

国泰沪深 300 指数证券投资基金
2010 年半年度报告
2010 年 6 月 30 日

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：二〇一〇年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半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 2010 年 8 月 23 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说 明.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	42
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	42

7.9	投资组合报告附注	42
8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	43
9	开放式基金份额变动	44
10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
11	备查文件目录	47
11.1	备查文件目录	47
11.2	存放地点	47
11.3	查阅方式	47

2 基金简介

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	国泰沪深300指数
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	11,384,708,219.81份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用以完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量化风险控制手段，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	本基金为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建指数化投资组合。当预期成份股发生调整 and 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本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，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	$90\% \times \text{沪深300指数收益率} + 10\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。
风险收益特征	本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		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
信息披露负责人	姓名	李峰	唐州徽
	联系电话	021-38561600 转	010-66594855

	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-8688	95566
传真		021-38561800	010-66594942
注册地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		陈勇胜	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中 心	上海市世纪大道 100 号上海环球金 融中心 39 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-61,633,037.96
本期利润	-2,043,192,516.23
加权平均基金份额本期利润	-0.1884
本期加权平均净值利润率	-30.05%
本期基金份额净值增长率	-26.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,030,695,250.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1784
期末基金资产净值	5,923,189,576.50
期末基金份额净值	0.520
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-47.94%
-------------	---------

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）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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-6.98%	1.58%	-6.82%	1.50%	-0.16%	0.08%
过去三个月	-21.92%	1.73%	-21.23%	1.64%	-0.69%	0.09%
过去六个月	-26.86%	1.50%	-25.76%	1.44%	-1.10%	0.06%
过去一年	-18.24%	1.79%	-16.93%	1.71%	-1.31%	0.08%
自基金成立起至今	-47.94%	2.20%	-44.52%	2.18%	-3.42%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰沪深 300 指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007 年 11 月 11 日至 2010 年 6 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 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。经中国证监会证监许可[2009]1163 号文核准，本基金管理人股东中国建银投资有限责任公司、万联证券有限责任公司将其所持有的本基金管理人合计 30% 的股权转让给意大利忠利集团，同时，本基金管理人住所变更为上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。经中华人民共和国商务部批准（商外资资审字[2009]0023 号），本公司变更为中外合资企业。

截至 2010 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金，以及 14 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证

券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 24 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前国内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘翔	本基金的基金经理，国泰纳斯达克 100 指数（QDII）的基金经理	2009-03-12	-	5	硕士研究生。曾就职于中国海员对外技术服务公司深圳分公司、Sprint AAA 公司、美国通用电气公司、深圳中兴通讯股份有限公司，2005 年 8 月至 2007 年 7 月在标准普尔信息服务公司任资深分析师，2007 年 7 月至 2007 年 12 月在招商基金管理有限公司任高级信用分析师。2007 年 12 月加盟国泰基金管理有限公司，任高级策略分析师，2009 年 3 月起任国泰沪深 300 指数的基金经理，2010 年 4 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数（QDII）的基金经理。
章贇	本基金的基金经理助理	2010-03-16	-	4	博士研究生，2006 年 3 月至 2007 年 3 月在天狮集团全球投资中心任数量金融分析师，2007 年

					5 月至 2008 年 4 月在平安资产管理公司任量化投资经理。2008 年 4 月加盟国泰基金管理有限公司，任金融分析师，2010 年 3 月起任国泰沪深 300 指数的基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在截止 2010 年 6 月 30 日的本报告期内，基金单位净值从 0.711 元下跌到 0.520 元，下跌 26.86%；基金份额从 110.33 亿份上升到 113.85 亿份，增长 3.19%；基金净资产 78.41 亿元下降至 59.23 亿元，下降 24.46%。

A 股市场经历 09 年的大幅上涨之后，在 10 年上半年震荡向下，沪深 300 指数在上半年来下跌 28.32%。在此期间，我们相应地维持基金相对较低的股票资产仓位。在交易策略上，我们全面跟踪沪深 300 指数，日内组合指令按照交易时间平均分单交易执行，减少交易冲击成本。报告期内，本基金组合状况跟踪效果如下：

(1) 日跟踪偏差 TD 平均为-0.011%，范围在-0.293%至 0.221%之间；

(2) 截至报告日，年化跟踪误差 TE 从 0.087%稳定降至 0.079%。

跟踪误差 TE 低于基金合同规定的 0.35%。TD 和 TE 变化相对稳定，表明本基金所采用的跟踪交易技术稳定可靠。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金本报告期份额净值增长率为-26.86%，同期业绩比较基准增长率为-25.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场经历了上半年的震荡下跌之后，我们本来预期市场能够企稳向上，但随着 4 月份政府对房地产调控政策的重拳出击，A 股市场再一次被悲观的情绪笼罩，加速下跌。以房地产为首的金融板块领跌市场，并带动医药等高估值股票持续补跌。而 4 月 16 日推出的股指期货，由于机构投资者目前基本无法参与，成为短期投机者交易的工具：每天的成交量超过 30 万手，交易的总值超过 A 股的每日交易量，但持仓量平均只有交易量的 1/10。

我们预期随着投资者对经济刺激政策退出、流动性减弱、银行大量融资的担忧的减弱，以及沪深 300 指数在 2010 上半年下跌 28%之后，2010 年下半年 A 股市场震荡筑底向上的可能性不断增大。

