

(上接B45版)		
(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(特殊普通合伙)	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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼 联系人:杨柳青 电话:021-61238888 传真:021-61238800
四、基金名称	国泰沪深300指数投资基金	

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

本基金主要具有流动性的金融工具,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子股票资产的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(含一年)的政府债券不低子基金资产净值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

本基金将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指数中的基本权重构建指数化投资组合。当期或次期发生调整或成份股发生配股、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有影响力的一批优质大盘企业的整体状况,其中包括上市公司对中国经济发展具有举足轻重的作用,能够作为指数基金的跟踪对象。

如果基金经理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的重大变更导致该指数无法继续作为目标指数,或者证券市场上有其他指数更加强、更适合投资的指数推出,基金管理人应及时选择新的目标指数,并在变更前两个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的准确性。但无论因何原因导致其他原因,中证指数有限公司、上海证券交易所、深圳证券交易所不因该指数的任何错误对任何个人负责,也无义务对任何个人和任何错误给予纠正。关于指数值和成分股的所有权归中证指数有限公司所有。

十一、风险收益特征

本基金属于高风险的证券投资基金品种。

十二、基金投资组合报告

本基金管理人的代理人及律师事务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、完整性、准确性和完整性承担连带责任。

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2013年4月17日复核了本报告中的财务指

标、净值表现和组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告投资组合报告数据截至2013年3月31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

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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(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十名债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(六)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(七)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(八)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(九)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十一)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十二)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十三)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十四)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十五)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十六)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十七)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十八)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(十九)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十一)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十二)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十三)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十四)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十五)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十六)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十七)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十八)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(二十九)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十一)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十二)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十三)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十四)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十五)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十六)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十七)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十八)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(三十九)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十一)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十二)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十三)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十四)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十五)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十六)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十七)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十八)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(四十九)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十一)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十二)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贵金属

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十三)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保险类资产

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十四)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股票投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十五)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债券投资明细

本基金本期末未积存投资部未持有股票。

(五十六)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资产支持证券

本基金本期末未积存投资部未持有股票。