

国泰沪深 300 指数证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 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：二〇一九年八月二十八日

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约定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 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
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9	开放式基金份额变动	55
10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	57
11	备查文件目录	58
11.1	备查文件目录	58
11.2	存放地点	58
11.3	查阅方式	59

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	
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	
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	2,779,583,784.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	020011	005867
报告期末下属分级基金的份额总额	2,778,653,549.59 份	930,235.24 份

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和成份股发生配股、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%×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	刘国华	王永民
	联系电话	021-31081600转	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码	200082	100818
法定代表人	陈勇胜	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层及基金托管人住所

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	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

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（2019年1月1日至2019年6月30日）	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
本期已实现收益	95,286,827.27	2,908.94
本期利润	512,932,082.51	1,072,212.12
加权平均基金份额本期利润	0.1767	0.2678
本期加权平均净值利润率	22.30%	37.56%
本期基金份额净值增长率	26.03%	26.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
期末可供分配利润	399,827,547.72	133,850.38
期末可供分配基金份额利润	0.1439	0.1439
期末基金资产净值	2,340,725,771.24	784,168.77
期末基金份额净值	0.8424	0.8430
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C

基金份额累计净值增长率	-15.67%	3.02%
-------------	---------	-------

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）自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

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

国泰沪深 300 指数 A

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	5.70%	1.10%	4.86%	1.04%	0.84%	0.06%
过去三个月	-0.17%	1.44%	-1.01%	1.38%	0.84%	0.06%
过去六个月	26.03%	1.46%	24.27%	1.40%	1.76%	0.06%
过去一年	10.22%	1.44%	8.39%	1.38%	1.83%	0.06%
过去三年	27.95%	1.05%	19.72%	1.00%	8.23%	0.05%
自基金合同生效起至今	-15.67%	1.61%	-18.18%	1.56%	2.51%	0.05%

国泰沪深 300 指数 C

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	5.71%	1.10%	4.86%	1.04%	0.85%	0.06%
过去三个月	0.24%	1.44%	-1.01%	1.38%	1.25%	0.06%
过去六个月	26.48%	1.45%	24.27%	1.40%	2.21%	0.05%
过去一年	10.34%	1.44%	8.39%	1.38%	1.95%	0.06%
自新增 C 类份额至今	3.02%	1.39%	0.77%	1.33%	2.25%	0.06%

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 2019 年 6 月 30 日）

国泰沪深 300 指数 A



国泰沪深 300 指数 C



注：1)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。

2)自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

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。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 108 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、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、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型

证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、

国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。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 14 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，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		
艾小军	本基金的基金经理、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰深证 TMT50 指数分级、上证 10 年期国债 ETF、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、	2015-04-10	-	18 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015

	<p>国泰中证申万证券行业指数 (LOF)、国泰策略价值灵活配置混合、国泰量化成长优选混合、国泰黄金 ETF 联接、国泰沪深 300 指数增强、国泰 CES 半导体行业 ETF、国泰中证 500 指数增强、上证 5 年期国债 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 的基金经理、投资总监 (量化)、金融工程总监</p>			<p>年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理, 2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理, 2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰保本混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金, 2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金 (由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2019 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 (由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金和</p>
--	--	--	--	---

					<p>国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来)的基金经理, 2019 年 7 月起兼任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。</p>
--	--	--	--	--	---

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, 本基金运作合法合规, 未发生损害基金份额持有人利益的行为, 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。

(一) 本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度在中美贸易纠纷走向缓和、市场流动性整体宽松的背景下，受大规模减税降费的利好以及科创板加速推进，资本市场地位得到了空前的提高，A 股自年初以来一扫去年的阴霾，大幅拉升，呈现普涨格局，表现位居全球主要资本市场首位。沪深两市成交大幅提升，由前期 3000 亿左右提高到接近万亿。受科创板加速推进的刺激，包括直接受益的资本市场主力券商板块以及与科创直接相关的计算机、半导体、通信等行业受到资金的青睐，板块主题行情轮番演绎；前期受非洲猪瘟影响的养猪板块在猪价大幅上涨的预期下更是迭创新高，领涨个股涨幅超过 200%；在华为、中兴 5G 屡屡被西方国家排除在外又屡屡突围以及国内 5G 建设加速推进的消息刺激下，5G 板块也轮番上涨，风格上以前期超跌股、破净股以及题材股领涨。

二季度受前期获利盘回吐以及北上资金持续大幅流出的影响，4 月份 A 股大幅下挫，上证指数单月跌幅达到 8.32%，前期表现较好的行业如计算机、通信、半导体等行业跌幅更甚。5 月份受中美贸易谈判局势恶化，美国针对中国 2000 亿美元加征关税至 25% 并启动其余 3000 多亿美元关税加征程序影响，A 股持续承压，在监管层呵护下 A 股维持窄幅震荡，以半导体为主的自主可控、国产替

代相关主题表现出色。临近季末，受美国经济走弱、美联储重启降息预期影响，尤其是 G20 中美元首峰会前市场预期中美贸易局势有所缓和，市场风险偏好逐步回升。

上半年整体上 A 股表现前高后低，风格上大盘蓝筹股表现更强，成长性中小盘股表现相对较弱，核心资产持续受到资金的青睐，上证指数上涨 19.45%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 上涨 27.8%，沪深 300 指数上涨 27.07%，成长性中小盘股表征指数如中证 500 上涨 18.77%，中小板指上涨 20.75%，创业板指上涨 20.87%。

在行业表现上，以消费、白酒为主的防御行业表现较好。申万一级行业中表现较好的食品饮料、非银金融和农林牧渔，涨幅分别达到为 61.01%、43.83% 和 41.96%，表现落后的为建筑建材、钢铁、传媒，分别下跌了 4.16%、5.04%、7.79%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰沪深 300 指数 A 在 2019 年上半年净值增长率为 26.03%，同期业绩比较基准收益率为 24.27%。