我们愿与投资者共享以下源自中证指数公司的最新数据，以增加投资者对沪深 300 指数的进一步了解。

沪深 300 指数选择成交金额位于前 50%的上市公司中总市值排名前 300 名的股票组成

样本股。因此沪深 300 指数的样本股代表了沪深两市 A 股市场的核心优质资产，成长性强，估值水平低，其在整体经营业绩和估值水平方面对投资者具有很强的吸引力。

沪深 300 指数样本股为各行业龙头企业、竞争力强。沪深 300 指数的成份股大都是各行业的龙头企业，这些公司治理结构良好、经营管理能力突出、核心竞争力强、资产规模大、经营业绩好、产品品牌广为人知，如中国平安、中信证券、中国石油、中国联通、贵州茅台、中国神华、招商银行、长江电力等。它们均是与国计民生密切相关的支柱型产业，并且在资源、市场占有率、国家产业扶持政策等方面享有优势。从长远来看，这些具有增长潜力和竞争优势的蓝筹公司，是国民经济的中流砥柱，并将引领中国经济的发展和证券市场的走势，为投资者的长期投资提供参考。

2010 年中期指数样本调整后，沪深 300 指数总市值占沪深市场比例达到 74%。2009 年年报显示，沪深 300 指数样本股净利润为 9748.81 亿元，占沪深上市公司净利润总额的 89.97%。最近一年沪深 300 指数分红总额为 3011.87 亿元，占沪深 A 股上市公司分红总额的 91%。

沪深 300 指数样本股加权平均每股收益分别为 0.4682 元，比沪深上市公司平均水平高出 13.92%。按照 2010 年 6 月 11 日收盘价计算，沪深 300 指数市盈率为 18.34 倍，较沪深 A 股平均水平低 18.15%。与国际主要成熟市场的估值水平接近，处于 A 股估值的合理区间的底部。我们坚信沪深指数 300 成分股代表了中国最经济中最有价值的核心资产部分，而这些股票的长期增长空间是不言而喻的。基于长期投资、价值投资的理念，投资者可积极利用沪深 300 指数基金这一优良的资产配置工具，把握中国经济长期增长的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人常设的估值委员会按照相关法律法规规定，并依据相关制度及流程，对基金估值相关工作进行评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰沪深 300 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在本托管人复核范围内。）

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	166,253,460.22	403,014,197.27
结算备付金		6,943,933.38	1,823,189.99
存出保证金		749,668.93	1,171,999.70
交易性金融资产	6.4.7.2	5,670,241,666.59	7,582,386,877.76
其中：股票投资		5,473,261,666.59	7,373,678,461.76
基金投资		-	-
债券投资		196,980,000.00	208,708,416.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	15,029,030.71
应收利息	6.4.7.5	461,064.11	3,710,485.53
应收股利		2,663,767.90	-
应收申购款		105,919,437.74	87,892,383.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	17,069.97
资产总计		5,953,232,998.87	8,095,045,234.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	200,800,000.00
应付证券清算款		20,040,456.90	12,809,610.30
应付赎回款		4,439,140.62	31,439,510.85
应付管理人报酬		2,530,272.68	3,172,433.27
应付托管费		506,054.54	634,486.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	702,570.63	1,634,048.02
应交税费		652,003.80	652,003.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,172,923.20	3,036,951.35
负债合计		30,043,422.37	254,179,044.24
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	7,953,884,826.75	7,708,032,102.68
未分配利润	6.4.7.10	-2,030,695,250.25	132,834,087.78
所有者权益合计		5,923,189,576.50	7,840,866,190.46
负债和所有者权益总计		5,953,232,998.87	8,095,045,234.70

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.520 元，基金份额总额 11,384,708,219.81 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日
一、收入		-2,018,897,498.79	2,052,964,150.78
1.利息收入		3,687,199.16	1,116,649.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,011,077.11	1,095,745.37
债券利息收入		2,676,122.05	20,904.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-42,338,597.17	-578,944,767.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-76,784,256.06	-609,469,396.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,593,108.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	37,038,766.89	30,524,628.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,981,559,478.27	2,628,103,295.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,313,377.49	2,688,973.49
减：二、费用		24,295,017.44	16,202,142.32
1. 管理人报酬		16,878,480.60	9,900,231.88
2. 托管费		3,375,696.13	1,980,046.44
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	3,118,304.26	4,093,040.60
5. 利息支出		29,103.58	6,128.55
其中：卖出回购金融资产支出		29,103.58	6,128.55
6. 其他费用	6.4.7.19	893,432.87	222,694.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,043,192,516.23	2,036,762,008.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,043,192,516.23	2,036,762,008.46

6.3 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：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	7,708,032,102.68	132,834,087.78	7,840,866,190.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,043,192,516.23	-2,043,192,516.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	245,852,724.07	-120,336,821.80	125,515,902.27
其中：1. 基金申购款	1,551,890,073.81	-212,167,728.97	1,339,722,344.84
2. 基金赎回款	-1,306,037,349.74	91,830,907.17	-1,214,206,442.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	7,953,884,826.75	-2,030,695,250.25	5,923,189,576.50
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,912,499,527.34	-2,273,966,327.89	2,638,533,199.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利	-	2,036,762,008.46	2,036,762,008.46

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,308,827,121.97	-316,792,063.45	992,035,058.52
其中：1. 基金申购款	4,306,500,884.27	-1,042,623,912.62	3,263,876,971.65
2. 基金赎回款	-2,997,673,762.30	725,831,849.17	-2,271,841,913.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,221,326,649.31	-553,996,382.88	5,667,330,266.43

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据原国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于修改〈国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同〉中国泰金象保本基金相关转型条款的议案》，并经中国证监会证监基金字[2007]第 307 号《关于核准国泰金象保本增值证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原国泰金象保本增值混合证券投资基金在保本期满后转型而来。自 2007 年 11 月 11 日起，《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《国泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》和《关于原国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额拆分比例的公告》，本基金于 2007 年 12 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 1.431547301，并于 2007 年 12 月 19 日进行了份额变更登记。

本基金于合同生效后自 2007 年 11 月 16 日至 2007 年 12 月 14 日止期间进行集中申购，共募集净有效集中申购资金 5,938,412,579.14 元。根据《国泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金集中申购期内募集的净有效集中申购资金连同申购资金产生的利息收入 3,606,042.98 元在本基金集中申购期结束后于 2007 年 12 月 19 日按上述拆分后的基金份额净值 1.000 元折算为基金份额，划入基金份额持有人账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等,股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%,其中备选成份股投资比例不高于 15%,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。本基金的业绩比较基准为: 90% X 沪深 300 指数收益率+10% X 银行同业存款收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2010 年 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2010]5 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代

缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
活期存款	166,253,460.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	166,253,460.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,328,584,325.48	5,473,261,666.59	-1,855,322,658.89
债券	交易所市场	197,445,200.00	196,980,000.00	-465,200.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	197,445,200.00	196,980,000.00	-465,200.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,526,029,525.48	5,670,241,666.59	-1,855,787,858.89

注：于 2010 年 6 月 30 日，股票投资余额中按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票 17,029,669.58 元，采用该估值技术的股票投资于 2010 年半年度利润表中确认的公允价值变动损失为 3,940,253.89 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	40,580.18
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,187.36
应收债券利息	416,043.96
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2,209.05
其他	43.56
合计	461,064.11

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	701,920.63
银行间市场应付交易费用	650.00
合计	702,570.63

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	143,714.10
应付指数使用费	320,936.02
预提费用	208,273.08
合计	1,172,923.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	11,032,921,204.34	7,708,032,102.68
本期申购	2,221,135,418.24	1,551,890,073.81
本期赎回（以“-”号填列）	-1,869,348,402.77	-1,306,037,349.74
本期末	11,384,708,219.81	7,953,884,826.75

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,384,316,772.42	-1,251,482,684.64	132,834,087.78
本期利润	-61,633,037.96	-1,981,559,478.27	-2,043,192,516.23
本期基金份额交易产生的变动数	41,276,210.36	-161,613,032.16	-120,336,821.80
其中：基金申购款	270,489,691.25	-482,657,420.22	-212,167,728.97
基金赎回款	-229,213,480.89	321,044,388.06	91,830,907.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,363,959,944.82	-3,394,655,195.07	-2,030,695,250.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	980,729.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,337.55
其他	11,009.88
合计	1,011,077.11

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	981,075,872.37
减：卖出股票成本总额	1,057,860,128.43
买卖股票差价收入	-76,784,256.06

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	315,864,392.40

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	309,645,108.00
减：应收利息总额	8,812,392.40
债券投资收益	-2,593,108.00

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	37,038,766.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	37,038,766.89

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,981,559,478.27
——股票投资	-1,982,020,970.27
——债券投资	461,492.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,981,559,478.27

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
基金赎回费收入	1,136,281.51
转换费收入	177,095.98
合计	1,313,377.49

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
----	------------------------------

交易所市场交易费用	3,117,654.26
银行间市场交易费用	650.00
合计	3,118,304.26

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,765.71
指数使用费	675,139.14
银行费用	1,020.65
债券账户服务费	9,000.00
合计	893,432.87

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

2010 年 6 月 21 日，本基金管理人发布公告，经中国证监会证监许可[2009]1163 号文核准，本基金管理人股东中国建银投资有限责任公司、万联证券有限责任公司将其所持有的本基金管理人合计 30%的股权转让给意大利忠利集团。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司（“国泰基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国建银投资有限责任公司（“中国建投”）	基金管理人的控股股东
中国国际金融有限公司（“中金公司”）	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6 月30日	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,878,480.60	9,900,231.88
其中：支付销售机构的客户维护费	3,492,629.85	2,075,481.58

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6 月30日	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,375,696.13	1,980,046.44

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010 年 6 月 30 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
中国银行高邮支行	6,710,067.11	0.06%	6,710,067.11	0.06%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	166,253,460.22	980,729.68	382,086,336.44	1,037,902.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中金公司	600036	招商银行	配股	1,822,451	16,128,691.35
中金公司	601328	交通银行	配股	3,537,546	15,918,957.00
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2010年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601318	中国平安	2010-06-29	公布重	46.81	-	-	3,715,301	191,490,951.03	173,913,239.81	-

			大 事 项 停 牌							
000001	深发展A	2010-06-30	公 布 重 大 事 项 停 牌	17.51	-	-	4,237,786	92,259,553.71	74,203,632.86	-
000895	双汇发展	2010-03-22	公 布 重 大 事 项 停 牌	43.54	-	-	391,127	17,614,955.50	17,029,669.58	-
600675	中华企业	2010-05-17	公 布 重 大 事 项 停 牌	7.18	-	-	1,266,959	14,019,054.29	9,096,765.62	-
600816	安信信托	2010-06-02	公 布 重 大 事 项 停	13.60	-	-	426,262	7,373,287.81	5,797,163.20	-

			牌							
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2010 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“与市场的同步增长，获取中国经济增长的长期稳定回报”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由监察稽核部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。监察稽核部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2009 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2010 年 6 月 30 日	6 个月 以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	166,253,460.22	-	-	-	166,253,460.22
结算备付金	6,943,933.38	-	-	-	6,943,933.38
存出保证金	138,549.12	-	-	611,119.81	749,668.93

交易性金融资产	-	196,980,000.00	-	5,473,261,666.59	5,670,241,666.59
应收利息	-	-	-	461,064.11	461,064.11
应收股利	-	-	-	2,663,767.90	2,663,767.90
应收申购款	-	-	-	105,919,437.74	105,919,437.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	173,335,942.72	196,980,000.00	-	5,582,917,056.15	5,953,232,998.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	20,040,456.90	20,040,456.90
应付赎回款	-	-	-	4,439,140.62	4,439,140.62
应付管理人报酬	-	-	-	2,530,272.68	2,530,272.68
应付托管费	-	-	-	506,054.54	506,054.54
应付交易费用	-	-	-	702,570.63	702,570.63
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	1,172,923.20	1,172,923.20
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	30,043,422.37	30,043,422.37
利率敏感度缺口	173,335,942.72	196,980,000.00	-	5,552,873,633.78	5,923,189,576.50
上年度末2009年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	403,014,197.27	-	-	-	403,014,197.27
结算备付金	1,823,189.99	-	-	-	1,823,189.99
存出保证金	138,549.12	-	-	1,033,450.58	1,171,999.70
交易性金融资产	208,708,416.00	-	-	7,373,678,461.76	7,582,386,877.76
应收利息	-	-	-	3,710,485.53	3,710,485.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	87,892,383.77	87,892,383.77
应收证券清算款	-	-	-	15,029,030.71	15,029,030.71
其他资产	-	-	-	17,069.97	17,069.97
资产总计	613,684,352.38	-	-	7,481,360,882.32	8,095,045,234.70
负债					

