



# Disclosure 信息披露

2013年6月21日 星期五  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B47

(上接B45版)

## (四)会计师事务所和经办注册会计师

序号	执 业 名 称	职 务 简 介
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:上海市南京路202号普华永道中心11楼 法定代表人:杨俊海 电话:(021-602138888 经办注册会计师:汪捷、胡蔚忠

## 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数字化投资方法,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均跟踪误差不得超过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(一级市场初次发行及再发行)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总额的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,本基金可以参与其它证券投资范围。

## 八、投资策略

本基金采取被动式数字化投资管理方式,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、投资流程

本基金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。当期成份股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、发布的全国市场指数,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龙头企业的整体状况,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良好标的。

如果基金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变更而导致该指数不宜继续作为目标指数,或者证券市场出现其他更权威、更合适投资的指数推出,本基金管理人有权变更该指数的跟踪目标投资对象,并在变更投资对象后个工作日内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数据的任何错误对任何人负责,也无义务对任何人 and 任何错误给予建议。关于指数值和成份股名单的所有所有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法律责任。

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2013年3月31日,本报告中所列财务资料未经审计。

## (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	5,098,901,306.69	93.48
	其中:股票	5,098,901,306.69	93.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	76,212,007.70	1.40
	其中:债券	76,212,007.70	1.40

(上接B46版)

1. 风险评价小组对基金投资组合偏离风险进行评估,并提出偏离的风险分析报告,在组合日均跟踪误差超过0.5%时提出预警;

(2) 监督稽核部对投资组合进行稽查并出具稽查报告;

1. 基金管理人根据指数成份股构成,在规定的数量范围内组合中各个股票的性质分类、输入交易系统;

2. 基金管理人根据指数成份股构成,在规定的数量范围内组合中各个股票的性质分类、输入交易系统;

3. 对于新增或组合中交易出现频率的低股,基金管理人独立发出指令,交易员可在交易时间内进行单个品种申购;

4. 确定定期定额申购或定投计划,并定期定额申购或定投计划,并定期定额申购或定投计划,并定期定额申购或定投计划;

5. 当发生新增或申购或定投计划时,研究部提供拟发行新股企业和增发企业的研究报告;投资部根据报告对新增或申购或定投计划进行审核;

6. 本基金的申购和赎回。

## (二)投资组合

本基金管理人根据相关法律法规及《基金合同》规定,运作管理本基金。

本基金投资组合遵循下列规定:

(1) 本基金持有1只以上上市公司股票,其市值不超过本基金资产净值的10%,但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外;

(2) 本基金由基金管理人管理的其他基金持有1家公司资产净值的不超过该资产的10%,但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外;

(3) 法律法规和中国证监会的其他比例限制。

禁止本基金资产用于下列行为:

(1) 承销证券;

(2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;

(3) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资;

(4) 从基金管理人管理的其他基金中购买基金;

(5) 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人具有关联关系的公司发行的证券;

(6) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他行为。

## 十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准由中证指数有限公司编制,代表中国A股市场的所有股票资产衡量基金投资操作水平的比较基准。目前这一指数为MSCI中国A股指数,其计算公式为:MSCI中国A股指数收益率=95%×MSCI中国A股指数收益率+5%×金融同业存款利率。

如果MSCI中国A股指数不再被中证指数有限公司编制和发布,或由其他指数替代,或由于指数编制方法变更导致该指数不宜继续作为目标指数,或者证券市场出现其他更权威、更合适投资的指数推出,本基金管理人有权变更该指数的跟踪目标投资对象,并在变更投资对象后个工作日内在中国证监会指定的媒体上公告。

## 十二、基金的风险收益特征

本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

## 十三、基金的投资组合报告

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法律责任。

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。

## (一)报告期末基金资产组合情况

3	固定收益投资	171,977,544.40	2.87
	其中:债券	171,977,544.40	2.87
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	131,369,612.14	2.19
7	其他各项资产	57,370,644.51	0.96

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	采矿业	-	-
C	制造业	19,259,470.55	0.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	房地产业	-	-
K	金融业	3,166,216.80	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	22,425,687.35	0.37

(上接B46版)

通过宏观经济分析考虑历史上中国的年度及季度GDP增长率水平、CPI增长趋势、国家货币政策倾向、汇率政策的变动倾向,对政策性的变动或宏观经济、经济周期的更迭,对市场现有政策曲线的变动进行预期,据此对利率风险进行评估。

通过对投资组合分析,在维持投资组合风险不受水平的前提下进行调整。包括预期变动,非预期的资产组合风险,信用风险等。

## 十一、业绩比较基准

本基金以上证A股指数作为衡量基金业绩的比较基准。

## 十二、风险收益特征

本基金追求中性的风险收益,通过组合投资于增长型股票,力争实现基金单位资产净值在大盘上涨时跟踪不低于比较基准,其幅度为65%,大盘下跌时基金单位资产净值跌幅不高于比较基准跌幅的60%;在年度内基金单位资产净值的标准差不小于比较基准的65%。

