

# 国泰沪深300指数证券投资基金 [2013]第四季度报告

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:二〇一四年一月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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、完整性、及时性承担法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年1月20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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，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。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12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:契约型开放式

基金合同生效日:2007年1月11日

报告期末基金份额总额:7,149,380,899.21份

投资目标:本基金将完全以复制为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率与业绩比较基准的偏离度在1%的平均跟踪误差不超过0.35%，实现对沪深300指数的有效跟踪。

投资策略:本基金将完全以复制为为目标的指数化投资方法，按照成份股在沪深300指数中的权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调仓和成份股发生股本、增发、分红等行为时，以及对基金的申购赎回对本基金跟踪误差的影响时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以使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+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10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -105,744,699.02

2.本期利润 -110,666,430.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0153

4.期末基金资产净值 3,487,868,329.84

5.期末基金份额净值 0.4879

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

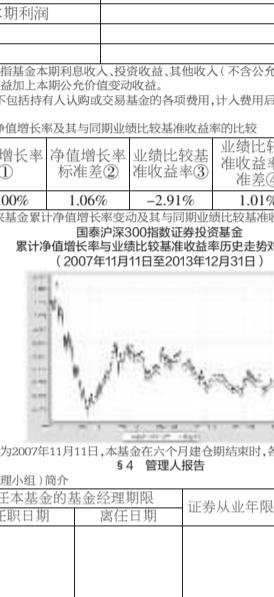
(2)本基金业绩比较基准不包括持有人认购或申购基金的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① -3.00% 1.06% -2.91% 1.01% -0.9% 0.05%

3.2.2 报告期内基金份额净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图



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(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期

说明

本基金管理人

总经理,国泰

180金融

ETF,国

180金融

ETF,国