应付证券清算款	-	-	-	12,809,610.30	12,809,610.30
应付赎回款	-	-	-	31,439,510.85	31,439,510.85
应付管理人报酬	-	-	-	3,172,433.27	3,172,433.27
应付托管费	-	-	-	634,486.65	634,486.65
应付交易费用	-	-	-	1,634,048.02	1,634,048.02
应交税费	-	-	-	652,003.80	652,003.80
其他负债	-	-	-	3,036,951.35	3,036,951.35
卖出回购金融资产款	200,800,000.00	-	-	-	200,800,000.00
负债总计	200,800,000.00	-	-	53,379,044.24	254,179,044.24
利率敏感度缺口	412,884,352.38	-	-	7,427,981,838.08	7,840,866,190.46

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.33% (2009 年 12 月 31 日：2.66%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2009 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整 and 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本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，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。

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进

行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,473,261,666.59	92.40	7,373,678,461.76	94.04
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,473,261,666.59	92.40	7,373,678,461.76	94.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1. 沪深300指数上升5%	增加约27,843万元	增加约36,798万元
	2. 沪深300指数下降5%	减少约27,843万元	减少约36,798万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,473,261,666.59	91.94
	其中：股票	5,473,261,666.59	91.94
2	固定收益投资	196,980,000.00	3.31
	其中：债券	196,980,000.00	3.31
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	173,197,393.60	2.91
6	其他各项资产	109,793,938.68	1.84
7	合计	5,953,232,998.87	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	23,124,239.37	0.39
B	采掘业	586,256,748.41	9.90
C	制造业	1,654,278,884.74	27.93
C0	食品、饮料	241,013,739.16	4.07
C1	纺织、服装、皮毛	30,187,499.53	0.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	13,991,579.50	0.24
C4	石油、化学、塑胶、塑料	127,463,518.34	2.15
C5	电子	23,467,762.71	0.40
C6	金属、非金属	438,982,800.59	7.41
C7	机械、设备、仪表	542,428,688.89	9.16
C8	医药、生物制品	219,194,937.78	3.70
C99	其他制造业	17,548,358.24	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	197,092,550.72	3.33
E	建筑业	160,462,255.36	2.71
F	交通运输、仓储业	264,435,981.20	4.46
G	信息技术业	203,557,771.96	3.44
H	批发和零售贸易	190,716,923.30	3.22
I	金融、保险业	1,695,879,643.33	28.63
J	房地产业	318,633,104.21	5.38
K	社会服务业	53,085,476.51	0.90
L	传播与文化产业	18,734,852.24	0.32
M	综合类	107,003,235.24	1.81
	合计	5,473,261,666.59	92.40

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
1	600036	招商银行	16,425,602	213,697,082.02	3.61
2	601318	中国平安	3,715,301	173,913,239.81	2.94
3	601328	交通银行	27,289,088	164,007,418.88	2.77
4	600016	民生银行	24,679,429	149,310,545.45	2.52
5	601166	兴业银行	5,563,190	128,120,265.70	2.16
6	600000	浦发银行	9,067,794	123,321,998.40	2.08
7	600030	中信证券	9,157,677	107,144,820.90	1.81
8	601088	中国神华	4,319,989	94,910,158.33	1.60
9	601601	中国太保	4,072,226	92,724,586.02	1.57
10	000002	万 科 A	13,086,398	88,725,778.44	1.50
11	601398	工商银行	18,692,937	75,893,324.22	1.28
12	000001	深发展 A	4,237,786	74,203,632.86	1.25
13	601169	北京银行	5,879,486	71,318,165.18	1.20
14	600900	长江电力	5,677,729	70,914,835.21	1.20
15	600519	贵州茅台	495,122	63,058,737.92	1.06
16	002024	苏宁电器	5,445,131	62,074,493.40	1.05
17	000858	五 粮 液	2,519,953	61,058,461.19	1.03
18	600050	中国联通	11,240,508	59,911,907.64	1.01
19	601939	建设银行	11,861,650	55,749,755.00	0.94
20	601857	中国石油	4,919,431	50,424,167.75	0.85
21	601628	中国人寿	1,955,663	48,304,876.10	0.82
22	600837	海通证券	5,253,721	47,598,712.26	0.80
23	600015	华夏银行	3,926,390	43,661,456.80	0.74
24	000063	中兴通讯	2,215,928	42,634,454.72	0.72
25	601899	紫金矿业	6,976,431	42,346,936.17	0.71
26	600028	中国石化	5,412,527	42,325,961.14	0.71
27	601006	大秦铁路	5,105,650	41,713,160.50	0.70
28	600019	宝钢股份	6,860,363	40,407,538.07	0.68
29	000983	西山煤电	2,040,500	37,055,480.00	0.63
30	600547	山东黄金	926,912	33,739,596.80	0.57
31	000651	格力电器	1,713,377	32,211,487.60	0.54
32	600048	保利地产	3,065,156	31,356,545.88	0.53
33	600383	金地集团	5,021,175	30,428,320.50	0.51
34	600739	辽宁成大	1,207,269	30,374,888.04	0.51

