

国泰沪深300指数证券投资基金

[2013] 第一季度报告

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
报告送出日期：二〇一三年四月二十二日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及董事声明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、准确性负责，但法律责任仍由基金管理人承担。
基金托管人中国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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告所载财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国泰沪深300指数
基金主代码 020011
交易代码 020011
基金运作方式 购买型开放式
基金合同生效日 2007年11月11日
报告期末基金份额总额 10,609,840,642.91份

本基金将运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的的投资筛选和数量化风险控制手段，力争给本基金的申赎增长与单只基金净资产增长平均回报误差不超过±0.35%，实现对沪深300指数的有效跟踪。

投资目标 本基金将运用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造指数化投资组合，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基金的基准权重造成影响时，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。

业绩比较基准 90%×沪深300指数收益率+10%×银行同业存款收益率。

风险收益特征 本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)

1.本期已实现收益 -159,195,812.27

2.本期利润 -29,534,710.59

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0026

4.期末基金资产净值 5,426,512,267.45

5.期末基金份额净值 0.5111

注：1.本期已实现收益指基金期初收入、利息收入、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述本期业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列示的。

9.对期末可供分配利润，采用期末资产净值减去未分配利润后即为年末的可供分配利润，年末可供分配利润按比例分配。

风险揭示 本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

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

§ 3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)

1.本期已实现收益 -159,195,812.27

2.本期利润 -29,534,710.59

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0026

4.期末基金资产净值 5,426,512,267.45

5.期末基金份额净值 0.5111

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰沪深300指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图 对比图
2007年1月11日至2013年3月31日

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期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理的基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 离任日期 说明

胡永青 基金经理、国泰沪深300指数证券投资基金基金经理 2011-5-9 - 7 博士。曾任职于平安资产管理公司，2008年5月加盟国泰基金管理有限公司，任数量分析师、助理研究员。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指数基金的基金经理；2011年5月起担任上证180指数基金的基金经理；2011年5月起兼任国泰沪深300指数基金基金经理；2012年3月起兼任中证500指数基金的基金经理；2012年3月起兼任国泰中小板300成长ETF、国泰中小板300成长ETF联接基金、国泰深证成份指数分级基金基金经理；2013年2月起兼任国泰深证成份指数分级基金基金经理。

注：1.此栏的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日起，首任基金经理，任期日期为基金合同生效日。
2.证券业协会《关于规范证券投资基金从业人员资格管理的办法》的相关规定。

4.2 管理人报告报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《基金公司公开交易制度指引》等有关法律法规的规定，认真履行诚实守信、勤勉尽责的义务，最大限度地保护投资人合法权益等原则运作基金。

本基金在报告期内严格遵守基金合同的有关规定，未发生内幕交易、操纵市场和不公平关联交易等禁止行为。

本基金期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《基金公司公开交易制度指引》等有关法律法规的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不公平关联交易等禁止行为。

</