国泰沪深300指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2011年第二号)

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

重要提示

本基金由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而成。国泰金象保本增值混合证券投资基金根据中国证监会《关于同意国泰金象保本增值混合证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2004]140号)和《关于国泰金象保本增值混合证券投资基金募集时间的确认函》(基金部函[2004]109号)的核准募集。《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》于2004年11月10日正式生效。

根据《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》的规定,经基金份额持有人大会表决通过,并经中国证监会核准(证监基金字[2007]307号),本基金管理人对《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》进行了修改,国泰金象保本增值混合证券投资基金在保本期满后转型为国泰沪深300指数证券投资基金。

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》生效,《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》自该日起失效。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意,但中国证监会对本基金作出的任何决定,均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2011年11月11日,投资组合报告为2011年3季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国泰基金管理有限公司
成立日期:1998年3月5日
住所:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼
法定代表人:陈勇胜
注册资本:1.1亿元人民币
联系人:何晔
联系电话:(021)38561743
股权结构:

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

(二)基金管理人管理基金的基本情况

截至2011年11月11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18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。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。

(三)主要人员情况

1、董事会成员:

陈勇胜,董事长,硕士研究生,高级经济师,19年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理(主持工作)。1992年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理,公司总经理助理兼北京分公司总经理,1998年3月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理,1999年10月起任公司董事长、党委书记。

陈良秋,董事,大学本科。1993年7月起在中国建设银行厦门市分行工作,历任业务科副经理、办公室副总经理、支行副行长、行长。2006年10月起在中国建投工作,任企业管理部总经理助理、副总经理、投资部负责人,兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007年11月起任公司董事。

徐志斌,董事,硕士研究生。2001年8月起,先后在高盛集团工作,历任环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理;运营风险管理部总监、执行董事;市场风险管理部执行董事。2010年4月起在中国建投风险管理部工作,2010年4月起任中国建投风险管理部业务总监。2010年11月起任公司董事。

Philippe SETBON,董事,硕士研究生,EFFAS注册金融分析师。1993年起历任BOISSY GESTION SA (AZUR – GMF Group)首席执行官、ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA股票投资部总监、GENERALI FINANCES SA副总经理/投资总监、GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A/GENERALI INVESTMENTS首席执行官/投资总监、GENERALI INVESTMENTS忠利投资董事会主席/首席执行官。并兼任Generali Investments SICAV(卢森堡)主席、Generali Investments Deutschland监事会主席、Generali Fund Management副主席、Generali Investments SGR副主席、THALIA SA (Lugano)、TENAX(UK)、Generali Hedge Fund SICAV(Lugano)董事会成员等职务。2010年6月起任公司董事。

游一冰,董事,大学本科,英国特许保险学会高级会员(FCII)及英国特许保险师(Chartered Insurer)。1994年起历任中国保险(欧洲)控股有限公司总裁助理、忠利保险有限公司英国分公司、忠利亚洲中国地区总经理、中意财产保险有限公司董事、总经理,兼任中意人寿保险有限公司董事。2010年6月起任公司董事。

张和之,董事,硕士研究生,高级会计师。曾任水利电力部机关财务处主任科员,能源部机关财务处副处长,电力部机关事务局经营财务处处长,国家电力公司中兴实业发展总公司副总经理、总会计师、副董事长,中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记(正局级)、正局级调研员。2004年2月起任公司董事。

金旭,董事,硕士研究生,18年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作,历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任党支部副书记、副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007年11月起任公司董事、党委副书记。

吴鹏,独立董事,博士研究生。著名律师,执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作,日本西南大学讲授中国法律。1993年回国从事律师工作,现为北京中伦律师事务所合伙人,中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001年5月起任公司独立董事。

王军,独立董事,博士研究生,教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教,任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、执行院长。兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、中国法学会国际经济法学研究会常务副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委仲裁员、北京市华贸硅谷律师事务所兼职律师等职。2010年6月起任公司独立董事。

刘秉升,独立董事,大学学历,高级经济师。1980年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记;1982年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长;1985年起任吉林省抚松县县委常委、常务副县长;1989年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记;1995年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记;1998年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007年任海南省银行业协会会长。2010年11月起任公司董事。

