

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

2013 年半年度报告

2013 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 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 2013 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
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	6
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
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	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	38
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	38
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	38
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38

7.10 投资组合报告附注	39
8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
9 开放式基金份额变动	40
10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
11 备查文件目录	44
11.1 备查文件目录	44
11.2 存放地点	44
11.3 查阅方式	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	国泰中小盘成长股票(LOF)（场内简称：国泰小盘）
基金主代码	160211
交易代码	160211
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月19日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	744,996,779.21份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年1月7日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济发展趋势的预测分析，评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。其中，股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象，采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。
业绩比较基准	本基金的业绩基准=35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金是股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司，属于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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海中	田青
	联系电话	021-38561600 转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		(021) 38569000, 400-888-8688	010-67595096
传真		021-38561800	010-66275853
注册地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市世纪大道 100 号上海 环球金融中心 39 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈勇胜	王洪章

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 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	30,028,745.92
本期利润	104,901,445.71
加权平均基金份额本期利润	0.1280

本期加权平均净值利润率	13.26%
本期基金份额净值增长率	13.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,218,747.19
期末可供分配基金份额利润	0.0097
期末基金资产净值	730,748,238.69
期末基金份额净值	0.981
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.48%

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	-11.22%	1.90%	-11.72%	1.52%	0.50%	0.38%
过去三个月	2.29%	1.56%	-4.91%	1.19%	7.20%	0.37%
过去六个月	13.67%	1.41%	-0.86%	1.13%	14.53%	0.28%
过去一年	17.34%	1.26%	-3.88%	1.13%	21.22%	0.13%
过去三年	13.94%	1.30%	-5.51%	1.22%	19.45%	0.08%
自基金成立起至今	6.48%	1.24%	-11.16%	1.25%	17.64%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

自基金合同生效以来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

(2009 年 10 月 19 日至 2013 年 6 月 30 日)



注：本基金的转型日为 2009 年 10 月 19 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。

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 35 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）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（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、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、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、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金(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、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。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，成为目前业内少数拥有“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		
张玮	本基金的基金经理、国泰金鹰增长股票、国泰成长优选股票的基金经理、公司投资总监兼研究部总监	2009-10-19	-	13	硕士研究生。2000 年 11 月至 2004 年 6 月就职于申银万国证券研究所，任行业研究员。2004 年 7 月至 2007 年 3 月就职于银河基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理。2007 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹰增长基金的基金经理助理，2008 年 5 月起担任国泰金鹰增长证券投资基金的基金经理，2009 年 4

					月至 2009 年 10 月兼任国泰金盛封闭的基金经理，2009 年 10 月起兼任国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)的基金经理，2012 年 3 月起兼任国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理。2010 年 7 月至 2011 年 6 月任研究部副总监，2011 年 6 月起任研究部总监。2011 年 6 月至 2012 年 2 月任公司投资副总监，2012 年 2 月起任公司投资总监。
周伟锋	本基金的基金经理, 国泰金鹰增长证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理助理	2013-06-13	-	5	硕士研究生，2002 年 7 月至 2006 年 8 月在中国航天科技集团西安航天发动机厂担任技术员，2006 年 9 月至 2008 年 6 月在上海财经大学学习，获应用经济学硕士学位，2008 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、基金经理助理，2012 年 1 月至 2013 年 6 月任国泰金鹰增长证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理助理，2013 年 6 月 13 日起任国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)的基金经理。

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。

（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 ≥ 20 ），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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

随着今年年初市场对经济复苏的预期在一季度末开始明显转弱，经济也逐步显示出疲态，这个过程一直延续到了整个上半年，特别是后期叠加了美国 QE 的退出预期等不利因素，使得中国股市在二季度末表现相对疲软。特别是与过往经济周期相关的投资拉动型行业，受到了明显的压力。同时，由于央行货币市场短期操作习惯的变化，使得临近二季度末的货币市场出现了历史上较为罕见的紧张状况。几个因素的叠加，使得上证综指在六月底创出了近 4 年多以来的新低，最终使得上证综指达到了 12.78% 的较大跌幅报收上半年。与此同时，经济结构转型受益的新兴产业、成长股的代表创业板指数，最终以 41.72% 的半年度涨幅收盘，两者之间超过了 54% 的差异在 A 股历史上较为罕见。

从本基金上半年的操作情况来看，我们年初判断宏观经济复苏机会较弱，投资机会更多的会出现在与经济结构转型相关的行业之中，因此我们把资产更多地配置了与转型、消费等相关的行业与个股，增持了受益于经济结构转型的消费电子、食品饮料等行业，同时减持了受经济与政策影响较大的化工、汽车等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2013 年上半年净值增长率为 13.67%，同期业绩比较基准收益率为 -0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前时点观察未来的宏观经济走势，我们认为宏观经济仍然将继续处于弱复苏局面。随着新一届政府不断深化改革，旧的增长模式在未来将受到较大的挑战，政府把更多的精力将投放在市场效率改善，民生、生活环境等的提高。过去投资人比较注重 GDP 增速的预判，未来我们将看重 GDP 的质量与效率。在未来的投资方向上，我们也将更多地侧重有利于经济结构转型的方向。

对于证券市场，目前市场主体对经济的增速预期已经有所调降，我们认为近期不太具备形成大的趋势性行情的条件，但未来一段时间内结构性行情仍将存在。我们将继续重点配置

符合经济转型、技术创新、品牌消费等的方向与行业。短期来看这些行业中估值相对较高，我们将保持适度谨慎，仔细甄别，耐心寻找更好的买入时机。

在追求收益的同时，更加注重风险评估和风险控制，为持有人创造稳健良好的中长期业绩回报将是我们不变的目标。

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，并制订了相关制度及流程。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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，未发现基金管理人有关损害基