35	601186	中国铁建	4,010,016	28,872,115.20	0.49
36	000527	美的电器	2,449,988	27,929,863.20	0.47
37	002202	金风科技	1,776,025	27,617,188.75	0.47
38	601668	中国建筑	7,844,599	27,534,542.49	0.46
39	600089	特变电工	1,871,392	27,434,606.72	0.46
40	601390	中国中铁	6,586,431	27,333,688.65	0.46
41	600104	上海汽车	2,221,405	27,256,639.35	0.46
42	600489	中金黄金	513,212	26,512,531.92	0.45
43	601919	中国远洋	3,005,730	26,240,022.90	0.44
44	600111	包钢稀土	734,267	26,073,821.17	0.44
45	000338	潍柴动力	423,764	26,061,486.00	0.44
46	000568	泸州老窖	905,839	25,562,776.58	0.43
47	601766	中国南车	5,224,527	25,182,220.14	0.43
48	000423	东阿阿胶	681,955	23,704,755.80	0.40
49	000792	盐湖钾肥	605,663	23,620,857.00	0.40
50	600011	华能国际	3,728,310	23,600,202.30	0.40
51	000069	华侨城 A	2,111,145	23,222,595.00	0.39
52	600795	国电电力	7,012,794	22,931,836.38	0.39
53	601600	中国铝业	2,496,439	22,892,345.63	0.39
54	600256	广汇股份	820,334	22,854,505.24	0.39
55	600031	三一重工	1,235,777	22,577,645.79	0.38
56	600585	海螺水泥	1,383,372	22,286,122.92	0.38
57	600100	同方股份	1,038,986	21,860,265.44	0.37
58	600068	葛洲坝	2,078,810	21,681,988.30	0.37
59	601009	南京银行	2,154,709	21,633,278.36	0.37
60	000402	金 融 街	2,597,154	21,608,321.28	0.36
61	600018	上港集团	5,525,416	21,051,834.96	0.36
62	601168	西部矿业	2,150,303	21,051,466.37	0.36
63	601111	中国国航	2,041,988	20,991,636.64	0.35
64	000157	中联重科	1,278,638	20,777,867.50	0.35
65	000623	吉林敖东	767,283	20,379,036.48	0.34
66	601898	中煤能源	2,421,892	20,319,673.88	0.34
67	600690	青岛海尔	1,060,022	20,246,420.20	0.34
68	600348	国阳新能	1,545,359	20,120,574.18	0.34
69	000709	河北钢铁	5,406,777	20,059,142.67	0.34
70	600518	康美药业	1,600,712	19,656,743.36	0.33
71	000783	长江证券	1,773,315	19,151,802.00	0.32
72	000538	云南白药	293,580	18,935,910.00	0.32
73	600875	东方电气	430,212	18,735,732.60	0.32
74	000825	太钢不锈	3,683,367	18,711,504.36	0.32
75	601699	潞安环能	597,514	18,690,237.92	0.32

76	000060	中金岭南	1,439,670	18,629,329.80	0.31
77	600655	豫园商城	832,326	18,411,051.12	0.31
78	600664	哈药股份	992,174	18,345,297.26	0.31
79	600276	恒瑞医药	469,367	18,338,168.69	0.31
80	002142	宁波银行	1,621,394	17,867,761.88	0.30
81	002007	华兰生物	392,757	17,705,485.56	0.30
82	600005	武钢股份	4,065,255	17,439,943.95	0.29
83	000898	鞍钢股份	2,400,995	17,239,144.10	0.29
84	600415	小商品城	880,634	17,225,201.04	0.29
85	601998	中信银行	3,179,042	17,166,826.80	0.29
86	600694	大商股份	402,844	17,044,329.64	0.29
87	000895	双汇发展	391,127	17,029,669.58	0.29
88	000800	一汽轿车	1,118,277	16,997,810.40	0.29
89	600832	东方明珠	2,081,194	16,795,235.58	0.28
90	601618	中国中冶	4,151,406	16,647,138.06	0.28
91	600309	烟台万华	1,107,570	16,159,446.30	0.27
92	600177	雅戈尔	1,565,690	16,126,607.00	0.27
93	000768	西飞国际	1,645,154	16,122,509.20	0.27
94	601958	金钼股份	1,323,953	16,112,508.01	0.27
95	600600	青岛啤酒	486,992	16,080,475.84	0.27
96	600196	复星医药	905,492	15,846,110.00	0.27
97	600166	福田汽车	906,735	15,586,774.65	0.26
98	600881	亚泰集团	2,534,963	15,513,973.56	0.26
99	601666	平煤股份	1,185,943	15,500,275.01	0.26
100	600362	江西铜业	642,629	15,461,653.74	0.26
101	600642	申能股份	2,003,188	15,424,547.60	0.26
102	600009	上海机场	1,293,099	15,374,947.11	0.26
103	600320	振华重工	2,512,387	15,350,684.57	0.26
104	600550	天威保变	805,430	15,190,409.80	0.26
105	000933	神火股份	905,044	15,123,285.24	0.26
106	000878	云南铜业	833,987	14,928,367.30	0.25
107	000039	中集集团	1,221,064	14,530,661.60	0.25
108	000024	招商地产	961,075	14,300,796.00	0.24
109	600132	重庆啤酒	396,532	14,275,152.00	0.24
110	000425	徐工机械	464,061	14,214,188.43	0.24
111	600649	城投控股	1,631,040	13,978,012.80	0.24
112	000401	冀东水泥	928,412	13,842,622.92	0.23
113	000839	中信国安	1,240,380	13,668,987.60	0.23
114	600029	南方航空	2,167,478	13,611,761.84	0.23
115	000729	燕京啤酒	686,873	13,600,085.40	0.23
116	601333	广深铁路	3,815,487	13,468,669.11	0.23