韩少华,独立董事,大学专科,高级会计师。1964年起在中国建设银行河南省工作,历任河南省分行副处长、处长;南阳市分行行长、党组书记;分行总会计师。2003年至2008年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010年11月起任公司董事。

2、监事会:

唐建光,监事会主席,大学本科。1982年1月至1988年10月在煤炭工业部基建司任工程师;1988年10月至1993年7月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长;1993年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长;1995年9月至1998年10月在煤炭部基建管理中心工作,先后任综合处处长、中心副主任;1998年10月至2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理;2005年1月进入中国建银投资有限责任公司,先后任资产处置部负责人、总经理、资产管理处置部总经理、负责人,现任中国建银投资有限责任公司企业管理部高级业务总监。2010年11月起担任本公司监事会主席。

Amerigo BORRINI,监事,大学本科,CFA,金融咨询师。1967年起历任忠利集团会计结算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官。2010年6月起任本公司监事。

李芝樑,监事,硕士研究生。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传部干事,中国电力财务有限公司债券基金部副经理、经理,投资银行部主任,发展研究中心主任兼董事会办公室常务副主任。现任中国电力财务有限公司董事会办公室主任。2004年2月起任本公司监事。

沙骎,监事,硕士研究生。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券,1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团,2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司;2008年2月至2009年8月任交易部总监;2009年9月至2011年6月任研究部总监;2011年1月起兼任投资副总监。2011年4月起任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理;2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。2010年11月起担任公司职工监事。

王骏,监事,硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理,2001年10月加入国泰基金管理有限公司,从事基金登记核算工作,现任运营管理部总监。2007年11月起担任公司职工监事。

3、高级管理人员:

陈勇胜,董事长,简历情况见董事会成员介绍。

金旭,总经理,简历情况见董事会成员介绍。

巴立康,硕士研究生,高级会计师,18年证券从业经历。1993年4月至1998年4月在华夏证券工作,历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998年4月至2007年11月在华夏基金管理有限公司工作,历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。现任公司副总经理兼北京分公司总经理。

梁之平,本科,14年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理,大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监,2008年4月加入国泰基金管理有限公司,任总经理助理兼财富管理中心总经理,2010年4月起任公司副总经理兼财富管理中心总经理,2011年1月起兼任深圳分公司总经理。

李峰,硕士研究生,15年银行证券基金从业经历。1996年5月至2003年6月任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管,2003年7月至2005年5月任国联安基金管理有限公司监察稽核专员,2005年5月至2007年3月任信诚基金管理有限公司督察长,2007年4月至2009年1月任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009年2月加盟国泰基金管理有限公司,现任公司督察长。

4、本基金的基金经理

(1)现任基金经理

章赟,男,博士研究生,5年证券从业经历,2006年3月至2007年3月就职于上海天狮津泉投资咨询有限公司,任数量分析师;2007年5月至2008年4月就职于平安资产管理有限公司,任量化投资经理;2008年4月加入国泰基金管理有限公司,任数量金融分析师;2010年3月至2011年5月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理;2011年3月起担任上证180金融交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;2011年5月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理。

林海,男,硕士研究生。曾任职于银河证券。2003年7月加入国泰基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理,2009年10月至2010年10月任国泰稳健增值混合型资产管理计划的投资经理,2009年11月至2011年2月任国泰隆腾红利灵活配置型-09年第一期资产管理计划的投资经理,2011年4月至2011年6月任财富管理中心投资大使,2011年7月起任国泰沪深300指数基金的基金经理。

(2)历任基金经理

自本基金成立至2009年3月11日,由黄刚担任本基金的基金经理,自2009年3月12日至2009年3月31日,由黄刚和刘翔共同担任本基金的基金经理;自2009年4月1日至2011年5月8日,由刘翔担任本基金的基金经理;自2011年5月9日至2011年5月30日由刘翔和章赟共同担任本基金的基金经理;自2011年5月31日至2011年7月14日由章赟担任本基金的基金经理;自2011年7月15日起至今由章赟和林海共同担任本基金的基金经理。