国泰沪深 300 指数 C 在 2019 年上半年净值增长率为 26.48%，同期业绩比较基准收益率为 24.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国际环境来看，在美国经济以及全球经济面临下滑的情况下，预计中美贸易纠纷短期内恶化的可能性较小，中长期来看，中美战略竞争的格局，尤其包括科技领域的竞争预计将长期化。国内环境来看，受全球经济下滑压力、美联储降息预期影响，国内货币政策可操作空间更为宽松，叠加减税降费将逐步反应到上市公司利润，上市公司整体业绩有望向好，在科创板上市开板的背景下，预计国内外宏观政策友好以及流动性相对宽松有利于市场风险偏好的持续。此外 A 股纳入 MSCI、富时指数权重因子将持续提升，尤其是中盘股将纳入指数且权重提升较大，预计外资将保持持续的净流入。总体上我们对 A 股市场保持区间震荡的观点。在中美科技竞争长期化的背景下，包括自主可控、国产替代尤其是科创板开板利好相关领域公司估值提升，风格上有业绩支撑的真成长类股票有望重新获得资金的青睐。行业上我们继续看好长期受益于中国经济结构转型以及关键领域有望突破的计算机、半导体、通信以及军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工，以及受益科创板开板以及风险偏好提升的证券公司行业。

沪深 300 这一中国经济最具代表性的指数的长期增长空间不言而喻。基于长期投资、价值投资的理念，投资者或可利用沪深 300 指数基金这一资产配置工具，把握中国经济长期投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

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

本报告中的财务指标、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“金融工具风险及管理”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。

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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	135,240,330.84	136,480,124.07
结算备付金		59,328.89	-
存出保证金		271,714.53	525,025.76
交易性金融资产	6.4.7.2	2,208,952,152.56	1,914,281,740.54
其中：股票投资		2,208,952,152.56	1,913,917,740.54
基金投资		-	-
债券投资		-	364,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	24,711.69	26,289.03
应收股利		-	-
应收申购款		696,137.85	658,252.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,345,244,376.36	2,051,971,431.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		909.26	-
应付赎回款		1,940,896.31	1,786,959.50
应付管理人报酬		935,844.21	894,678.86
应付托管费		187,168.83	178,935.80
应付销售服务费		298.38	957.72
应付交易费用	6.4.7.7	397,288.53	814,983.17
应交税费		-	0.78

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	272,030.83	316,695.29
负债合计		3,734,436.35	3,993,211.12
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,941,548,541.91	2,140,249,354.74
未分配利润	6.4.7.10	399,961,398.10	-92,271,134.29
所有者权益合计		2,341,509,940.01	2,047,978,220.45
负债和所有者权益总计		2,345,244,376.36	2,051,971,431.57

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，国泰沪深 300 指数 A 类基金的份额净值 0.8424 元，国泰沪深 300 指数 C 类基金的份额净值 0.8430 元。国泰沪深 300 指数证券投资基金份额总额 2,779,583,784.83 份，其中国泰沪深 300 指数 A 类基金的份额总额 2,778,653,549.59 份，国泰沪深 300 指数 C 类基金的份额总额 930,235.24 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		523,464,821.24	-196,334,786.87
1.利息收入		545,560.87	377,576.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	544,859.47	376,935.76
债券利息收入		701.40	641.21
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）		103,089,157.55	26,120,297.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	78,779,324.40	9,626,501.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	723,650.22	221,480.66
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	23,586,182.93	16,272,314.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	418,714,558.42	-222,952,721.19
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	1,115,544.40	120,060.26
减：二、费用		9,460,526.61	6,255,043.87
1. 管理人报酬		5,705,020.55	4,452,659.88
2. 托管费		1,141,004.05	890,532.06
3. 销售服务费		7,844.81	90.77
4. 交易费用	6.4.7.18	2,214,498.22	525,418.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.10	1.77
7. 其他费用	6.4.7.19	392,158.88	386,340.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		514,004,294.63	-202,589,830.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		514,004,294.63	-202,589,830.74

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	2,140,249,354.74	-92,271,134.29	2,047,978,220.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	514,004,294.63	514,004,294.63
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）	-198,700,812.83	-21,771,762.24	-220,472,575.07
其中：1.基金申购款	643,507,046.51	100,417,240.34	743,924,286.85
2.基金赎回款	-842,207,859.34	-122,189,002.58	-964,396,861.92
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）	1,941,548,541.91	399,961,398.10	2,341,509,940.01
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	1,536,521,320.42	361,294,616.00	1,897,815,936.42

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-202,589,830.74	-202,589,830.74
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)	-50,300,502.51	-18,725,961.72	-69,026,464.23
其中: 1.基金申购款	147,971,511.50	30,430,293.17	178,401,804.67
2.基金赎回款	-198,272,014.01	-49,156,254.89	-247,428,268.90
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)	1,486,220,817.91	139,978,823.54	1,626,199,641.45

报表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:

基金管理人负责人: 周向勇, 主管会计工作负责人: 倪莹, 会计机构负责人: 吴洪涛

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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并对本基金的基金合同作相应修改。本基金两类基金份额分别设置对应的基金代码，投资人申购时可以自主选择 A 类基金份额或 C 类基金份额对应的基金代码进行申购。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。2018 年 4 月 16 日前已持有本基金基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金基金份额余额为 A 类基金份额。具体内容请阅 2018 年 4 月 12 日披露的《关于国泰沪深 300 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》。

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 2019 年 8 月 26 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰沪深 300 指数证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息

红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	135,240,330.84
定期存款	-
其他存款	-
合计	135,240,330.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,872,931,340.13	2,208,952,152.56	336,020,812.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,872,931,340.13	2,208,952,152.56	336,020,812.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	24,568.39
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	24.03
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	9.20
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	110.07
合计	24,711.69