117	600188	兖州煤业	818,992	13,447,848.64	0.23
118	000630	铜陵有色	906,064	13,146,988.64	0.22
119	600497	驰宏锌锗	824,383	13,025,251.40	0.22
120	601001	大同煤业	464,930	13,008,741.40	0.22
121	000999	华润三九	558,525	12,818,148.75	0.22
122	600660	福耀玻璃	1,427,638	12,705,978.20	0.21
123	000728	国元证券	1,044,512	12,690,820.80	0.21
124	000100	TCL 集团	3,361,854	12,606,952.50	0.21
125	600125	铁龙物流	930,081	12,565,394.31	0.21
126	000009	中国宝安	1,440,833	12,391,163.80	0.21
127	600123	兰花科创	476,688	12,188,912.16	0.21
128	600352	浙江龙盛	1,335,858	12,156,307.80	0.21
129	600631	百联股份	908,829	11,951,101.35	0.20
130	600062	双鹤药业	459,246	11,922,026.16	0.20
131	000061	农产品	746,778	11,858,834.64	0.20
132	600037	歌华有线	856,602	11,855,371.68	0.20
133	000937	冀中能源	516,397	11,489,833.25	0.19
134	600153	建发股份	1,013,068	11,478,060.44	0.19
135	600601	方正科技	2,398,345	11,440,105.65	0.19
136	000528	柳 工	614,050	11,316,941.50	0.19
137	601866	中海集运	3,274,361	11,034,596.57	0.19
138	600583	海油工程	2,218,878	11,005,634.88	0.19
139	600741	华域汽车	1,357,168	10,938,774.08	0.18
140	600839	四川长虹	2,943,309	10,860,810.21	0.18
141	600219	南山铝业	1,396,808	10,839,230.08	0.18
142	600598	北大荒	950,751	10,829,053.89	0.18
143	600997	开滦股份	819,576	10,687,271.04	0.18
144	600010	宝钢股份	3,558,377	10,639,547.23	0.18
145	600859	王府井	307,963	10,470,742.00	0.18
146	600811	东方集团	1,817,511	10,377,987.81	0.18
147	600688	S 上石化	1,350,479	10,317,659.56	0.17
148	600635	大众公用	1,557,413	10,310,074.06	0.17
149	600208	新湖中宝	2,155,431	10,281,405.87	0.17
150	600808	马钢股份	3,231,296	10,243,208.32	0.17
151	600812	华北制药	1,068,752	10,078,331.36	0.17
152	600150	中国船舶	180,831	10,019,845.71	0.17
153	000778	新兴铸管	1,589,619	9,919,222.56	0.17
154	600588	用友软件	453,019	9,893,934.96	0.17
155	000012	南 玻 A	1,063,005	9,726,495.75	0.16
156	600432	吉恩镍业	526,317	9,684,232.80	0.16
157	000021	长城开发	909,370	9,630,228.30	0.16

158	000652	泰达股份	1,353,129	9,607,215.90	0.16
159	600216	浙江医药	371,650	9,543,972.00	0.16
160	600269	赣粤高速	1,658,998	9,439,698.62	0.16
161	000969	安泰科技	642,130	9,426,468.40	0.16
162	600663	陆家嘴	560,993	9,424,682.40	0.16
163	600717	天津港	1,129,613	9,375,787.90	0.16
164	600271	航天信息	629,349	9,364,713.12	0.16
165	601808	中海油服	837,468	9,262,396.08	0.16
166	002028	思源电气	363,794	9,240,367.60	0.16
167	000680	山推股份	833,004	9,138,053.88	0.15
168	600895	张江高科	1,056,317	9,137,142.05	0.15
169	600675	中华企业	1,266,959	9,096,765.62	0.15
170	600325	华发股份	888,262	9,086,920.26	0.15
171	000422	湖北宜化	710,883	9,056,649.42	0.15
172	600595	中孚实业	804,199	8,958,776.86	0.15
173	600500	中化国际	988,150	8,814,298.00	0.15
174	600220	江苏阳光	1,732,575	8,749,503.75	0.15
175	600879	航天电子	867,673	8,676,730.00	0.15
176	600517	置信电气	500,955	8,671,531.05	0.15
177	000031	中粮地产	1,257,709	8,653,037.92	0.15
178	600331	宏达股份	822,848	8,500,019.84	0.14
179	600108	亚盛集团	1,948,095	8,493,694.20	0.14
180	600779	水井坊	460,086	8,474,784.12	0.14
181	000690	宝新能源	1,675,966	8,446,868.64	0.14
182	000960	锡业股份	556,567	8,354,070.67	0.14
183	000686	东北证券	357,766	8,296,593.54	0.14
184	600643	爱建股份	1,102,629	8,280,743.79	0.14
185	600395	盘江股份	459,239	8,266,302.00	0.14
186	600058	五矿发展	585,581	8,239,124.67	0.14
187	000625	长安汽车	945,956	8,220,357.64	0.14
188	000559	万向钱潮	793,036	8,215,852.96	0.14
189	600528	中铁二局	1,009,461	8,176,634.10	0.14
190	600210	紫江企业	1,558,904	8,121,889.84	0.14
191	600085	同仁堂	354,123	8,020,885.95	0.14
192	000488	晨鸣纸业	1,240,261	8,012,086.06	0.14
193	000027	深圳能源	839,867	7,995,533.84	0.13
194	600316	洪都航空	240,449	7,954,052.92	0.13
195	601588	北辰实业	2,160,089	7,927,526.63	0.13
196	600312	平高电气	768,925	7,819,967.25	0.13
197	002155	辰州矿业	449,646	7,738,407.66	0.13
198	000667	名流置业	2,417,465	7,615,014.75	0.13

