

## 国泰沪深300指数证券投资基金

## [2015] 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:二〇一六年一月二十日

§ 1 基金简介

本基金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责任。

基金合同生效后，因基金管理人原因导致基金合同无效，于2016年1月18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。

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基金未来表现，投资须谨慎。投资人应当阅读基金招募说明书。

基金合同中关于费用的约定见招募说明书。

本报告期在2015年10月1日起至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11月11日
报告期末基金份额总额	2,588,093,361.32份
本基金将完全以全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数化风险管理手段，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超过0.3%，即对沪深300指数的有效追踪。	

投资目标

本基金将完全以全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数化风险管理手段，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超过0.3%，即对沪深300指数的有效追踪。

投资策略

本基金将完全以全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数化风险管理手段，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超过0.3%，即对沪深300指数的有效追踪。

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

本基金属于高风险的股票型证券投资基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标

报告期 (2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 36,708,890.29 |2.本期利润 293,314,514.7 |3.加权平均基金份额本期利润 0.1112 |4.期末基金资产净值 1,976,937,136.24 |5.期末基金份额净值 0.7644 |

注:(1)本基金在每次收益分配时将首先扣除基金管理费、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,本期利润为本期利润扣除上述费用后的余额。

(2)所列数据业经审计,不包括持有人认购或交易基金份额的费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 基金净值的涨跌幅度及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年11月11日至2015年12月31日)

注:本基金管理人于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/基金经理小组简介

姓名 职务 任期日期 证券从业年限

王文军 基金经理 2015-04-10 - 14年

艾小军 基金经理 2015-04-10 - 14年

王景 基金经理 2015-04-10 - 14年

王海 基金