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	397,288.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	397,288.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,315.11
应付指数使用费	116,271.43
预提费用	152,444.29
合计	272,030.83

6.4.7.9 实收基金

国泰沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,048,624,096.12	2,129,483,523.94
本期申购	918,391,259.81	641,510,455.57
本期赎回（以“-”号填列）	-1,188,361,806.34	-830,095,755.99
本期末	2,778,653,549.59	1,940,898,223.52

国泰沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	15,412,967.50	10,765,830.80
本期申购	2,856,418.40	1,996,590.94
本期赎回（以“-”号填列）	-17,339,150.66	-12,112,103.35
本期末	930,235.24	650,318.39

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

国泰沪深 300 指数 A

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	1,241,145,047.00	-1,332,922,781.33	-91,777,734.33
本期利润	95,286,827.27	417,645,255.24	512,932,082.51
本期基金份额交易产生的变动数	-108,446,986.34	87,120,185.88	-21,326,800.46
其中：基金申购款	390,380,598.76	-290,255,990.68	100,124,608.08
基金赎回款	-498,827,585.10	377,376,176.56	-121,451,408.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,227,984,887.93	-828,157,340.21	399,827,547.72

国泰沪深 300 指数 C

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	6,242,952.84	-6,736,352.80	-493,399.96
本期利润	2,908.94	1,069,303.18	1,072,212.12
本期基金份额交易产生的变动数	-5,834,342.30	5,389,380.52	-444,961.78
其中：基金申购款	1,205,028.67	-912,396.41	292,632.26
基金赎回款	-7,039,370.97	6,301,776.93	-737,594.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	411,519.48	-277,669.10	133,850.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	531,129.30
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	9,197.96
其他	4,532.21
合计	544,859.47

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	830,104,364.01
减：卖出股票成本总额	751,325,039.61
买卖股票差价收入	78,779,324.40

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,156,974.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,432,600.00
减：应收利息总额	724.64
买卖债券差价收入	723,650.22

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,586,182.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,586,182.93

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	418,714,558.42
——股票投资	418,714,558.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	418,714,558.42

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	1,068,420.81
转换费收入	47,123.59
合计	1,115,544.40

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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，其中不低于赎回费部分的 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 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,214,498.22
银行间市场交易费用	-
合计	2,214,498.22

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	102,855.72
银行汇划费用	2,513.76
指数使用费	228,200.83
债券账户服务费	9,000.00
合计	392,158.88

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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	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、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）	基金销售机构、受基金管理人的控股股东（中国建投）控制的公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	7,987,754.84	0.55%	266,804.50	0.07%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券

		券成交总 额的比例		券成交总 额的比例
申万宏源	760,510.20	10.63%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	7,438.49	0.59%	7,438.49	1.87%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	248.47	0.09%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,705,020.55	4,452,659.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,045,852.48	1,078,425.92

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,141,004.05	890,532.06

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	7,636.40	7,636.40
合计	-	7,636.40	7,636.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰沪深300指数A	国泰沪深300指数C	合计
国泰基金管理有限公司	-	90.77	90.77
合计	-	90.77	90.77

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

国泰沪深 300 指数 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
国泰元鑫资产管 理有限公司	1,368,632.83	0.05%	-	-

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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	135,240,330. 84	531,129.30	106,648,395. 99	373,865.31

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 3,669,063 股，估值总额为人民币 13,722,295.62 元，占基金资产净值的比例为 0.59%。持有申万宏源集团股份有限公司(受基金管理人控股股东中国建投控制的公司)的 A 股普通股 1,562,255 股，估值总额为人民币 7,826,897.55 元，占基金资产净值的比例为 0.33%。(于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 2,883,163 股，估值总额为人民币 10,408,218.43 元，占基金资产净值的比例为 0.64%。持有申万宏源集团股份有限公司(受基金管理人控股股东中国建投控制的公司)的 A 股普通股 918,855 股，估值总额为人民币 4,015,396.35 元，占基金资产净值的比例为 0.25%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2019 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下中签	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下中签	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST 信威	2016-12-26	重大事项	14.59	2019-07-12	13.86	376,573.00	7,096,122.45	5,494,200.07	-

注：本基金截至 2019 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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。本基金属被动式股票指数基金，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。

本基金的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风险管理部、审计部和稽核监察部负责，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。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，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约责任，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股份有限公司，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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2018 年 12 月 31 日：本基金持有信用类债券 0.02%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有及承担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 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	135,240,330.84	-	-	-	135,240,330.84
结算备付金	59,328.89	-	-	-	59,328.89
存出保证金	271,714.53	-	-	-	271,714.53
交易性金融资产	-	-	-	2,208,952,152.56	2,208,952,152.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	24,711.69	24,711.69
应收申购款	106,378.36	-	-	589,759.49	696,137.85

资产总计	135,677,752.62	-	-	2,209,566,623.74	2,345,244,376.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,940,896.31	1,940,896.31
应付管理人报酬	-	-	-	935,844.21	935,844.21
应付托管费	-	-	-	187,168.83	187,168.83
应付交易费用	-	-	-	397,288.53	397,288.53
应付销售服务费	-	-	-	298.38	298.38
应付证券清算款	-	-	-	909.26	909.26
应付税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	272,030.83	272,030.83
负债总计	-	-	-	3,734,436.35	3,734,436.35
利率敏感度缺口	135,677,752.62	-	-	2,205,832,187.39	2,341,509,940.01
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	136,480,124.07	-	-	-	136,480,124.07
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	525,025.76	-	-	-	525,025.76
交易性金融资产	-	-	364,000.00	1,913,917,740.54	1,914,281,740.54
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	26,289.03	26,289.03
应收申购款	11,271.42	-	-	646,980.75	658,252.17
资产总计	137,016,421.25	-	364,000.00	1,914,591,010.32	2,051,971,431.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,786,959.50	1,786,959.50
应付管理人报酬	-	-	-	894,678.86	894,678.86
应付托管费	-	-	-	178,935.80	178,935.80
应付交易费用	-	-	-	814,983.17	814,983.17
应付销售服务费	-	-	-	957.72	957.72
应付税费	-	-	-	0.78	0.78