(3)相关研究人员配备情况

为确保实现基金合同规定的投资目标,本基金专门配备了精通数量分析的金融工程师和基本面分析研究员协助基金经理的投资管理工作。金融工程部负责数量化分析,根据标的指数的变化等因素提出投资组合管理建议,研究开发部在对宏观经济发展态势、利率走势和行业个股分析的基础上提出研究分析报告。

5、投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会,其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员,督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同,审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则,以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下:

金旭女士:总经理
梁之平先生:副总经理兼深圳分公司总经理和财富管理中心总经理
张人蟠先生:总经理助理
周向勇先生:总经理助理
刘夫先生:投资副总监
沙骎先生:投资副总监
张则斌先生:财富管理中心投资总监
黄焱先生:投资副总监兼基金管理部总监
张玮先生:投资副总监兼研究部总监
裴晓辉先生:固定收益投资总监兼固定收益部总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
变更注册登记日期:2004年8月26日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:肖 钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:唐州徽
电话:(010)66594855
传真:(010)66594942
发展概况:

1912 年2 月,经孙中山先生批准,中国银行正式成立。从1912 年至1949 年,中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能,坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。新中国成立后,中国银行长期作为国家外汇专业银行,成为国家对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年,中国银行改为国有独资商业银行。2003 年,中国银行启动股份制改造。2004 年8 月,中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年6 月、7 月,先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市,成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行,在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务,主要经营商业银行业务,包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务,并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务, 通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务, 通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务,通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务,通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中,中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风,得到了业界和客户的广泛认可和赞誉,树立了卓越的品牌形象。2010年度,中国银行被Global Finance(《环球金融》)评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行,被Euromoney(《欧洲货币》)评为2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”,被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖,被The Asset(《财资》)评为中国最佳贸易融资银行,被Finance Asia(《金融亚洲》)评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行,被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇,中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展,向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队,现有员工110余人,其中,90%以上的员工具备本科以上学历。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元,居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至2011年9月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、景顺长城医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等128只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司上海直销柜台	地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		电话:021-38561759	传真:021-68775881
		客户服务专线:400-888-8688,021-38569000	
		联系人:蔡丽萍	网址:www.gtfund.com
2	国泰基金管理有限公司北京直销柜台	地址:中国北京市西城区金融大街7号第5层	
		电话:010-66553078	传真:010-66553082
		联系人:王彬	
3	国泰基金电子交易平台	网站:www.gtfund.com登录网上交易页面	
		电话:021-38561739	联系人:徐怡

