

国泰沪深 300 指数证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年四月二十二日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2013年4月17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。
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。
4.2 投资者应当认真阅读本报告，投资者自主作出投资决策后自行承担投资风险，投资者自行承担投资风险。本报告所载数据仅供参考。
本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	国泰沪深 300 指数
基金代码	020011
交易代码	020011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2007年11月14日
报告期末基金份额总额	319,009,880.24份
投资目标	本基金以沪深 300 指数为标的指数，通过被动式跟踪复制标的指数成份股构成跟踪组合，力争取得本基金净值增长率与业绩比较基准之间的差额长期不超过 0.5%，实现对沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以完全复制为目标和复制策略，按照成份股在沪深 300 指数中的权重和复制比例进行投资，力争取得本基金净值增长率与业绩比较基准之间的差额长期不超过 0.5%，实现对沪深 300 指数的有效跟踪。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

1.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

项目	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-159,191,812.27	
2.本期利润	-20,534,701.99	
3.本期公允价值变动损益	-40,026.10	
4.期末基金资产净值	5,426,511,267.45	
5.期末基金份额净值	1.71	

3.2 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-1.38%	1.47%	-0.92%	1.48%	-0.46%	0.01%

3.3 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

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
过去三年	-1.38%	1.47%	-0.92%	1.48%	-0.46%	0.01%

3.4 投资组合报告

3.4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.5 投资组合报告

3.5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.6 投资组合报告

3.6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.7 投资组合报告

3.7.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.8 投资组合报告

3.8.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.9 投资组合报告

3.9.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.10 投资组合报告

3.10.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.11 投资组合报告

3.11.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.12 投资组合报告

3.12.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.13 投资组合报告

3.13.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.14 投资组合报告

3.14.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.15 投资组合报告

3.15.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.16 投资组合报告

3.16.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.17 投资组合报告

3.17.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.18 投资组合报告

3.18.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.19 投资组合报告

3.19.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.20 投资组合报告

3.20.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.21 投资组合报告

3.21.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.22 投资组合报告

3.22.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.23 投资组合报告

3.23.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.24 投资组合报告

3.24.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.25 投资组合报告

3.25.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.26 投资组合报告

3.26.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.27 投资组合报告

3.27.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.28 投资组合报告

3.28.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.29 投资组合报告

3.29.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40

3.30 投资组合报告

3.30.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	5,398,091,366.49	98.48
2	固定收益投资	5,398,091,366.49	98.48
3	金融资产投资	5,398,091,366.49	98.48
4	其他资产	76,212,607.76	1.40
5	负债和所有者权益	76,212,607.76	1.40