其他负债	-	-	-	316,695.29	316,695.29
负债总计	-	-	-	3,993,211.12	3,993,211.12
利率敏感度缺口	137,016,421.25	-	364,000.00	1,910,597,799.20	2,047,978,220.45

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 2019 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 0.00%(2018 年 12 月 31 日:0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 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和成份股发生配股、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，本基金的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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	2,208,952,15 2.56	94.34	1,913,917,740 .54	93.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,208,952,15 2.56	94.34	1,913,917,740 .54	93.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外的其他市场变量不变		
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：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 11,046	增加约 9,730
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 11,046	减少约 9,730

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,203,400,975.95 元, 属于第二层次的余额为 5,551,176.61 元, 无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日: 第一层次 1,877,334,461.17 元, 第二层次 36,947,279.37 元, 无第三层次)。于 2019 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2018 年 12 月 31 日: 同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额 无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	2,208,952,152.56	94.19
	其中: 股票	2,208,952,152.56	94.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	135,299,659.73	5.77
8	其他各项资产	992,564.07	0.04
9	合计	2,345,244,376.36	100.00

7.2 报告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	31,784,470.80	1.36
B	采矿业	71,153,462.65	3.04
C	制造业	871,404,955.86	37.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,318,309.51	2.11
E	建筑业	67,735,093.18	2.89
F	批发和零售业	29,536,002.44	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	68,214,419.27	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,124,937.42	3.38
J	金融业	775,419,339.50	33.12
K	房地产业	101,132,651.50	4.32
L	租赁和商务服务业	30,509,897.10	1.30
M	科学研究和技术服务业	2,049,201.88	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	2,551,863.78	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,693,410.27	0.46
R	文化、体育和娱乐业	11,874,196.50	0.51

S	综合	-	-
	合计	2,202,502,211.66	94.06

7.2.2 积极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	-	-
B	采矿业	662,189.25	0.03
C	制造业	5,691,171.35	0.24
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	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	6,449,940.90	0.28

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	601318	中国平安	1,906,538	168,938,332.18	7.21
2	600519	贵州茅台	88,291	86,878,344.00	3.71
3	600036	招商银行	1,787,585	64,317,308.30	2.75
4	000651	格力电器	860,351	47,319,305.00	2.02
5	601166	兴业银行	2,554,012	46,712,879.48	1.99
6	000333	美的集团	811,218	42,069,765.48	1.80
7	000858	五粮液	336,423	39,681,092.85	1.69
8	600887	伊利股份	1,066,870	35,644,126.70	1.52
9	600276	恒瑞医药	533,108	35,185,128.00	1.50
10	600030	中信证券	1,364,152	32,480,459.12	1.39
11	601328	交通银行	4,761,800	29,142,216.00	1.24
12	600016	民生银行	4,350,329	27,624,589.15	1.18
13	601288	农业银行	6,766,437	24,359,173.20	1.04
14	600000	浦发银行	2,034,846	23,767,001.28	1.02
15	000002	万科 A	842,567	23,431,788.27	1.00
16	300498	温氏股份	644,500	23,111,770.00	0.99
17	601668	中国建筑	3,832,118	22,034,678.50	0.94
18	601398	工商银行	3,738,187	22,017,921.43	0.94
19	000001	平安银行	1,533,636	21,133,504.08	0.90
20	600900	长江电力	1,147,248	20,535,739.20	0.88
21	601601	中国太保	561,700	20,507,667.00	0.88
22	600837	海通证券	1,402,521	19,901,772.99	0.85
23	002415	海康威视	648,454	17,884,361.32	0.76
24	600048	保利地产	1,249,525	15,943,939.00	0.68
25	600104	上汽集团	624,615	15,927,682.50	0.68
26	601169	北京银行	2,663,329	15,740,274.39	0.67
27	600585	海螺水泥	371,702	15,425,633.00	0.66
28	601888	中国国旅	169,160	14,996,034.00	0.64
29	603288	海天味业	140,356	14,737,380.00	0.63
30	601211	国泰君安	781,554	14,341,515.90	0.61
31	000725	京东方 A	4,108,446	14,133,054.24	0.60
32	600009	上海机场	166,986	13,990,087.08	0.60
33	002304	洋河股份	113,186	13,758,890.16	0.59
34	601988	中国银行	3,669,063	13,722,295.62	0.59
35	601766	中国中车	1,686,419	13,643,129.71	0.58
36	000063	中兴通讯	412,371	13,414,428.63	0.57
37	600031	三一重工	1,015,968	13,288,861.44	0.57
38	600309	万华化学	309,911	13,261,091.69	0.57
39	600028	中国石化	2,318,621	12,682,856.87	0.54
40	601688	华泰证券	566,140	12,636,244.80	0.54
41	300059	东方财富	931,205	12,617,827.75	0.54
42	601818	光大银行	3,197,095	12,180,931.95	0.52