2、代销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	中国银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号	
		法定代表人:肖钢	联系人:客户服务中心
		客服电话:95566	网址:www.boc.cn
2	中国建设银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街25号	
		办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
		法定代表人:张建国(代行)	客服电话:95533
		网址:www.ccb.com	
3	中国农业银行股份有限公司	注册地址:北京市东城区建国门内大街69号	
		办公地址:北京市东城区建国门内大街69号	
		法定代表人:项俊波	客户服务电话:95599
		联系人:滕涛	传真:010-85109219
		网址:www.95599.cn	
4	中国工商银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号(100005)	
		办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号(100005)	
		法定代表人:姜建清	电话:95588
		网址:www.icbc.com.cn	
5	交通银行股份有限公司	注册地址:上海市银城中路188号	
		法定代表人:胡怀邦	客服电话:95559
		联系人:曹榕	电话:021-58781234
		网址:www.bankcomm.com	
6	招商银行股份有限公司	注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
		法定代表人:傅育宁	联系人:邓炯鹏
		电话:0755-83198888	传真:0755-83195109
		客户服务热线:95555	网址:www.cmbchina.com
7	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号	
		办公地址:上海市中山东一路12号	
		法定代表人:吉晓辉	电话:021-61618888
		联系人:汤嘉惠、虞谷云	客户服务热线:95528
		网址:www.spdb.com.cn	
8	华夏银行股份有限公司	注册地址:北京市东城区建国门内大街22号	
		办公地址:北京市东城区建国门内大街22号	
		法定代表人:吴建	客服服务热线:95577
		网址:www.hxb.com.cn	
9	中信银行股份有限公司	注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
		法定代表人:孔丹	联系人:丰靖
		电话:010-65550827	传真:010-65550827
		客服电话:95558	网址:bank.ecitic.com
10	中国民生银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号	
		法定代表人:董文标	联系人:董云巍、吴海鹏
		电话:010-58351666	传真:010-83914283
		客服电话:95568	网址:www.cmbc.com.cn
11	北京银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街17号首层	
		法定代表人:闫冰竹	联系人:王曦
		电话:010-66223584	传真:010-66226045
		客服电话:010-95526	
		网址:www.bankofbeijing.com.cn	
12	中国邮政储蓄银行有限责任公司	注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号	
		法定代表人:刘安东	联系人:陈春林
		客服电话:95580	网址:www.psbc.com
13	中国建银投资证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层	
		法定代表人:杨明辉	联系人:刘毅
		电话:0755-82023442	客服电话:400-600-8008
		网址:www.cjis.cn	
14	国泰君安证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区商城路618号	
		法定代表人:万建华	联系人:芮敏祺
		电话:021-38676161	传真:021-38670161
		客服电话:400-888-8666	网址:www.gtja.com
15	宏源证券股份有限公司	注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号	
		法定代表人:冯戎	联系人:李巍
		电话:010-88085858	传真:010-88085195
		客服电话:400-800-0562	网址:www.hysec.com
16	万联证券有限责任公司	注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层	
		法定代表人:张建军	联系人:罗创斌
		电话:020-37865070	传真:020-22373718-1013
		客服电话:400-888-8133	网址:www.wlzq.com.cn
17	中信建投证券股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼	
		法定代表人:王常	联系人:魏明
		电话:010-85130588	传真:010-65182261
		客服电话:400-888-8108	网址:www.csc108.com
18	海通证券股份有限公司	注册地址:上海市淮海中路98号	
		法定代表人:王开国	联系人:李笑鸣
		电话:021-23219000	传真:021-23219100
		客服电话:400-888-8001(全国),021-95553	
		网址:www.htsec.com	
19	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
		法定代表人:顾伟国	联系人:田薇
		电话:010-66568430	传真:010-66568536
		网址:www.chinastock.com.cn	
20	中信金通证券有限责任公司	注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19楼	
		法定代表人:沈强	联系人:丁思聪
		电话:0571-87112510	客服电话:0571-96598
		网址:www.bigsun.com.cn	
21	申银万国证券股份有限公司	注册地址:上海市常熟路171号	
		法定代表人:丁国荣	联系人:邓寒冰
		电话:021-54033888	传真:021-54038844
		客服电话:021-962505	网址:www.sw2000.com.cn
22	东方证券股份有限公司	注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层	
		法定代表人:王益民	联系人:吴宇
		电话:021-63325888	传真:021-63326173
		客服电话:95503	网址:www.dfzq.com.cn
23	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层	
		法定代表人:吴永敏	联系人:方晓丹
		电话:0512-65581136	传真:0512-65588021
		客服电话:0512-33396288	网址:www.dwzq.com.cn
24	广发证券股份有限公司	注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼	
		办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、41和42楼	
		法定代表人:王志伟	联系人:黄岚
		电话:020-87555888	传真:020-87555305
		客服电话:95575	网址:www.gf.com.cn
25	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市永叔路15号	
