

# 国泰沪深300指数证券投资基金

[2014] 第三季度报告

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:二〇一四年十月二十七日

\$1 重要提示  
本基金的基金管理人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，并对其中内容的真实性、准确性、完整性和及时性负责。本基金的基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责、最大限度地保护投资人合法权益的原则管理基金资产，但不保证基金一定盈利。  
基金合同由投资人与基金管理人共同签署并规定，自2014年10月23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信息，保留在复核期内不存虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
投资人认购、申购、赎回、转换基金单位时，须承担一定的申购费、赎回费、转换费等费用。  
投资人购买基金后，可随时向基金管理人查询基金的投资情况。

本基金的财务报告于2014年10月1日起至9月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称	国泰沪深300指数
基金代码	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10月11日
报告期末基金份额总额	6,299,209,219.95份
投资目标	本基金将采用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的的投资约束和数量化的风险控制手段，力争在扣除基金的管理费用之后的平均净值增长率超越沪深300指数不超过0.35%，实现对沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要通过构建股票资产组合，使有效投资于上市公司的股票组合能尽可能地反映沪深300指数的收益特征。当期成份股发生调整和变动对本基金管理标的指数的影响时，基金管理人将根据指数编制机构的调整方案，适时进行调整，以使本基金的跟踪误差控制在合理的范围内。
业绩比较基准	95%×沪深300指数+1%×银行定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于高风险的收益特征。
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

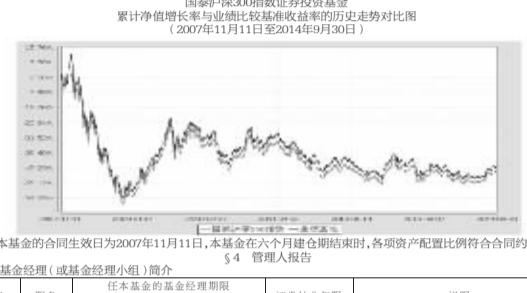
(单位:人民币元)

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-149,014,155.76
2.本期利润	397,394,133.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0529
4.期末基金份额净值	3,243,650,042.91
5.期末基金资产净值	0.0515

注:(1)本期已实现收益指基金收入扣除各项费用后的余额，即报告期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
(2)本期利润不包括持有人认购或申购基金时产生的认购费或申购费，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 本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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图(2007年11月11日至2014年9月30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。

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
李丰	本基金的基金经理、量化投资部总监 经理	2014-05-22	-	16

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日起，首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

5 管理人报告

5.1 报告期末未持有基金资产组合情况

代号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 权益投资	3,010,013,615.00	91.74	
其中:股票	3,010,013,615.00	91.74	
2 固定收益投资	82,248,279.50	2.51	
其中:债券	82,248,279.50	2.51	
货币类投资	-	-	
3 贵金属投资	-	-	
4 金融衍生品投资	-	-	
5 其他投资	-	-	
6 合计	3,280,926,79.26	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代号	行业类别	公允价值(元)	内基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	-	-	-
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 食品、饮料和烟草业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
J 金融业	-	-	-
K 房地产业	-	-	-
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	-	-	-

5.3 主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

5.4 报告期利润

5.5 报告期末基金资产净值

5.6 报告期末基金份额净值

5.7 报告期末可供分配基金份额总额

5.8 报告期末可供分配金额

5.9 报告期末基金收益分配情况

5.10 报告期末基金持有的实物资产情况

5.11 报告期末持有的实物资产情况

5.12 报告期末持有的实物资产情况

5.13 报告期末持有的实物资产情况

5.14 报告期末持有的实物资产情况

5.15 报告期末持有的实物资产情况

5.16 报告期末持有的实物资产情况

5.17 报告期末持有的实物资产情况

5.18 报告期末持有的实物资产情况

5.19 报告期末持有的实物资产情况

5.20 报告期末持有的实物资产情况

5.21 报告期末持有的实物资产情况

5.22 报告期末持有的实物资产情况

5.23 报告期末持有的实物资产情况

5.24 报告期末持有的实物资产情况

5.25 报告期末持有的实物资产情况

5.26 报告期末持有的实物资产情况

5.27 报告期末持有的实物资产情况

5.28 报告期末持有的实物资产情况

5.29 报告期末持有的实物资产情况

5.30 报告期末持有的实物资产情况

5.31 报告期末持有的实物资产情况

5.32 报告期末持有的实物资产情况

5.33 报告期末持有的实物资产情况

5.34 报告期末持有的实物资产情况

5.35 报告期末持有的实物资产情况

5.36 报告期末持有的实物资产情况

5.37 报告期末持有的实物资产情况

5.38 报告期末持有的实物资产情况

5.39 报告期末持有的实物资产情况

5.40 报告期末持有的实物资产情况

5.41 报告期末持有的实物资产情况

5.42 报告期末持有的实物资产情况

5.43 报告期末持有的实物资产情况

5.44 报告期末持有的实物资产情况

5.45 报告期末持有的实物资产情况

5.46 报告期末持有的实物资产情况

5.47 报告期末持有的实物资产情况

5.48 报告期末持有的实物资产情况

5.49 报告期末持有的实物资产情况

5.50 报告期末持有的实物资产情况

5.51 报告期末持有的实物资产情况

5.52 报告期末持有的实物资产情况

5.53 报告期末持有的实物资产情况

5.54 报告期末持有的实物资产情况

5.55 报告期末持有的实物资产情况

5.56 报告期末持有的实物资产情况

5.57 报告期末持有的实物资产情况

5.58 报告期末持有的实物资产情况

5.59 报告期末持有的实物资产情况

5.60 报告期末持有的实物资产情况

5.61 报告期末持有的实物资产情况

5.62 报告期末持有的实物资产情况

5.63 报告期末持有的实物资产情况

5.64 报告期末持有的实物资产情况

5.65 报告期末持有的实物资产情况

5.66 报告期末持有的实物资产情况

5.67 报告期末持有的实物资产情况

5.68 报告期末持有的实物资产情况

5.69 报告期末持有的实物资产情况

5.70 报告期末持有的实物资产情况

5.71 报告期末持有的实物资产情况

5.72 报告期末持有的实物资产情况

5.73 报告期末持有的实物资产情况

5.74 报告期末持有的实物资产情况

5.75 报告期末持有的实物资产情况

5.76 报告期末持有的实物资产情况

5.77 报告期末持有的实物资产情况

5.78 报告期末持有的实物资产情况

5.79 报