43	601009	南京银行	1,463,760	12,090,657.60	0.52
44	601088	中国神华	587,277	11,968,705.26	0.51
45	000338	潍柴动力	953,018	11,712,591.22	0.50
46	600690	青岛海尔	651,807	11,269,743.03	0.48
47	601229	上海银行	947,028	11,222,281.80	0.48
48	600340	华夏幸福	340,976	11,105,588.32	0.47
49	000568	泸州老窖	135,541	10,955,779.03	0.47
50	002142	宁波银行	451,332	10,940,287.68	0.47
51	002475	立讯精密	428,974	10,634,265.46	0.45
52	600019	宝钢股份	1,584,127	10,296,825.50	0.44
53	600919	江苏银行	1,407,227	10,216,468.02	0.44
54	601012	隆基股份	439,667	10,160,704.37	0.43
55	600050	中国联通	1,613,875	9,941,470.00	0.42
56	601857	中国石油	1,403,247	9,654,339.36	0.41
57	002027	分众传媒	1,780,670	9,419,744.30	0.40
58	601006	大秦铁路	1,142,896	9,246,028.64	0.39
59	601989	中国重工	1,586,217	8,819,366.52	0.38
60	601628	中国人寿	310,267	8,786,761.44	0.38
61	601336	新华保险	159,540	8,779,486.20	0.37
62	600015	华夏银行	1,134,043	8,732,131.10	0.37
63	002714	牧原股份	147,520	8,672,700.80	0.37
64	601939	建设银行	1,163,854	8,659,073.76	0.37
65	001979	招商蛇口	410,975	8,589,377.50	0.37
66	600999	招商证券	495,485	8,467,838.65	0.36
67	002230	科大讯飞	253,901	8,439,669.24	0.36
68	601390	中国中铁	1,291,933	8,423,403.16	0.36
69	000776	广发证券	605,271	8,316,423.54	0.36
70	000661	长春高新	24,158	8,165,404.00	0.35
71	601225	陕西煤业	879,112	8,122,994.88	0.35
72	002594	比亚迪	157,102	7,968,213.44	0.34
73	601186	中国铁建	797,510	7,935,224.50	0.34
74	601899	紫金矿业	2,098,018	7,909,527.86	0.34
75	000166	申万宏源	1,562,255	7,826,897.55	0.33
76	000100	TCL 集团	2,282,610	7,601,091.30	0.32
77	600570	恒生电子	111,344	7,588,093.60	0.32
78	000538	云南白药	90,695	7,565,776.90	0.32
79	002024	苏宁易购	645,414	7,409,352.72	0.32
80	002007	华兰生物	240,991	7,347,815.59	0.31
81	601669	中国电建	1,387,245	7,338,526.05	0.31
82	600352	浙江龙盛	461,987	7,285,534.99	0.31
83	600958	东方证券	639,695	6,831,942.60	0.29
84	601933	永辉超市	663,404	6,773,354.84	0.29
85	002202	金风科技	544,060	6,762,665.80	0.29
86	300015	爱尔眼科	214,887	6,655,050.39	0.28

87	601377	兴业证券	976,138	6,579,170.12	0.28
88	000876	新希望	365,437	6,347,640.69	0.27
89	601155	新城控股	156,526	6,231,300.06	0.27
90	002736	国信证券	470,254	6,188,542.64	0.26
91	000783	长江证券	790,398	6,173,008.38	0.26
92	600436	片仔癀	53,098	6,116,889.60	0.26
93	600741	华域汽车	283,064	6,114,182.40	0.26
94	300142	沃森生物	213,246	6,047,656.56	0.26
95	600705	中航资本	1,113,423	6,034,752.66	0.26
96	600406	国电南瑞	318,373	5,934,472.72	0.25
97	600588	用友网络	215,469	5,791,806.72	0.25
98	600660	福耀玻璃	243,030	5,524,071.90	0.24
99	600029	南方航空	701,761	5,417,594.92	0.23
100	000157	中联重科	890,215	5,350,192.15	0.23
101	600010	包钢股份	3,159,871	5,340,181.99	0.23
102	600547	山东黄金	128,670	5,297,343.90	0.23
103	000895	双汇发展	211,603	5,266,798.67	0.22
104	002008	大族激光	151,685	5,214,930.30	0.22
105	600795	国电电力	2,043,391	5,190,213.14	0.22
106	600115	东方航空	816,758	5,121,072.66	0.22
107	601111	中国国航	530,476	5,076,655.32	0.22
108	601901	方正证券	713,291	5,071,499.01	0.22
109	601997	贵阳银行	572,222	4,949,720.30	0.21
110	000069	华侨城 A	710,902	4,940,768.90	0.21
111	600606	绿地控股	716,283	4,892,212.89	0.21
112	600111	北方稀土	377,913	4,852,402.92	0.21
113	603993	洛阳钼业	1,224,634	4,849,550.64	0.21
114	600703	三安光电	423,993	4,782,641.04	0.20
115	601108	财通证券	435,400	4,780,692.00	0.20
116	600011	华能国际	762,500	4,750,375.00	0.20
117	600438	通威股份	336,511	4,731,344.66	0.20
118	600886	国投电力	601,089	4,670,461.53	0.20
119	600383	金地集团	391,215	4,667,194.95	0.20
120	600089	特变电工	643,704	4,666,854.00	0.20
121	601800	中国交建	407,127	4,608,677.64	0.20
122	002236	大华股份	311,761	4,526,769.72	0.19
123	601985	中国核电	809,276	4,499,574.56	0.19
124	600271	航天信息	193,707	4,464,946.35	0.19
125	002422	科伦药业	149,576	4,446,894.48	0.19
126	601600	中国铝业	1,133,298	4,442,528.16	0.19
127	600196	复星医药	174,271	4,409,056.30	0.19
128	600109	国金证券	447,998	4,354,540.56	0.19
129	002001	新和成	223,400	4,309,386.00	0.18
130	300017	网宿科技	398,359	4,294,310.02	0.18