		办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼	
		法定代表人:曾小普	联系人:徐美云
		电话:0791-6285337	传真:0791-6288690
		网址:www.gsstock.com	
26	民生证券有限责任公司	注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座	
		法定代表人:岳献春	联系人:赵明
		电话:010-85252656	传真:010-85252655
		客服电话:400-619-8888	网址:www.mszq.com
27	上海证券有限责任公司	注册地址:上海市西藏中路336号	
		法定代表人:郁忠民	联系人:张瑾
		电话:021-53519888	传真:021-53519888
		客服电话:021-962518	网址:www.962518.com
28	光大证券股份有限公司	注册地址:上海市静安区新闸路1508号	
		法定代表人:徐浩明	联系人:刘晨
		电话:021-22169999	传真:021-22169134
		客服电话:10108998、400-888-8788	
		网址:www.ebscn.com	
29	中信万通证券有限责任公司	注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层1507-1510室	
		办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)	
		法定代表人:张智河	联系人:吴忠超
		电话:0532-85022273	传真:0532-85022605
		客服电话:0532-96577	网址:www.zxwt.com.cn
30	中信证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层	
		法定代表人:王东明	联系人:陈忠
		电话:010-84588888	传真:010-84865560
		网址:www.ecitic.com	
31	华泰证券有限责任公司	注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦	
		办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦	
		法定代表人:吴万善	联系人:张小波
		电话:025-84457777	网址:www.htzq.com.cn
		客服电话:95597	
32	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦	
		法定代表人:胡运钊	联系人:李良
		电话:021-63219781	传真:021-51062920
		客服电话:95579	网址:www.95579.com
33	国海证券有限责任公司	注册地址:广西南宁市滨湖路46号	
		法定代表人:张雅锋	联系人:武斌
		电话:0755-83707413	传真:0755-83700205
		客服电话:400-888-8100(全国)、96100(广西)	
		网址:www.ghzq.com.cn	
34	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号	
		办公地址:天津市河西区宾水道3号	
		法定代表人:杜庆平	联系人:王兆权
		电话:022-28451861	传真:022-28451892
		客服电话:400-651-5988	网址:www.bhzq.com
35	华泰联合证券有限责任公司	注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层	
		法定代表人:马昭明	联系人:盛宗凌
		电话:0755-82492000	传真:0755-82492962
		客服电话:400-888-8555或95513	
		网址:www.lhzq.com	
36	中原证券股份有限公司	注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号	
		办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号17层	
		法定代表人:石保上	联系人:程月艳、耿铭
		电话:0371-65585670	传真:0371-65585665
		客服电话:400-813-96660371-967218	
		网址:www.ccnew.com	
37	国信证券股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼	
		法定代表人:何如	联系人:齐晓燕
		电话:0755-82130833	传真:0755-82133952
		客服电话:95536	网址:www.guosen.com.cn
38	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	
		法定代表人:宫少林	联系人:黄健
		电话:0755-82943666	传真:0755-82943636
		网址:www.newone.com.cn	
		客服电话:400-888-8111\95565	
39	兴业证券股份有限公司	注册地址:福建省福州市湖东路268号证券大厦	
		法定代表人:兰荣	联系人:谢高得
		电话:021-38565785	传真:021-38565783
		客服电话:400-888-8123	网址:www.xyzq.com.cn
40	齐鲁证券有限公司	注册地址:山东省济南市市中区经七路86号	
		办公地址:山东省济南市市中区经七路86号	
		法定代表人:李玮	联系人:吴阳
		电话:0531-68889155	传真:0531-68889752
		客服电话:95538	网址:www.qlzq.com.cn
41	安信证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元	
		法定代表人:牛冠兴	联系人:张勤
		联系电话:021-68801217	传真:021-68801119
		客服电话:400-800-1001	网址:www.essence.com.cn
42	东莞证券有限责任公司	注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	
		法定代表人:游锦辉	联系人:梁健伟
		电话:0769-22119341	传真:0769-22116999
		客服电话:0769-961130	网址:www.dgzq.com.cn
43	恒泰证券股份有限公司	注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号	
		法定代表人:庞介民	联系人:常向东
		电话:0471-4913998	传真:0471-4930707
		客服电话:0471-4961259	网址:www.cnht.com.cn
44	厦门证券有限公司	注册地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼	
		法定代表人:傅毅辉	联系人:卢金文
		电话:0592-5161642	传真:0592-5161140
		客服电话:0592-5163588	网址:www.xmzq.cn
45	华宝证券有限责任公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层	
		法定代表人:陈林	联系人:刘闻川
		电话:021-50122222	传真:021-50122200
		客服电话:400-820-9898	网址:www.cnhbstock.com
46	英大证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层	
		法定代表人:赵文安	联系人:王睿
		电话:0755-83007069	传真:0755-83007167
		客服电话:400-869-8698	网址:www.ydsc.com.cn
47	中国国际金融有限公司	注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	
		法定代表人:李剑阁	联系人:罗文雯
		电话:010-65051166	传真:010-65051156
		网址:www.cicc.com.cn	
48	华福证券有限责任公司	注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层	