199	600221	海南航空	1,446,466	7,608,411.16	0.13
200	601872	招商轮船	1,873,159	7,605,025.54	0.13
201	600118	中国卫星	481,651	7,537,838.15	0.13
202	000897	津滨发展	1,862,775	7,488,355.50	0.13
203	600161	天坛生物	319,976	7,474,639.36	0.13
204	600970	中材国际	408,329	7,349,922.00	0.12
205	600066	宇通客车	489,264	7,294,926.24	0.12
206	600033	福建高速	1,867,703	7,265,364.67	0.12
207	600026	中海发展	877,790	7,197,878.00	0.12
208	600718	东软集团	392,619	7,090,699.14	0.12
209	002001	新 和 成	274,582	7,043,028.30	0.12
210	600809	山西汾酒	169,221	6,943,137.63	0.12
211	000917	电广传媒	442,126	6,879,480.56	0.12
212	600143	金发科技	915,398	6,874,638.98	0.12
213	600549	厦门钨业	371,231	6,756,404.20	0.11
214	600508	上海能源	399,788	6,744,423.56	0.11
215	600418	江淮汽车	1,021,632	6,742,771.20	0.11
216	600158	中体产业	843,067	6,710,813.32	0.11
217	600008	首创股份	1,225,969	6,706,050.43	0.11
218	000807	云铝股份	855,935	6,701,971.05	0.11
219	000059	辽通化工	857,351	6,627,323.23	0.11
220	600582	天地科技	366,138	6,612,452.28	0.11
221	600804	鹏博士	739,303	6,594,582.76	0.11
222	000612	焦作万方	388,560	6,570,549.60	0.11
223	600428	中远航运	913,396	6,558,183.28	0.11
224	600596	新安股份	662,520	6,545,697.60	0.11
225	600096	云天化	407,711	6,527,453.11	0.11
226	000900	现代投资	386,648	6,480,220.48	0.11
227	601991	大唐发电	933,575	6,432,331.75	0.11
228	600087	长航油运	1,318,973	6,357,449.86	0.11
229	600369	西南证券	519,001	6,326,622.19	0.11
230	600183	生益科技	793,961	6,319,929.56	0.11
231	600737	中粮屯河	673,038	6,319,826.82	0.11
232	000758	中色股份	532,451	6,314,868.86	0.11
233	600022	济南钢铁	1,728,713	6,223,366.80	0.11
234	002128	露天煤业	354,414	6,035,670.42	0.10
235	000718	苏宁环球	692,071	5,979,493.44	0.10
236	600611	大众交通	818,738	5,960,412.64	0.10
237	600820	隧道股份	702,510	5,887,033.80	0.10
238	600266	北京城建	520,722	5,858,122.50	0.10
239	600674	川投能源	487,686	5,852,232.00	0.10

240	600816	安信信托	426,262	5,797,163.20	0.10
241	000717	韶钢松山	1,617,820	5,775,617.40	0.10
242	000932	华菱钢铁	1,511,308	5,697,631.16	0.10
243	600886	国投电力	801,101	5,655,773.06	0.10
244	000793	华闻传媒	1,098,296	5,645,241.44	0.10
245	600027	华电国际	1,487,207	5,636,514.53	0.10
246	600004	白云机场	634,126	5,599,332.58	0.09
247	600169	太原重工	508,226	5,595,568.26	0.09
248	600426	华鲁恒升	470,630	5,529,902.50	0.09
249	600109	国金证券	416,061	5,521,129.47	0.09
250	600516	方大炭素	854,825	5,513,621.25	0.09
251	600456	宝钛股份	286,796	5,503,615.24	0.09
252	600239	云南城投	340,568	5,442,276.64	0.09
253	601727	上海电气	794,010	5,415,148.20	0.09
254	600638	新黄浦	610,666	5,398,287.44	0.09
255	600380	健康元	738,924	5,357,199.00	0.09
256	000301	东方市场	1,139,783	5,311,388.78	0.09
257	000959	首钢股份	1,674,480	5,224,377.60	0.09
258	601918	国投新集	511,986	5,206,897.62	0.09
259	600835	上海机电	546,935	5,108,372.90	0.09
260	000046	泛海建设	628,619	5,035,238.19	0.09
261	000927	一汽夏利	650,516	5,028,488.68	0.08
262	600236	桂冠电力	1,164,029	5,016,964.99	0.08
263	600006	东风汽车	1,116,789	4,969,711.05	0.08
264	000089	深圳机场	928,756	4,885,256.56	0.08
265	600569	安阳钢铁	1,363,138	4,811,877.14	0.08
266	600170	上海建工	480,140	4,806,201.40	0.08
267	600176	中国玻纤	298,340	4,797,307.20	0.08
268	000968	煤气化	335,917	4,568,471.20	0.08
269	000780	平庄能源	542,230	4,554,732.00	0.08
270	002244	滨江集团	546,254	4,457,432.64	0.08
271	600307	酒钢宏兴	550,447	4,420,089.41	0.07
272	002122	天马股份	486,312	4,405,986.72	0.07
273	000876	新希望	514,114	4,380,251.28	0.07
274	600748	上实发展	584,803	4,327,542.20	0.07
275	600246	万通地产	831,116	4,321,803.20	0.07
276	600597	光明乳业	574,780	4,230,380.80	0.07
277	601099	太平洋	383,213	4,177,021.70	0.07
278	000951	中国重汽	243,895	4,170,604.50	0.07
279	600376	首开股份	316,516	4,152,689.92	0.07
280	600350	山东高速	908,109	4,140,977.04	0.07