131	601555	东吴证券	416,912	4,273,348.00	0.18
132	300003	乐普医疗	185,260	4,264,685.20	0.18
133	002311	海大集团	137,149	4,237,904.10	0.18
134	600332	白云山	103,222	4,229,005.34	0.18
135	300144	宋城演艺	182,083	4,213,400.62	0.18
136	000963	华东医药	161,283	4,186,906.68	0.18
137	600926	杭州银行	501,049	4,173,738.17	0.18
138	002146	荣盛发展	441,162	4,142,511.18	0.18
139	000413	东旭光电	804,184	4,133,505.76	0.18
140	600061	国投资本	292,958	4,104,341.58	0.18
141	600487	亨通光电	243,300	4,077,708.00	0.17
142	600221	海航控股	1,993,997	4,047,813.91	0.17
143	002044	美年健康	324,627	4,038,359.88	0.17
144	300124	汇川技术	172,820	3,959,306.20	0.17
145	600522	中天科技	425,117	3,898,322.89	0.17
146	601788	光大证券	338,573	3,866,503.66	0.17
147	600177	雅戈尔	608,283	3,862,597.05	0.16
148	002410	广联达	117,100	3,851,419.00	0.16
149	600018	上港集团	562,307	3,834,933.74	0.16
150	000768	中航飞机	239,777	3,776,487.75	0.16
151	600637	东方明珠	356,964	3,762,400.56	0.16
152	601618	中国中冶	1,237,572	3,762,218.88	0.16
153	600100	同方股份	410,957	3,719,160.85	0.16
154	300033	同花顺	37,201	3,659,090.36	0.16
155	002352	顺丰控股	107,308	3,644,179.68	0.16
156	000425	徐工机械	814,618	3,633,196.28	0.16
157	601607	上海医药	200,028	3,630,508.20	0.16
158	300122	智飞生物	83,200	3,585,920.00	0.15
159	600893	航发动力	156,043	3,543,736.53	0.15
160	300408	三环集团	181,305	3,526,382.25	0.15
161	002271	东方雨虹	155,200	3,516,832.00	0.15
162	600170	上海建工	933,055	3,508,286.80	0.15
163	600176	中国巨石	364,300	3,471,779.00	0.15
164	601877	正泰电器	149,091	3,442,511.19	0.15
165	600516	方大炭素	279,971	3,440,843.59	0.15
166	002081	金螳螂	330,419	3,406,619.89	0.15
167	600498	烽火通信	121,641	3,388,918.26	0.14
168	601919	中远海控	670,952	3,368,179.04	0.14
169	000728	国元证券	366,100	3,357,137.00	0.14
170	000423	东阿阿胶	83,056	3,307,289.92	0.14
171	300136	信维通信	135,193	3,305,468.85	0.14
172	601727	上海电气	611,144	3,287,954.72	0.14
173	600004	白云机场	179,300	3,263,260.00	0.14
174	600867	通化东宝	211,500	3,257,100.00	0.14

175	603019	中科曙光	109,800	3,243,492.00	0.14
176	601998	中信银行	531,106	3,170,702.82	0.14
177	002460	赣锋锂业	135,234	3,168,532.62	0.14
178	600674	川投能源	353,665	3,147,618.50	0.13
179	600809	山西汾酒	45,403	3,135,077.15	0.13
180	600023	浙能电力	707,149	3,125,598.58	0.13
181	600489	中金黄金	299,030	3,071,038.10	0.13
182	000625	长安汽车	462,590	3,066,971.70	0.13
183	002673	西部证券	303,475	3,059,028.00	0.13
184	002466	天齐锂业	120,984	3,058,475.52	0.13
185	002241	歌尔股份	340,268	3,024,982.52	0.13
186	601018	宁波港	684,805	3,006,293.95	0.13
187	600066	宇通客车	230,279	2,998,232.58	0.13
188	600068	葛洲坝	478,834	2,983,135.82	0.13
189	002179	中航光电	89,098	2,981,219.08	0.13
190	002065	东华软件	426,119	2,978,571.81	0.13
191	300024	机器人	189,320	2,883,343.60	0.12
192	601021	春秋航空	63,624	2,863,080.00	0.12
193	601198	东兴证券	238,935	2,838,547.80	0.12
194	600362	江西铜业	179,772	2,829,611.28	0.12
195	600398	海澜之家	311,459	2,824,933.13	0.12
196	600219	南山铝业	1,242,630	2,808,343.80	0.12
197	600482	中国动力	118,891	2,808,205.42	0.12
198	002602	世纪华通	256,697	2,803,131.24	0.12
199	000961	中南建设	321,482	2,784,034.12	0.12
200	601838	成都银行	313,000	2,763,790.00	0.12
201	600085	同仁堂	95,078	2,757,262.00	0.12
202	002456	欧菲光	349,463	2,739,789.92	0.12
203	601881	中国银河	223,436	2,737,091.00	0.12
204	603156	养元饮品	72,876	2,702,242.08	0.12
205	000630	铜陵有色	1,094,488	2,692,440.48	0.11
206	000703	恒逸石化	197,000	2,691,020.00	0.11
207	002739	万达电影	144,100	2,657,204.00	0.11
208	000786	北新建材	146,300	2,652,419.00	0.11
209	002493	荣盛石化	218,100	2,630,286.00	0.11
210	600535	天士力	157,260	2,602,653.00	0.11
211	603986	兆易创新	29,601	2,566,406.70	0.11
212	600208	新潮中宝	816,698	2,564,431.72	0.11
213	300070	碧水源	327,582	2,551,863.78	0.11
214	600297	广汇汽车	567,264	2,529,997.44	0.11
215	002050	三花智控	239,589	2,527,663.95	0.11
216	000629	攀钢钒钛	744,300	2,523,177.00	0.11
217	002555	三七互娱	184,105	2,494,622.75	0.11
218	601138	工业富联	206,294	2,485,842.70	0.11