		法定代表人:黄金琳	联系人:张腾
		电话:0591-87278701	传真:0591-87841150
		客服电话:0591-96326	网址:www.hfzq.com.cn
49	天相投资顾问有限公司	注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
		法定代表人:林义相	联系人:林爽
		电话:010-66045608	传真:010-66045500
		客服电话:010-66045678	网址:www.txsec.com
50	信达证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
		法定代表人:高冠江	联系人:唐静
		电话:010-88656100	传真:010-88656290
		客服电话:400-800-8899	网址:www.cindasc.com
51	中国民族证券有限责任公司	注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层	
		法定代表人:赵大建	联系人:李薇
		电话:010-59355941	传真:010-66553791
		客服电话:400-889-5618	网址:www.e5618.com
52	华龙证券有限责任公司	注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号	
		法定代表人:李晓安	联系人:李昕田
		电话:0931-8888088	传真:0931-4890515
		客服电话:0931-4890100、4890619、4890618	
		网址:www.hlzqgs.com	
53	国元证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市寿春路179号	
		法定代表人:凤良志	联系人:祝丽萍
		电话:0551-2257012	传真:0551-2272100
		客服电话:95578	网址:www.gyzq.com.cn
54	杭州银行股份有限公司	注册地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦	
		法定代表人:吴太普	联系人:严峻
		电话:0571-85163127	传真:0571-85179591
		客服电话:400-888-8508	网址:www.hzbank.com.cn
55	渤海银行股份有限公司	注册地址:天津市河西区马场道201-205号	
		法定代表人:刘宝凤	联系人:王宏
		电话:022-58316666	传真:022-58316259
		客服电话:400-888-8811	网址:www.cbhb.com.cn
56	青岛银行股份有限公司	注册地址:青岛市市南区香港中路68号华普大厦	
		法定代表人:郭少泉	联系人:滕克
		电话:0532-85709732	传真:0532-85709725
		客服电话:96588(青岛)400-669-6588(全国)	
		网址:www.qdccb.com	
57	西部证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼	
		法定代表人:刘建武	联系人:冯萍
		电话:029-87406488	传真:029-87406387
		客服电话:95582	网址:www.westsecu.com
58	德邦证券有限责任公司	注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼	
		法定代表人:姚文平	联系人:罗芳
		电话:021-68761616	传真:021-68767981
		客服电话:4008888128	网址:www.tebon.com.cn
59	中航证券有限公司	注册地址:南昌市抚河北路291号	
		法定代表人:杜航	联系人:余雅娜
		电话:0791-6768763	传真:0791-6789414
		客服电话:400-8866-567	网址:www.avicsec.com
60	洛阳银行股份有限公司	注册地址:洛阳市新区开元大道与通济街交叉口	
		法定代表人:王建甫	联系人:胡艳丽
		电话:0379-65921977	传真:0379-65920155
		客服电话:0379-96699	
		网址:www.bankofluoyang.com.cn	
61	东海证券有限责任公司	注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼	
		法定代表人:朱科敏	联系人:李涛
		电话:0519-88157761	传真:0519-88157761
		客服电话:400-888-8588	网址:www.longone.com.cn
62	方正证券股份有限公司	注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层	
		法定代表人:雷杰	联系人:彭博
		电话:0731-85832343	传真:0731-85832214
		客服电话:95571	网址:www.foundersc.com
63	山西证券股份有限公司	注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	
		法定代表人:侯巍	联系人:郭熠
		电话:0351-8686659	传真:0351-8686619
		客服电话:400-666-1618	网址:www.i618.com.cn
64	深圳农村商业银行股份有限公司	注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路3038号合作金融大厦	
		法定代表人:李伟	联系人:曾明 宋永成
		电话:0755-25188269	传真:0755-25188785
		客服电话:4001961200	网址:www.961200.net
65	湘财证券有限责任公司	注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼	
		法定代表人:林俊波	联系人:钟康莺
		电话:021-68634518	传真:021-68865680
		客服电话:400-888-1551	网址:www.xcsc.com
66	华融证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区月坛北街26号	
		法定代表人:丁之锁	联系人:陶颖
		电话:010-58568040	传真:010-58568062
		客服电话:010-58568118	网址:www.hrsec.com.cn
67	日信证券有限责任公司	注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号	
		法定代表人:孔佑杰	联系人:陈韦杉
		电话:010-66413306	传真:010-66412537
		客服电话:010-88086830	网址:www.rxzq.com.cn
68	江海证券有限公司	注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
		法定代表人:孙名扬	联系人:张宇宏
		电话:0451-82336863	传真:0451-82287211
		客服电话:400-666-2288	网址:www.jhzq.com.cn
69	广州证券有限责任公司	注册地址:广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼	
		法定代表人:刘东	联系人:林洁茹
		电话:020-87322668	传真:020-87325036
		客服电话:020-961303	网址:www.gzs.com.cn
70	大连银行股份有限公司	注册地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼	
		法定代表人:陈占维	联系人:李鹏
		电话:0411-82308602	传真:0411-82311420
		客服电话:400-664-0099	网址:www.bankofdl.com
71	天源证券经纪有限公司	注册地址:青海省西宁市长江路53号	
		法定代表人:林小明	联系人:王斌
		电话:0755-33331188	传真:0755-33329815
		客服电话:4006543218	网址:www.tyzq.com.cn