## 十三、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法律责任。

基金托管人交通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2013年3月31日,本报告中所列财务资料未经审计。

## (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	1,587,049,754.17	83.77
	其中:股票	1,587,049,754.17	83.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	122,394,986.16	6.46
	其中:债券	122,394,986.16	6.46
	资产支持证券	-	-

## 2. 报告期末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	采矿业	-	-
C	制造业	885,463,523.85	46.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,212,311.20	3.09
E	建筑业	225,515,764.07	11.96
F	批发和零售业	137,544,035.51	7.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,965.00	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,259,440.00	0.33
L	租赁和商务服务业	29,477,195.54	1.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,559,440.00	0.77
S	综合	2,119.00	0.00
合计	-	1,587,049,754.17	84.18

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
4	农、林、牧、渔业	-	-
5	采矿业	-	-
6	制造业	274,500,026.24	5.03
7	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,000,099.02	0.09
8	其他各项资产	5,454,679,439.65	100.00

## (二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末股票投资组合未持有股票。

## 2. 报告期末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	30,137,015.09	0.56
B	采矿业	451,266,219.69	8.32
C	制造业	1,801,799,467.09	33.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	147,861,010.70	2.72
E	建筑业	101,407,077.23	1.84
F	批发和零售业	126,647,950.52	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	126,672,993.53	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,255,386.81	1.68
J	金融业	1,736,529,405.82	32.00
K	房地产业	274,572,523.57	5.06
L	租赁和商务服务业	28,085,894.22	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,813,222.18	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,913,556.34	0.18
S	综合	63,184,445.90	1.16
合计	-	5,098,901,306.69	93.96

(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

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	600016	民生银行	22,590,435	217,771,793.40	4.01
2	600036	招商银行	14,307,425	181,460,575.75	3.34
3	601318	中国平安	3,261,275	140,400,456.75	2.59
4	601166	兴业银行	7,601,885	131,512,610.50	2.42
5	600000	浦发银行	11,162,318	113,074,241.34	2.08
6	000002	万科A	9,763,860	105,059,133.60	1.94
7	601328	交通银行	19,601,285	92,322,052.35	1.70
8	600030	中信证券	6,868,677	83,591,799.09	1.54
9	600837	海南发展	8,146,144	82,557,515.84	1.52
10	601088	中国神华	3,280,461	71,644,468.38	1.32

2. 报告期末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

本基金本报告期末股票投资组合未持有股票。

(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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,020,000.00	0.92
其中:政策性金融债	50,020,000.00	0.92	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换	2,192,007.70	0.48
8	其他	-	-
9	合计	76,212,007.70	1.40

## 2.2 报告期末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	39,026,003.45	0.65
B	采矿业	386,711,751.49	6.46
C	制造业	2,413,147,731.52	40.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,473,800.81	1.70
E	建筑业	259,496,066.46	4.33
F	批发和零售业	131,832,500.57	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	128,924,060.71	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,114,375.05	2.39
J	金融业	1,426,154,707.10	23.84
K	房地产业	422,423,028.65	7.06
L	租赁和商务服务业	43,152,052.11	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	51,296,690.02	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,160,286.17	0.17
S	综合	59,373,946.21	0.99
合计	-	5,615,989,340.52	93.88

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	600016	民生银行	24,048,990	231,831,478.00	3.88
2	601318	中国平安	4,368,347	182,465,854.19	3.05
3	600036	招商银行	1,049,128	175,155,754.08	2.93
4	601166	兴业银行	1,045,408	175,513,828.40	2.96
5	600000	浦发银行	12,767,104	129,330,763.52	2.16
6	000002	万科A	11,871,090	127,752,498.00	2.14
7	600036	招商银行	9,900,288	125,044,426.44	2.09
8	600030	中信证券	9,020,317	109,777,501.29	1.86
9	600837	海南发展	10,412,748	105,475,082.28	1.76
10	601668	中国国贸	26,267,936	88,522,944.32	1.48

3.2 报告期末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	401992	金融债01	1,455,522	9,982,994.38	0.17
2	400027	金融债02	803,538	3,455,313.40	0.06
3	600742	一汽转债	194,105	3,185,263.05	0.05
4	000061	阳光城	193,062	3,166,216.80	0.05
5	000050	深天马2	192,763	2,253,399.47	0.04

4. 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	120,180,000.00	2.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,035,000.00	0.84
其中:政策性金融债	50,035,000.00	0.84	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换	1,762,544.40	0.03
8	其他	-	-
9	合计	171,977,544.40	2.87

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

(C) 报告期末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	300058	蓝色光标	6,550,000	201,740,000.00	10.70
2	600660	宁德时代	21,840,000	177,122,400.00	9.39
3	002140	东方科技	4,861,052	140,873,286.96	7.47
4	600335	国机汽车	5,694,783	137,544,035.51	7.30
5	300147	普鲁制药	10,011,064	107,226,700.56	5.69