219	601216	君正集团	736,834	2,424,183.86	0.10
220	600369	西南证券	489,241	2,416,850.54	0.10
221	300296	利亚德	308,500	2,415,555.00	0.10
222	603799	华友钴业	112,075	2,388,318.25	0.10
223	603833	欧派家居	22,110	2,379,478.20	0.10
224	600663	陆家嘴	152,499	2,363,734.50	0.10
225	000596	古井贡酒	19,900	2,358,349.00	0.10
226	002624	完美世界	91,090	2,351,032.90	0.10
227	600118	中国卫星	102,504	2,311,465.20	0.10
228	600415	小商品城	554,668	2,285,232.16	0.10
229	603160	汇顶科技	16,401	2,276,458.80	0.10
230	600688	上海石化	435,478	2,247,066.48	0.10
231	600346	恒力石化	183,800	2,235,008.00	0.10
232	000656	金科股份	370,200	2,232,306.00	0.10
233	002508	老板电器	82,200	2,230,908.00	0.10
234	000627	天茂集团	342,520	2,222,954.80	0.09
235	000709	河钢股份	736,091	2,200,912.09	0.09
236	600153	建发股份	245,655	2,181,416.40	0.09
237	601992	金隅集团	578,035	2,173,411.60	0.09
238	002032	苏泊尔	28,400	2,153,572.00	0.09
239	601878	浙商证券	231,131	2,149,518.30	0.09
240	600583	海油工程	383,143	2,145,600.80	0.09
241	600027	华电国际	564,800	2,129,296.00	0.09
242	600760	中航沈飞	72,800	2,113,384.00	0.09
243	600038	中直股份	51,137	2,097,639.74	0.09
244	600977	中国电影	133,178	2,085,567.48	0.09
245	601117	中国化学	341,997	2,058,821.94	0.09
246	600816	安信信托	406,387	2,052,254.35	0.09
247	603259	药明康德	23,641	2,049,201.88	0.09
248	002153	石基信息	55,365	2,003,659.35	0.09
249	603858	步长制药	76,840	1,980,166.80	0.08
250	002558	巨人网络	105,192	1,911,338.64	0.08
251	000671	阳光城	280,764	1,819,350.72	0.08
252	601238	广汽集团	160,780	1,757,325.40	0.08
253	601319	中国人保	184,600	1,751,854.00	0.07
254	601633	长城汽车	208,910	1,727,685.70	0.07
255	600188	兖州煤业	157,814	1,715,438.18	0.07
256	002010	传化智联	225,800	1,700,274.00	0.07
257	600566	济川药业	56,404	1,698,324.44	0.07
258	002310	东方园林	279,250	1,675,500.00	0.07
259	601066	中信建投	78,300	1,650,564.00	0.07
260	300072	三聚环保	204,776	1,623,873.68	0.07
261	002294	信立泰	72,500	1,622,550.00	0.07
262	600704	物产中大	298,548	1,618,130.16	0.07

263	000898	鞍钢股份	415,610	1,575,161.90	0.07
264	002601	龙蟠佰利	105,594	1,565,959.02	0.07
265	000402	金融街	199,173	1,561,516.32	0.07
266	601898	中煤能源	317,196	1,522,540.80	0.07
267	601360	三六零	70,400	1,505,152.00	0.06
268	002411	延安必康	86,397	1,503,307.80	0.06
269	002773	康弘药业	45,460	1,496,543.20	0.06
270	300413	芒果超媒	36,400	1,494,220.00	0.06
271	300251	光线传媒	209,383	1,423,804.40	0.06
272	600372	中航电子	91,467	1,357,370.28	0.06
273	000938	紫光股份	49,554	1,350,346.50	0.06
274	601228	广州港	322,000	1,345,960.00	0.06
275	002468	申通快递	53,100	1,324,314.00	0.06
276	002938	鹏鼎控股	43,967	1,290,871.12	0.06
277	600025	华能水电	311,900	1,269,433.00	0.05
278	000415	渤海租赁	321,567	1,260,542.64	0.05
279	600339	中油工程	290,400	1,225,488.00	0.05
280	600998	九州通	97,600	1,206,336.00	0.05
281	002120	韵达股份	38,050	1,172,701.00	0.05
282	601808	中海油服	102,600	988,038.00	0.04
283	002939	长城证券	59,100	986,379.00	0.04
284	601162	天风证券	89,800	973,432.00	0.04
285	300433	蓝思科技	136,146	948,937.62	0.04
286	002925	盈趣科技	23,780	927,657.80	0.04
287	002945	华林证券	46,700	863,950.00	0.04
288	600390	五矿资本	91,000	858,130.00	0.04
289	000408	藏格控股	103,600	856,772.00	0.04
290	601828	美凯龙	69,800	848,070.00	0.04
291	000553	安道麦 A	79,000	846,880.00	0.04
292	603260	合盛硅业	17,501	823,597.06	0.04
293	600233	圆通速递	63,801	786,666.33	0.03
294	601298	青岛港	84,100	705,599.00	0.03
295	002625	光启技术	74,620	693,219.80	0.03
296	601212	白银有色	149,899	658,056.61	0.03
297	601577	长沙银行	65,300	622,962.00	0.03
298	600733	北汽蓝谷	72,700	600,502.00	0.03
299	600299	安迪苏	51,200	530,944.00	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

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	600485	*ST 信威	376,573	5,494,200.07	0.23
2	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
3	000983	西山煤电	49,300	298,758.00	0.01
4	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
5	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
6	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
7	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
8	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
9	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
10	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
11	000959	首钢股份	5,700	20,064.00	0.00

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	601318	中国平安	32,838,931.47	1.60
2	300498	温氏股份	24,753,676.82	1.21
3	600519	贵州茅台	15,267,436.95	0.75
4	601166	兴业银行	15,174,158.00	0.74
5	600036	招商银行	13,748,045.37	0.67
6	000333	美的集团	10,508,813.90	0.51
7	600276	恒瑞医药	10,393,430.61	0.51
8	000651	格力电器	8,646,726.00	0.42
9	600030	中信证券	8,542,431.00	0.42
10	601328	交通银行	7,753,152.34	0.38
11	000858	五粮液	7,654,706.75	0.37
12	600887	伊利股份	7,253,867.90	0.35
13	600016	民生银行	7,152,320.20	0.35
14	000002	万科 A	6,772,098.35	0.33
15	600000	浦发银行	6,377,373.77	0.31
16	601288	农业银行	6,311,744.00	0.31
17	002415	海康威视	6,126,898.76	0.30
18	601088	中国神华	5,966,574.00	0.29
19	601668	中国建筑	5,965,996.08	0.29
20	601398	工商银行	5,670,168.00	0.28

