1.14%	13.20%	1.10%	0.98%	0.04%
过去三个月	25.20%	1.46%	23.46%	1.40%	1.74%	0.06%
过去六个月	69.60%	1.84%	65.21%	1.77%	4.39%	0.07%
过去一年	12.77%	2.42%	12.91%	2.31%	-0.14%	0.11%
自基金合同生效起至今	-36.33%	2.42%	-33.21%	2.43%	-3.12%	-0.01%

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个月的中期反弹后，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	8,930,483.41	6,887,837.30
应收利息	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	-	-
资产总计	5,830,385,225.46	2,656,870,125.75
负债和所有者权益	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	-	-
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	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	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	6,221,326,649.31	4,912,499,527.34
未分配利润	-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	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	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	-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	30,524,628.96	28,015,616.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,628,103,295.09	-2,813,188,324.53
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	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	-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	-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 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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）。

6.4.4.1.2 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）。

6.4.4.1.3 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）。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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。

6.4.4.2.2 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。

6.4.4.3 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）。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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)。

6.4.4.4.2 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)。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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)。

6.4.5 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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。

6.4.6 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股票投资明细

7.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本管理人网站的半年度报告正文。

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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名的前十名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。