

# 国泰沪深300指数证券投资基金

## 2014年度报告摘要

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：二〇一五年三月三十日

**重要提示**  
基金管理人承诺，本基金管理人承诺不以虚假记载、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  
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2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合情况等，未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本基金管理人承诺不以虚假记载、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  
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2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合情况等，未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本年度报告摘要不代表其完整报告，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。  
本基金的财务报告和经营业绩、基金托管人的报告等，均须经会计师事务所审计，并由会计师事务所出具无保留意见的审计报告，投资者请仔细阅读。  
本报告自2014年1月1日起至12月31日止。

**2.1 基金基本情况**

基金名称	国泰沪深300指数证券投资基金
基金简称	沪深300
基金代码	000181
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	2010年11月11日
基金管理人地址	中国上海市虹口区四川北路1888号
基金管理人法定代表人	王德信

**2.2 基金产品说明**

投资目标	本基金以沪深300指数为标的构建投资组合，追求跟踪偏离度最小化，跟踪标的指数的净值增长率，力争获得基金净值增长率超越标的指数收益。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，即按照标的指数成份股及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+1.5%的银行活期存款利率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险收益特征高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

**2.3 基金管理人及基金托管人**

名称	基金管理人	基金托管人
名称	国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
法定代表人	王德信	姜东
注册地址	中国上海市虹口区四川北路1888号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	中国上海市虹口区四川北路1888号	北京市西城区复兴门内大街1号
电话	021-31089677	010-66060000
网址	http://www.guotai.com.cn	http://www.boc.cn

**2.4 信息披露方式**

基金年度报告披露的互联网网址	http://www.guotai.com.cn
基金年度报告披露的印刷文本地址	上海市虹口区四川北路1888号国泰基金大厦602室

**5 审计报告**  
本报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过查阅于本管理人网站披露的审计报告全文查看审计报告。  
**7.1 资产负债表**  
会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金  
截止日：2014年12月31日  
单位：人民币元

资产	2014年12月31日	2014年12月31日
货币资金	28,047,027.27	26,412,968.18
结算备付金	86,760.79	-
应收利息	48,363.26	56,789.22
买入返售金融资产	4,855,539.25	5,236,203.24
应收申购款	4,794,318.62	5,236,203.24
基金投资	-	-
可供出售金融资产	86,220,000.00	1,524,742.9
持有至到期投资	-	-
长期股权投资	-	-
投资性房地产	-	-
固定资产	1,779,772.72	17,899.63
无形资产	-	-
递延所得税资产	4,099,249.29	681,791.11
其他资产	-	-
资产总计	53,924,957.89	53,924,957.89
负债	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	-	-
应付托管费	-	-
应付销售服务费	-	-
其他负债	-	-
负债总计	-	-
所有者权益(或股东权益)	-	-
实收基金	4,994,927.78	4,994,927.78
未分配利润	48,930,030.11	48,930,030.11
所有者权益(或股东权益)总计	53,934,957.89	53,934,957.89

**7.2 利润表**  
会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金  
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日  
单位：人民币元

项目	2014年12月31日	2014年12月31日
营业收入	1,333,624.94	-176,044.79
利息收入	3,097,295.23	2,609,261.26
公允价值变动收益	1,698,607.37	3,096,318.28
投资收益	1,426,381.39	863,857.87
资产减值损失	-24,653.71	-
公允价值变动损益	24,653.71	-
其他综合收益	-	-
营业利润	6,925,308.53	7,968,262.74
营业外收入	-	-
营业外支出	-	-
利润总额	6,925,308.53	7,968,262.74
所得税费用	-	-
净利润	6,925,308.53	7,968,262.74
其他综合收益	-	-
综合收益总额	6,925,308.53	7,968,262.74

注：本报告截至2014年12月31日，基金份额净值0.7126元，基金份额总额7,150,489,070.02份。  
**7.3 所有者权益(基金净值)变动表**  
会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金  
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日  
单位：人民币元