(二)注册登记机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		法定代表人:陈勇胜	传真:021-38561800
		联系人:何晔	
		客户服务专线:400-888-8688,021-38569000	

(三)出具法律意见书的律师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	上海源泰律师事务所	注册地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼	
		负责人:廖海	联系人:廖海
		电话:021-51150298	传真:021-51150398
		经办律师:廖海、吕红	

(四)会计师事务所和经办注册会计师

序号	机构名称	机构信息	
1	普华永道中天会计师事务所有限公司	注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	
		办公地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	
		法人代表:杨绍信	联系人:单峰
		电话:021-61238888	传真:021-61238800
		经办注册会计师:汪棣、单峰	

四、基金名称

国泰沪深300指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式,股票型指数基金

六、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。

七、投资范围

本基金投资于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%。本基金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%。

本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具,在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。

八、投资理念

本基金采取被动式指数化投资管理方式,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。

九、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。

十、业绩比较基准

业绩基准=90%×沪深300指数收益率+10%×银行同业存款收益率

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同开发的中国A股市场指数,它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数,流动性高,可投资性强,综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况,其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用,能够作为指数基金的跟踪标的。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数,或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的跟踪目标和投资对象,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。但无论因为疏忽或其他原因,中证指数有限公司,上海证券交易所,深圳证券交易所不因指数的任何错误对任何人负责,也无义务对任何人和任何错误给予建议。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

十一、风险收益特征

本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

十二、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定,于2011年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截止2011年9月30日。本报告中财务资料未经审计。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,072,401,757.90	93.67
	其中:股票	5,072,401,757.90	93.67
2	固定收益投资	144,295,689.20	2.66
	其中:债券	144,295,689.20	2.66
	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	192,866,652.47	3.56
6	其他各项资产	5,364,933.70	0.10
7	合计	5,414,929,033.27	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1、积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	7,989,006.24	0.15
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	7,989,006.24	0.15
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	7,989,006.24	0.15

