

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
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。

国泰沪深300指数证券投资基金

2011年度 报告摘要

2011年12月31日

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码. Rows include 国泰沪深300指数证券投资基金, 基金代码: 020011, 交易代码: 020011, 基金运作方式: 契约型, 封闭式, 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, 基金合同生效日期: 2009年11月11日, 截止2011年12月31日, 基金份额总额: 10,557,466.420,931份, 基金合同存续期限: 不定期.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Rows include 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, 名称: 国泰沪深300指数证券投资基金, 基金代码: 020011, 基金简称: 沪深300, 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, 基金合同生效日期: 2009年11月11日, 截止2011年12月31日, 基金份额总额: 10,557,466.420,931份, 基金合同存续期限: 不定期.

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 3 columns: 项目, 2011年, 2010年, 2009年. Rows include 本期利润总额, 本期净利润, 本期经营活动产生的现金流量净额, 本期投资收益, 本期公允价值变动收益, 本期所得税费用, 本期其他综合收益, 本期其他权益变动, 本期其他综合收益结转留存收益, 本期其他综合收益结转留存收益, 本期其他综合收益结转留存收益.

3.2 基金业绩表现

Table with 3 columns: 阶段, 沪深300指数涨跌幅, 基金净值增长率, 业绩比较基准, 跟踪误差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

3.3 基金业绩表现



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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

3.3 基金业绩表现

Table with 3 columns: 阶段, 沪深300指数涨跌幅, 基金净值增长率, 业绩比较基准, 跟踪误差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

3.3 基金业绩表现

Table with 3 columns: 阶段, 沪深300指数涨跌幅, 基金净值增长率, 业绩比较基准, 跟踪误差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

3.3 基金业绩表现

Table with 3 columns: 阶段, 沪深300指数涨跌幅, 基金净值增长率, 业绩比较基准, 跟踪误差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

3.3 基金业绩表现

Table with 3 columns: 阶段, 沪深300指数涨跌幅, 基金净值增长率, 业绩比较基准, 跟踪误差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

3.3 基金业绩表现

Table with 3 columns: 阶段, 沪深300指数涨跌幅, 基金净值增长率, 业绩比较基准, 跟踪误差. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效以来.

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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

打打打,四季度随着通货膨胀率的较大回落,对我国实体经济增长减缓乃至加速下滑的担忧充斥了整个资本市场,年末存款准备金率上调下注无法扭转局势,投资者市场预期过度悲观,市场人气低迷低迷,成交量萎靡,股市连续下跌,投资者信心低落.

2011年沪深300指数在年初的冲高回落,以及经济复苏的放缓,不确定性构成了负面的外围环境,外汇占款出现下降趋势,人民币兑美元汇率升值预期减弱,此外,高铁事故,日本核泄漏危机等“黑天鹅”事件进一步对指数下跌起到了推波助澜的作用.总体而言,沪深300指数的走势整体体现了较明显的单边下跌特征.

4.2 跟踪误差:报告期内,跟踪误差为0.0048%,范围在-0.165%至0.149%之间.跟踪误差 TE 低于基金合同约定的0.35%,TD和TE变化相对较小,表明本基金所采用的跟踪技术稳定可靠.4.4.2 报告期内基金的业绩表现:本基金2011年度净值增长率为-23.57%,同期业绩比较基准为-22.62%.

4.5 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.6 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.7 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.8 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.9 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.10 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.11 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.12 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

4.13 基金管理人报告期末基金资产净值及基金份额总额:截至2011年12月31日,本基金资产净值为人民币1,055,746.420,931.00元,基金份额总额为10,557,466.420,931.00份.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益, 当期实现的基金公允价值变动损益.

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结束时,各项资产配置比例符合合同约定.

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细,应阅读载于本基金管理人网站的年度报告正文.8.3.2 期末积极投资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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 000629 攀钢钒钛, 2 000511 海螺水泥, 3 601991 大唐发电, 4 600252 中广集团, 5 002038 双环药业.

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细,应阅读载于本基金管理人网站的年度报告正文.8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.8.4.1 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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 000776 广发证券, 2 600837 海南高速, 3 600887 伊利股份, 4 600406 国电铝业, 5 002304 洋河股份.

注:买入金额按买入成交金额(成交金额按成交数量*成交价)计算,不考虑相关交易费用.8.4.2 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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.

注:卖出金额按卖出成交金额(成交金额按成交数量*成交价)计算,不考虑相关交易费用.8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额. Rows include 1 600036 招商银行, 2 601118 中国平安, 3 601166 兴业银行, 4 601328 交通银行, 5 600116 民生银行.