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	601318	中国平安	50,927,128.41	2.49
2	600519	贵州茅台	23,756,342.63	1.16
3	600036	招商银行	21,331,112.01	1.04
4	000333	美的集团	15,657,906.82	0.76
5	601166	兴业银行	13,654,911.52	0.67
6	000651	格力电器	13,629,361.00	0.67
7	600030	中信证券	12,255,853.11	0.60
8	601328	交通银行	11,820,305.47	0.58
9	000858	五粮液	11,611,316.58	0.57
10	600887	伊利股份	11,184,086.39	0.55
11	600016	民生银行	10,829,427.79	0.53
12	600276	恒瑞医药	9,734,338.99	0.48
13	000002	万科 A	9,724,611.10	0.47
14	601288	农业银行	9,700,398.22	0.47
15	600000	浦发银行	9,495,033.75	0.46
16	601668	中国建筑	8,974,834.00	0.44
17	601398	工商银行	8,511,193.00	0.42
18	002415	海康威视	8,508,002.02	0.42
19	600900	长江电力	8,045,221.00	0.39
20	601601	中国太保	7,445,174.40	0.36

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	628,814,127.79
卖出股票的收入（成交）总额	830,104,364.01

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“招商银行”、“兴业银行”、“中信证券”违规外）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。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字（2018）1 号，招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户、为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保、未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目、高管人员在获得任职资格核准前履职、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务、未严格审查贸易背景真实性开立信用证、违规签订保本合同销售同业非保本理财产品、非真实转让信贷资产、违规向典当行发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等共计十四项违规事实。中国银监会决定对其罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

根据招商银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司上海、天津、长沙、西宁等下属分行、支行由于违规办理无真实贸易背景的保理融资业务、理财“双录”未完整记录销售全过程、资产质量反映不真实等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字（2018）1 号，兴业银行存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合

规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等共计十二项违规事实。中国银保监会决定对其罚款 5870 万元。

根据兴业银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司上海、郑州、兰州、大连等下属分行、支行由于授信不审慎造成信用风险暴露、贷前调查不尽职导致贷款资金回流至借款人、信贷资金被挪用等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

2018 年 12 月 18 日，中信证券江苏分公司由于违反反洗钱规定，收到中国人民银行南京分行罚款 20 万元。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.12.2 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。

7.12.3 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	271,714.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,711.69
5	应收申购款	696,137.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	992,564.07

7.12.4 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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600485	*ST 信威	5,494,200.07	0.23	重大事项

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

份额级别	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
国泰沪深 300 指数 A	84,442	32,906.06	690,529,813.18	24.85%	2,088,123,736.41	75.15%
国泰沪深 300 指数 C	58	16,038.54	-	-	930,235.24	100.00%
合计	84,500	32,894.48	690,529,813.18	24.84%	2,089,053,971.65	75.16%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	国泰沪深 300 指数 A	1,521,743.44	0.05%
	国泰沪深 300 指数 C	24,728.97	2.66%
	合计	1,546,472.41	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰沪深 300 指数 A	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰沪深 300 指数 A	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
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	3,048,624,096.12	15,412,967.50
本报告期基金总申购份额	918,391,259.81	2,856,418.40
减：本报告期基金总赎回份额	1,188,361,806.34	17,339,150.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,778,653,549.59	930,235.24

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，本基金管理人重大人事变动如下：

2019 年 3 月 30 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第十七次会议审议通过，聘任刘国华女士担任本基金管理人督察长，李永梅女士不再担任督察长，转任本基金管理人副总经理；

2019 年 6 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第二十一次会议审议通过，聘任倪莹女士担任本基金管理人首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
国金证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	447,675,918.59	30.78%	392,088.83	31.24%	-
安信证券	1	389,236,285.62	26.76%	362,499.92	28.88%	-
中金公司	2	220,697,896.43	15.17%	161,397.43	12.86%	-
中信证券	1	159,078,425.65	10.94%	148,149.79	11.80%	-
长江证券	1	141,266,560.82	9.71%	103,308.55	8.23%	-
银河证券	1	39,538,273.18	2.72%	36,822.62	2.93%	-
瑞银证券	1	34,222,718.12	2.35%	32,555.89	2.59%	-
光大证券	1	9,342,794.95	0.64%	6,832.46	0.54%	-
申万宏源	1	7,987,754.84	0.55%	7,438.49	0.59%	-
东方证券	1	5,515,732.76	0.38%	4,033.52	0.32%	-
中投证券	1	87,181.84	0.01%	63.75	0.01%	-

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:根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果,符合交易席位租用标准的,由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见(包括调整名单及调整原因等),并经公司批准。

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
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	2,924,812.80	40.87%	-	-	-	-
安信证券	419,764.80	5.87%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	3,051,887.06	42.64%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	760,510.20	10.63%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019-02-27
2	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019-03-30

3	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019-04-03
4	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019-04-13
5	国泰基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告	《中国证券报》	2019-04-26
6	国泰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值调整的公告	《中国证券报》	2019-05-06
7	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019-05-08
8	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019-06-01
9	国泰基金管理有限公司关于设立深圳市分公司的公告	《中国证券报》	2019-06-19
10	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019-06-22
11	国泰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》	2019-06-26

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、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

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——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16-19 层。

本基金托管人住所。

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）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日