

国泰沪深300指数证券投资基金

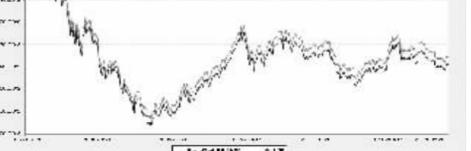
2011 第二季度报告

2011年6月30日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月十九日
重要提示
基金管理人及基金托管人根据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责任。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 22,277,299.08
2.本期利润: -281,688,907.66
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0277

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -4.50%, 1.02%, 0.99%, 0.99%, 0.03%



注:本基金合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-3-12, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 3,148,764.63
2.本期利润: -113,171,826.68
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0801

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -7.38%, 1.05%, -5.83%, 1.01%, -1.55%, 0.04%



注:本基金合同生效日为2009年10月19日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-10-19, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 3,148,764.63
2.本期利润: -113,171,826.68
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0801

注:本基金合同生效日为2009年10月19日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理 魏东 基金经理小组 简介

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1. 权益投资: 5,871,300,794.57, 94.05
2. 固定收益: 5,871,300,794.57, 94.05

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔: 19,823,249.73, 0.32
B 采掘业: 709,728,405.99, 11.43
C 制造业: 2,123,316,802.71, 34.19

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1. 600036 招商银行: 188,304,536.28, 3.03
2. 601318 中国平安: 3,631,804, 175,307,179.08, 2.82

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1. 国债: 19,918,000.00, 0.48
2. 央行票据: -

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-10-19, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1. 600036 招商银行: 188,304,536.28, 3.03
2. 601318 中国平安: 3,631,804, 175,307,179.08, 2.82

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 3,148,764.63
2.本期利润: -113,171,826.68
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0801

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -7.38%, 1.05%, -5.83%, 1.01%, -1.55%, 0.04%



注:本基金合同生效日为2009年10月19日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-10-19, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 3,148,764.63
2.本期利润: -113,171,826.68
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0801

注:本基金合同生效日为2009年10月19日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理 魏东 基金经理小组 简介

国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金

2011 第二季度报告

2011年6月30日

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月十九日
重要提示
基金管理人及基金托管人根据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责任。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 22,277,299.08
2.本期利润: -281,688,907.66
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0277

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -4.50%, 1.02%, 0.99%, 0.99%, 0.03%



注:本基金合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-3-12, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 22,277,299.08
2.本期利润: -281,688,907.66
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0277

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -4.50%, 1.02%, 0.99%, 0.99%, 0.03%



注:本基金合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-3-12, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 22,277,299.08
2.本期利润: -281,688,907.66
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0277

注:本基金合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理 魏东 基金经理小组 简介

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔: -

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1. 002230 晖生物: 1,304,401, 91,545,175.85, 4.66

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1. 002230 晖生物: 1,304,401, 91,545,175.85, 4.66

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1. 国债: 19,918,000.00, 0.48

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-3-12, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 22,277,299.08
2.本期利润: -281,688,907.66
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0277

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月: -4.50%, 1.02%, 0.99%, 0.99%, 0.03%



注:本基金合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明
1. 魏东: 基金经理, 2009-3-12, 2011-5-30, 6, 硕士研究生,曾就职于中国海外对外技术服务公司...

4.2 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

4.3 基金投资组合与其他投资风格相似的投资组合之业绩比较
本基金是被动跟踪指数的基金,无跟踪基金可供比较。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2011年第二季度,由于物价水平持续上涨,PMI指数的持续回落,投资者对通胀压力以及经济增速放缓的悲观预期,加之前期股市高位,沪深300指数的走势呈现了明显的下跌格局...

4.5 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,恪尽职守,勤勉尽责,力求实现持续、稳定、合理的投资回报。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年4月1日至2011年6月30日)
1.本期已实现收益: 22,277,299.08
2.本期利润: -281,688,907.66
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0277

注:本基金合同生效日为2007年11月11日,本基金在六个完整会计期间,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理 魏东 基金经理小组 简介