2、指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	28,875,839.28	0.53
B	采掘业	649,761,233.09	12.02
C	制造业	1,842,270,577.92	34.07
C0	食品、饮料	365,394,853.35	6.76
C1	纺织、服装、皮毛	18,293,012.63	0.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	102,951,773.95	1.90
C5	电子	63,767,742.65	1.18
C6	金属、非金属	425,794,143.54	7.87
C7	机械、设备、仪表	628,041,688.32	11.61
C8	医药、生物制品	228,155,787.24	4.22
C99	其他制造业	9,871,576.24	0.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	108,217,336.09	2.00
E	建筑业	142,279,188.02	2.63
F	交通运输、仓储业	185,566,898.18	3.43
G	信息技术业	172,425,605.26	3.19
H	批发和零售贸易	155,979,502.79	2.88
I	金融、保险业	1,396,792,840.80	25.83
J	房地产业	238,804,748.13	4.42
K	社会服务业	36,590,461.36	0.68
L	传播与文化产业	11,040,020.06	0.20
M	综合类	95,808,500.68	1.77
	合计	5,064,412,751.66	93.65

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名指数投资明细和前五名积极投资明细

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十名股票投资明细

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	13,036,480	144,183,468.80	2.67
2	600016	民生银行	23,812,252	131,443,631.04	2.43
3	601318	中国平安	3,532,297	118,579,210.29	2.19
4	601328	交通银行	24,136,984	108,133,688.32	2.00
5	600000	浦发银行	11,796,960	100,746,038.40	1.86
6	601166	兴业银行	7,958,383	98,604,365.37	1.82
7	601088	中国神华	3,477,243	88,113,337.62	1.63
8	600519	贵州茅台	437,645	83,410,760.55	1.54
9	600030	中信证券	7,338,379	82,556,763.75	1.53
10	000002	万 科A	10,201,667	73,860,069.08	1.37

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

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	000959	首钢股份	1,849,307	7,989,006.24	0.15

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,994,000.00	0.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,144,000.00	2.22
	其中:政策性金融债	120,144,000.00	2.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,157,689.20	0.08
8	其他	-	-
9	合计	144,295,689.20	2.67

(五)报告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

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	110239	11国开39	1,000,000	100,150,000.00	1.85
2	110242	11国开42	200,000	19,994,000.00	0.37
	080019	08国债19	200,000	19,994,000.00	0.37
4	110018	国电转债	28,960	2,820,993.60	0.05
5	113002	工行转债	13,110	1,336,695.60	0.02

(六)报告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。

(七)报告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。

(八)投资组合报告附注

1、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。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	638,549.12
2	应收证券清算款	101,261.03
3	应收股利	578,561.48
4	应收利息	1,675,811.07
5	应收申购款	2,370,751.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,364,933.70

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	1,336,695.60	0.02

5、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。

6、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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000959	首钢股份	7,989,006.24	0.15	公布重大事项停牌

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年6月30日。

基金管理人依照恪守职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007年11月11日至2007年12月31日	0.41%	0.09%	5.38%	1.75%	-4.97%	-1.66%
2008年度	-62.61%	2.78%	-61.64%	2.73%	-0.97%	0.05%
2009年度	89.60%	1.93%	84.85%	1.85%	4.75%	0.08%
2010年度	-11.67%	1.50%	-11.03%	1.43%	-0.64%	0.07%
2011年上半年	-2.07%	1.15%	-2.31%	1.11%	0.24%	0.04%
2007年11月11日至2011年6月30日	-38.43%	2.00%	-35.05%	1.98%	-3.38%	0.02%

十四、基金费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
4、基金合同生效以后的信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效以后的会计师费和律师费;
7、基金的资金汇划费用;
8、基金的指数使用费;
9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.5%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第(一)款第3至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

本条第一款约定以外的其他费用, 以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

(四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施前2日依照有关规定在指定媒体上公告。

(五)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理方法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2011年6月24日刊登的本基金招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

1、在“重要提示”部分,更新了招募说明书内容的截止日期;
2、更新了“第三节 基金管理人”中的相关信息;
3、更新了“第四节 基金托管人”中的相关信息;
4、更新了“第五节 相关服务机构”中的相关信息;
5、更新了“第十节 基金的投资”中基金投资组合报告为本基金2011年3季度报告的内容;
6、更新了“第十一节 基金的业绩”,该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核;
7、更新了“第二十二节 对基金份额持有人的服务”中的相关内容;
8、更新了“第二十三节 其他应披露事项”,披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告;

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文,可登录国泰基金管理有限公司网站www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司
二〇一一年十二月二十四日