281	600657	信达地产	615,996	3,930,054.48	0.07
282	000685	中山公用	255,146	3,929,248.40	0.07
283	600685	广船国际	223,307	3,894,474.08	0.07
284	600251	冠农股份	250,758	3,801,491.28	0.06
285	601107	四川成渝	575,333	3,710,897.85	0.06
286	600151	航天机电	415,068	3,710,707.92	0.06
287	000822	山东海化	719,850	3,707,227.50	0.06
288	002242	九阳股份	300,569	3,453,537.81	0.06
289	600282	南钢股份	946,276	3,264,652.20	0.06
290	600017	日照港	600,459	3,206,451.06	0.05
291	600102	莱钢股份	372,939	3,095,393.70	0.05
292	600270	外运发展	461,791	3,093,999.70	0.05
293	600639	浦东金桥	316,941	2,966,567.76	0.05
294	600782	新钢股份	534,325	2,703,684.50	0.05
295	000631	顺发恒业	427,071	2,617,945.23	0.04
296	600874	创业环保	415,728	2,415,379.68	0.04
297	002275	桂林三金	48,227	1,068,228.05	0.02
298	600648	外高桥	95,977	1,065,344.70	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	45,600,382.36	0.58
2	601899	紫金矿业	40,521,448.52	0.52
3	601668	中国建筑	38,510,629.00	0.49
4	601328	交通银行	35,970,998.44	0.46
5	601166	兴业银行	29,532,084.25	0.38
6	601618	中国中冶	23,600,268.06	0.30
7	600166	福田汽车	20,006,347.78	0.26
8	601318	中国平安	18,479,585.61	0.24
9	600015	华夏银行	18,216,415.56	0.23
10	600016	民生银行	18,138,292.65	0.23
11	002007	华兰生物	15,881,798.75	0.20
12	600000	浦发银行	15,576,605.18	0.20

13	000001	深发展 A	14,875,119.06	0.19
14	000002	万 科 A	14,393,619.67	0.18
15	600030	中信证券	13,674,504.68	0.17
16	000063	中兴通讯	13,409,299.31	0.17
17	600062	双鹤药业	12,518,335.86	0.16
18	600048	保利地产	12,148,994.41	0.15
19	601088	中国神华	12,048,451.13	0.15
20	600312	平高电气	11,278,700.10	0.14

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	35,572,449.97	0.45
2	601328	交通银行	25,132,653.89	0.32
3	600016	民生银行	24,020,035.71	0.31
4	601318	中国平安	22,921,798.95	0.29
5	600030	中信证券	21,545,796.60	0.27
6	000002	万 科 A	21,056,371.24	0.27
7	601166	兴业银行	19,965,738.56	0.25
8	600000	浦发银行	18,863,799.92	0.24
9	601088	中国神华	17,703,286.62	0.23
10	000001	深发展 A	16,472,322.57	0.21
11	601601	中国太保	13,837,303.92	0.18
12	601398	工商银行	13,340,969.30	0.17
13	601169	北京银行	13,126,524.17	0.17
14	600837	海通证券	12,614,001.68	0.16
15	000629	*ST 钒钛	12,281,494.56	0.16
16	600519	贵州茅台	10,593,923.20	0.14
17	600050	中国联通	10,369,692.43	0.13
18	600900	长江电力	10,213,706.93	0.13
19	000858	五 粮 液	9,913,386.15	0.13
20	601857	中国石油	9,650,691.93	0.12

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,139,464,303.53
卖出股票的收入（成交）总额	981,075,872.37

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	196,980,000.00	3.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	196,980,000.00	3.33

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	020031	10 贴债 05	2,000,000	196,980,000.00	3.33

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	749,668.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,663,767.90
4	应收利息	461,064.11
5	应收申购款	105,919,437.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,793,938.68

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资 产净值比 例(%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	173,913,239.81	2.94	公布重大事项停牌

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额 比例
294,096	38,710.86	2,250,973,068.70	19.77%	9,133,735,151.11	80.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本 开放式基金	3,884,346.10	0.03%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 11 月 11 日）基金份额总额	347,989,794.67
本报告期期初基金份额总额	11,032,921,204.34
本报告期基金总申购份额	2,221,135,418.24
减：本报告期基金总赎回份额	1,869,348,402.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	11,384,708,219.81

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2010 年 4 月 30 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》，经本基金管理人第四届董事会第 23 次会议审议通过，同意聘任梁之平先生担任公司副总经理。梁之平先生的副总经理任职资格已获中国证监会核准（证监许可[2010]472 号文）。

报告期内，基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内，基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券股份有限公司	1	1,154,184,002.58	55.76%	981,053.58	56.42%	-
瑞银证券股份有限公司	1	489,304,078.12	23.64%	397,563.53	22.86%	-
申银万国证券股份有限公司	1	366,354,593.33	17.70%	311,401.54	17.91%	-
中国银河证券股份有限公司	1	60,219,740.55	2.91%	48,928.94	2.81%	-
万联证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券股份有限公司	100,010,000.00	100.00%	623,300,000.00	100.00%	-	-
瑞银证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	刊登了《国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法及影响的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2010年4月22日起按指数收益法对本基金持有的双汇发展股票进行估值。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2010-04-24
2	刊登了《国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法及影响的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2010年4月26日起按指数收益法对本基金持有的中信证券股票进行估值。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2010-04-28
3	刊登了《国泰基金管理有限公司恢复旗下基金持有的中信证券股票市价估值方法的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2010年5月5日起对本基金所持有的中信证券股票恢复按市价估值法进行估值。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2010-05-07
4	刊登了《国泰基金管理有限公司调整长期停	《中国证券报》、	2010-05-19

	盘股票估值方法及影响的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2010年5月17日起按指数收益法对本基金持有的冀东水泥股票进行估值。	《上海证券报》、 《证券时报》	
5	刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司股权及住所变更的公告》，根据中国证监会证监许可[2009]1163号文批准，本基金管理人股东中国建银投资有限责任公司、万联证券有限责任公司将其所持有的本基金管理人合计30%的股权转让给意大利忠利集团。同时，本基金管理人的住所变更为上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼。经商务部批准，本基金管理人变更为中外合资企业。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2010-06-21
6	刊登了《国泰基金管理有限公司恢复旗下基金持有的冀东水泥股票市价估值方法的公告》，本基金管理人与托管银行协商一致，自2010年6月22日起对本基金所持有的冀东水泥股票恢复按市价估值法进行估值。	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2010-06-24

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于核准国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复
- 2、国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议
- 4、国泰沪深 300 指数证券投资基金半年度报告、年度报告
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

11.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人，部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 38569000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址: <http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司
二〇一〇年八月二十五日