

国泰沪深300指数证券投资基金 2008年年度报告摘要

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 送出日期: 二〇〇九年三月三十一日

2008年12月31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 送出日期: 二〇〇九年三月三十一日

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2008年9月16日下调46,020,019.74元...

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金总份额, 基金合同生效日

2.1 基金基本情况 本基金经中国证监会核准注册, 基金合同于2007年11月11日生效...

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金注册登记机构, 基金审计机构

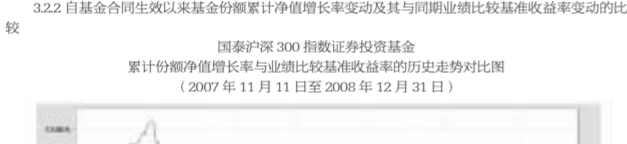
2.4 信息披露方式 本基金年度报告全文披露于中国证监会指定信息披露网站...

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 2 columns: 序号, 指标名称, 2008年, 2007年11月11日至2008年12月31日, 2007年11月11日至2008年12月31日

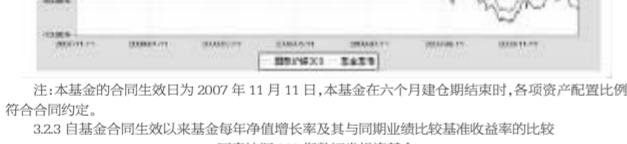
注: 1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额...

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



注: 本基金的合同生效日为2007年11月11日, 本基金在六月建仓期结束时, 各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注: 2007年计算期间为基金合同生效日2007年11月11日至2007年12月31日。

3.3 基金合同生效以来基金的投资组合报告 本基金成立至今尚未进行利润分配。

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

4.1.2 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...

截至2008年12月31日, 本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金: 基金金泰、基金金鑫、基金金泰、以及9只开放式证券投资基金...

2007年11月19日, 本基金管理人获得企业年金基金管理人资格。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...

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金基金经理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 聘任日期, 说明

注: 1. 上述存在任职日期和聘任日期均指公司作出决定公告披露之日。

4.2 基金管理人及其管理基金的经验 4.2.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.2.2 基金管理人及其管理基金的经验 4.2.3 异常交易行为的专项说明

4.3 基金管理人及其管理基金的经验 4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 这场国际金融危机对中国既是挑战也是机遇...

对此我们持谨慎乐观的态度。此外, 我们坚信沪深300成分股代表了中国经济中部分核心资产, 这些资产的长期价值是不言而喻的...

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明 报告期内, 本基金管理人按照相关法律法规规定, 成立了估值委员会...

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明 根据法律法规和基金合同的约定, 无应分配但尚未实施的利润。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信守情况 报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在国泰沪深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》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定...

5.2 托管人对报告期内基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等有关事项的说明 本报告期内, 本托管人根据《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定, 对本基金管理人投资运作进行了必要的监督...

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 本报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注: 财务会计报告中的“金融工具公允价值披露”部分未在托管人复核范围内), 投资组合报告等数据真实、准确和完整。

5.4 会计师事务所对基金管理人2008年12月31日资产负债表、利润表、所有者权益变动表、现金流量表、净资产变动表、公允价值变动表、以及财务报表附注的审计意见

7.1 资产负债表 7.1.1 资产负债表 2008年12月31日 2007年12月31日

Table with 2 columns: 资产, 2008年12月31日, 2007年12月31日

Table with 2 columns: 负债, 2008年12月31日, 2007年12月31日

Table with 2 columns: 所有者权益, 2008年12月31日, 2007年12月31日

注: 报告截止日2008年12月31日, 基金份额净值0.375元, 基金份额总额7,032,039,561.45份。

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: 2008年1月1日至2008年12月31日

Table with 2 columns: 项目, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日

三、所有者权益(或股东权益)变动表 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

Table with 2 columns: 项目, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日

四、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

五、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

六、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

七、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

八、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

九、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

十、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

十一、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

十二、当期损益扣除公允价值变动产生的基金净值变动(扣除公允价值变动) 会计主体: 国泰沪深300指数证券投资基金 本报告期: 2008年1月1日至2008年12月31日

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易 本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行(2007年度: 同)。

7.4.3.2 基金管理费 单位: 人民币元

Table with 2 columns: 项目, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日

注: 支付基金管理人国泰基金的托管费按照前一日基金资产净值的约定年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。

7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况 7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with 2 columns: 关联方名称, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日

7.4.3.4 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 除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及2007年12月31日未持有本基金。

7.4.3.5 由关联方承销的基金情况 单位: 人民币元

Table with 2 columns: 关联方名称, 2008年1月1日至2008年12月31日, 2007年1月1日至2007年12月31日

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管, 按银行同业利率计息。

7.4.3.6 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本报告期内, 本基金在承销期内未参与关联方承销证券(2007年度: 同)。

7.4.3.7 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.3.7.2 期末持有的流通受限证券 7.4.3.7.3 期末持有的流通受限证券

7.4.3.8 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.8.1 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

Table with 2 columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末公允价值, 期末公允价值占基金资产净值比例

注: 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.8.2 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.1 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.2 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.3 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.4 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.5 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.6 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.7 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.8 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.9 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.10 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.11 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.12 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.13 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.14 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.15 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.16 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.17 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.3.9.18 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 7.4.3.9.19 基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

8.2.3 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细 金额单位: 人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于本管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

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。

8.4.2 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

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。

8.4.3 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

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)

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。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细 本基金本报告期末持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注 8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 其他资产构成 单位: 人民币元

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

8.9.4 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。

8.9.5 期末持有的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。

8.9.6 期末持有的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。

8.9.7 期末持有的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。

8.9.8 期末持有的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。

8.9.9 期末持有的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。

8.9.10 期末持有的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。