

国泰沪深300 指数证券投资基金 2008年半年度报告摘要

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

重要提示

基金管理人承诺遵守法律法规... 基金托管人承诺遵守法律法规...

一、基金简介

1. 基金名称: 国泰沪深300 2. 基金代码: 020011 3. 基金管理人: 国泰基金管理有限公司

二、基金业绩

1. 基金业绩比较基准: 90% x 沪深300 指数收益率 + 10% x 银行同业存款利率 2. 基金业绩表现: 截至2008年6月30日, 本基金资产净值为2,730,400,000.00元

三、基金管理人

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

四、基金投资策略

本基金以完全复制法跟踪标的指数的变化... 采用被动式投资策略...

五、基金投资组合

截至2008年6月30日, 本基金资产净值为2,730,400,000.00元... 主要持仓包括: 工商银行、建设银行、农业银行等

六、基金风险分析

1. 市场风险: 本基金投资于沪深300指数成份股, 受股市波动影响较大 2. 流动性风险: 本基金资产流动性较好, 变现能力强

七、基金费用

1. 基金管理费: 按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提 2. 基金托管费: 按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提

八、基金业绩比较

1. 报告期末基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 2. 基金合同生效以来基金净值变动情况的比较

九、基金管理人

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

十、基金投资策略

本基金以完全复制法跟踪标的指数的变化... 采用被动式投资策略...

十一、基金费用

1. 基金管理费: 按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提 2. 基金托管费: 按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提

十二、基金业绩比较

1. 报告期末基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 2. 基金合同生效以来基金净值变动情况的比较

十三、基金管理人

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

2. 2008年1-6月利润表

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 2008年1-6月 (2008年1-6月). Rows include 一、收入 (Income), 二、费用 (Expenses), 三、利润总额 (Total Profit).

3. 2008年1-6月所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 2008年1-6月 (2008年1-6月). Rows include 一、期初所有者权益 (Beginning Equity), 二、本期所有者权益变动 (Change in Equity), 三、期末所有者权益 (Ending Equity).

(二) 财务报表附注

1. 重要会计政策和会计估计 2. 本报告期末会计估计变更和更正金额: 无 3. 重大关联方关系及关联交易

(三) 基金投资组合

1. 报告期末基金资产组合情况 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing industry distribution of stock investments as of June 30, 2008. Columns: 行业 (Industry), 市值 (Market Value), 占净值比例 (Percentage of Net Value).

(四) 报告期末按市值前五名的股票投资组合

Table showing top 5 stocks by market value as of June 30, 2008. Columns: 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (Quantity), 期末市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage of Net Value).

(五) 报告期末按市值前五名的债券投资组合

Table showing top 5 bonds by market value as of June 30, 2008. Columns: 股票代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 期末市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage of Net Value).

(六) 报告期末按市值前五名的权证投资组合

Table showing top 5 warrants by market value as of June 30, 2008. Columns: 股票代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量 (Quantity), 期末市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage of Net Value).

(七) 报告期末按公允价值计量的资产组合

Table showing fair value of assets as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(八) 报告期末按公允价值计量的负债组合

Table showing fair value of liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(九) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十一) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十二) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十三) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

2007年12月31日

Table showing financial data as of December 31, 2007. Columns: 资产 (Assets), 负债 (Liabilities), 所有者权益 (Equity).

于2008年6月30日, 本基金未持有交易性金融资产

六、基金投资策略

1. 报告期末基金资产组合情况 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing industry distribution of stock investments as of June 30, 2008. Columns: 行业 (Industry), 市值 (Market Value), 占净值比例 (Percentage of Net Value).

(二) 报告期末按市值前五名的股票投资组合

Table showing top 5 stocks by market value as of June 30, 2008. Columns: 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (Quantity), 期末市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage of Net Value).

(三) 报告期末按市值前五名的债券投资组合

Table showing top 5 bonds by market value as of June 30, 2008. Columns: 股票代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 期末市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage of Net Value).