项目	2014年12月31日	2014年12月31日
一、基金份额总额	7,150,489,070.02	7,150,489,070.02
二、基金份额净值	0.7126	0.7126
三、所有者权益	5,092,625,728.28	2,897,029,274.34
四、所有者权益变动	2,195,593,153.94	2,195,593,153.94

**7.3 所有者权益(基金净值)变动表**  
会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金  
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日  
单位：人民币元

项目	2014年12月31日	2014年12月31日
一、基金份额总额	7,150,489,070.02	7,150,489,070.02
二、基金份额净值	0.7126	0.7126
三、所有者权益	5,092,625,728.28	2,897,029,274.34
四、所有者权益变动	2,195,593,153.94	2,195,593,153.94

**7.3 所有者权益(基金净值)变动表**  
会计主体：国泰沪深300指数证券投资基金  
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日  
单位：人民币元

项目	2014年12月31日	2014年12月31日
一、基金份额总额	7,150,489,070.02	7,150,489,070.02
二、基金份额净值	0.7126	0.7126
三、所有者权益	5,092,625,728.28	2,897,029,274.34
四、所有者权益变动	2,195,593,153.94	2,195,593,153.94

**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。  
**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。  
**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。

**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。  
**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。

**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。  
**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。

**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。  
**7.4 关联方关系**  
关联方关系(序号)从7.1.2关联方财务报表由下列人员签署：  
基金管理人：王德信，王德信为基金管理人董事长。

注：买入金额按买入成交金额(成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。  
8.4.2买入卖出金额超过前基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	买入金额(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	143,720,427.88	3.44
2	600044	长江证券	109,575,174.23	2.61
3	600016	民生银行	99,048,034.54	2.36
4	600026	山东高速	54,485,389.87	1.30
5	600028	中国石化	43,978,649.47	1.06
6	600002	万科A	33,168,247.27	0.80
7	600000	浦发银行	32,364,341.91	0.78
8	600036	招商银行	30,229,219.14	0.74
9	600008	中信银行	29,368,468.89	0.72
10	600015	民生银行	28,368,468.89	0.70
11	600019	浦发银行	25,838,243.31	0.63
12	600021	招商证券	23,059,481.46	0.57
13	600020	中远海运	22,387,263.21	0.55
14	600029	招商银行	20,368,468.89	0.50
15	600006	中信银行	19,223,243.03	0.47
16	600040	老干妈	18,779,694.47	0.46
17	600004	格力电器	18,228,228.24	0.45
18	600008	中信银行	18,228,228.24	0.45
19	600008	中信银行	18,228,228.24	0.45
20	600019	浦发银行	18,228,228.24	0.45

**8.4.3买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.4买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	900,000	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	300,000	30,000,000.00	0.74

**8.4.5买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.6买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.7买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.8买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.9买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.10买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.11买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.12买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.13买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.14买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.15买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.16买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.17买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.18买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.19买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.20买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.21买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.22买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.23买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.24买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.25买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.26买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.27买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.28买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.29买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.30买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.31买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.32买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.33买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.34买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.35买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.36买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.37买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.38买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.39买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.40买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.41买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.42买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

**8.4.43买入股票卖出或赎回基金资产净值(或成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。**  
**8.4.44买入股票的成本占期末基金资产净值的比例**  
单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓市值(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	90,000,000.00	2.20
2	600044	长江证券	30,000,000.00	0.74

注：买入金额按买入成交金额(成交净额除以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。  
8.4.2买入卖出金额超过前基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	买入金额(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600198	中国宝安	143,720,427.88	3.44
2	600044	长江证券	109,575,174.23	2.61
3	600016	民生银行	99,048,034.54	2.36
4	600026	山东高速	54,485,389.87	1.30
5	600028	中国石化	43,978,649.47	1.06
6	600002	万科A	33,168,247.27	0.80
7	600000	浦发银行	32,364,341.91	0.78