(四) 报告期末按市值前五名的权证投资组合

Table showing top 5 warrants by market value as of June 30, 2008. Columns: 股票代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量 (Quantity), 期末市值 (Market Value), 市值占净值比例 (Percentage of Net Value).

(五) 报告期末按公允价值计量的资产组合

Table showing fair value of assets as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(六) 报告期末按公允价值计量的负债组合

Table showing fair value of liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(七) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(八) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(九) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十一) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十二) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十三) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十四) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

(十五) 报告期末按公允价值计量的资产和负债

Table showing fair value of assets and liabilities as of June 30, 2008. Columns: 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value), 公允价值 (Fair Value).

分类

Table showing asset classification. Columns: 分类 (Classification), 市值 (Market Value).

4. 本报告期末本基金处于转股期的可转换债券

5. 本报告期末及本报告期内本基金无被作为主动投资的权证

6. 本报告期内本基金未投资支持证券

七、基金持有人情况

1. 报告期末基金持有人户数: 198,316

2. 报告期末基金持有人户数: 33,825.46

八、开放式基金申购赎回情况

1. 基金申购: 2,730,400,000.00

2. 基金赎回: 1,286,115,234.70

3. 基金净申购: 1,444,284,765.30

4. 基金净申购占基金资产净值的比例: 5.29%

5. 基金净申购占基金资产净值的比例: 0.08%

九、重大事件揭示

1. 基金管理人: 国泰基金管理有限公司

2. 基金托管人: 中国银行股份有限公司

3. 基金销售机构: 国泰基金管理有限公司

4. 基金注册登记机构: 国泰基金管理有限公司

5. 基金审计机构: 普华永道会计师事务所

6. 基金投资决策委员会: 国泰基金管理有限公司

7. 基金估值委员会: 国泰基金管理有限公司

8. 基金风险控制委员会: 国泰基金管理有限公司

9. 基金信息披露委员会: 国泰基金管理有限公司

10. 基金业绩考核委员会: 国泰基金管理有限公司

11. 基金薪酬委员会: 国泰基金管理有限公司

12. 基金提名委员会: 国泰基金管理有限公司

13. 基金关联交易控制委员会: 国泰基金管理有限公司

14. 基金法律事务委员会: 国泰基金管理有限公司

15. 基金信息技术委员会: 国泰基金管理有限公司

16. 基金风险管理委员会: 国泰基金管理有限公司

17. 基金合规管理委员会: 国泰基金管理有限公司

18. 基金投资者关系管理委员会: 国泰基金管理有限公司

19. 基金环境与社会管理委员会: 国泰基金管理有限公司

20. 基金可持续发展委员会: 国泰基金管理有限公司

21. 基金社会责任委员会: 国泰基金管理有限公司

22. 基金道德委员会: 国泰基金管理有限公司

23. 基金廉洁委员会: 国泰基金管理有限公司

24. 基金反洗钱委员会: 国泰基金管理有限公司

25. 基金反恐委员会: 国泰基金管理有限公司

26. 基金网络安全委员会: 国泰基金管理有限公司

27. 基金数据保护委员会: 国泰基金管理有限公司

28. 基金隐私保护委员会: 国泰基金管理有限公司

29. 基金信息安全委员会: 国泰基金管理有限公司

30. 基金系统安全委员会: 国泰基金管理有限公司

31. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

32. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

33. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

34. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

35. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

36. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

37. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

38. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

39. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

40. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

41. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

42. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

43. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

44. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

45. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

46. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

47. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

48. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

49. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

50. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

51. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

52. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

53. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

54. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

55. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

56. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

57. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

58. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

59. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

60. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

61. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

62. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

63. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

64. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

65. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

66. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

67. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

68. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

69. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

70. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

71. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

72. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

73. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

74. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

75. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

76. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

77. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

78. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

79. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

80. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

81. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

82. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

83. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

84. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

85. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

86. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

87. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

88. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

89. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

90. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

91. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

92. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

93. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

94. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

95. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

96. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

97. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

98. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

99. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

100. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

101. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

102. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

103. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司

104. 基金灾难恢复委员会: 国泰基金管理有限公司

105. 基金业务连续性委员会: 国泰基金管理有限公司