金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	34,396,185.55	87,378,737.16
结算备付金		945,751.68	475,946.42
存出保证金		166,061.07	827,800.70
交易性金融资产	6.4.7.2	707,086,795.73	625,719,451.04
其中：股票投资		677,021,052.62	569,513,031.63
基金投资		-	-
债券投资		30,065,743.11	56,206,419.41
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	10,000,000.00	58,200,242.30
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	885,380.22	1,410,186.00
应收股利		-	-
应收申购款		74,438.00	42,399.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		753,554,612.25	774,054,762.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		19,786,443.78	32,564,157.06
应付赎回款		724,970.75	1,046,462.72
应付管理人报酬		966,799.17	815,791.76
应付托管费		161,133.18	135,965.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	375,729.85	201,072.65
应交税费		287,030.48	287,030.48
应付利息		-	-
应付利润		279,108.68	279,108.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	225,157.67	476,114.16
负债合计		22,806,373.56	35,805,702.77
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	623,947,231.64	716,744,468.36
未分配利润	6.4.7.10	106,801,007.05	21,504,591.82
所有者权益合计		730,748,238.69	738,249,060.18
负债和所有者权益总计		753,554,612.25	774,054,762.95

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.981 元，基金份额总额 744,996,779.21 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		113,340,457.17	-11,544,758.44
1.利息收入		1,153,874.41	1,400,421.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	211,298.22	228,719.68
债券利息收入		855,520.47	1,035,747.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		87,055.72	135,954.67
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		37,151,772.42	-40,895,684.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	31,083,750.56	-47,162,254.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-291,113.23	572,384.24
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	6,359,135.09	5,694,185.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	74,872,699.79	27,874,273.13
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	162,110.55	76,231.33
减：二、费用		8,439,011.46	7,747,961.07
1. 管理人报酬		5,878,475.35	5,542,862.37
2. 托管费		979,745.85	923,810.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,348,292.42	1,025,830.65
5. 利息支出		-	8,375.78
其中：卖出回购金融资产支出		-	8,375.78
6. 其他费用	6.4.7.19	232,497.84	247,081.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		104,901,445.71	-19,292,719.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		104,901,445.71	-19,292,719.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	716,744,468.36	21,504,591.82	738,249,060.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	104,901,445.71	104,901,445.71

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）	-92,797,236.72	-19,605,030.48	-112,402,267.20
其中：1. 基金申购款	14,647,558.67	2,618,245.82	17,265,804.49
2. 基金赎回款	-107,444,795.39	-22,223,276.30	-129,668,071.69
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）	623,947,231.64	106,801,007.05	730,748,238.69
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	768,361,031.37	17,877,835.87	786,238,867.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,292,719.51	-19,292,719.51
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）	-50,354,959.59	119,656.09	-50,235,303.50
其中：1. 基金申购款	10,613,915.10	126,980.62	10,740,895.72
2. 基金赎回款	-60,968,874.69	-7,324.53	-60,976,199.22
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）	718,006,071.78	-1,295,227.55	716,710,844.23

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：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：巴立康

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)是根据原金盛证券投资基金(以下简称“基金金盛”)基金份额持有人大会 2009 年 8 月 20 日决议通过的《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]

925 号《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》，由原金盛证券投资基金转型而来。原基金金盛为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限至 2009 年 11 月 30 日止。根据深交所深证复[2009] 35 号《关于同意金盛证券投资基金终止上市的批复》，原基金金盛于 2009 年 10 月 16 日进行终止上市权利登记。自 2009 年 10 月 19 日起，原基金金盛终止上市，原基金金盛更名为国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)，《金盛证券投资基金基金合同》失效的同时《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金金盛于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 549,926,313.74 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《关于原金盛证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2009 年 11 月 23 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 1.193840063，并于 2009 年 11 月 24 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 18 日期间内开放集中申购，共募集 4,514,369,288.09 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 1,379,695.40 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 252 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2009 年 11 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 4,514,369,288.09 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 1,379,695.40 份基金份额，并于 2009 年 11 月 24 日进行了确认登记。

经深交所深证上字[2009]第 204 号文审核同意，本基金 825,721,408.00 份基金份额于 2010 年 1 月 7 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)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，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有高

成长性和良好基本面的中小盘成长股票。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数 X 35%+天相小盘成长指数 X 45%+中证全债指数 X 20%。

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 2013 年 8 月 20 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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》、《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 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。
- (3) 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。2013 年 1 月 1 日以前，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。

(4) 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	34,396,185.55
定期存款	-
其他存款	-
合计	34,396,185.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		561,238,011.73	677,021,052.62	115,783,040.89
债券	交易所市场	73,000.00	80,743.11	7,743.11
	银行间市场	29,954,610.00	29,985,000.00	30,390.00
	合计	30,027,610.00	30,065,743.11	38,133.11
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		591,265,621.73	707,086,795.73	115,821,174.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,165.04
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	425.60
应收债券利息	860,047.85
应收买入返售证券利息	18,666.67
应收申购款利息	0.36
其他	74.70
合计	885,380.22

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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	375,729.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	375,729.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,732.14
预提费用	210,255.03
其他应付款	12,170.50

合计	225,157.67
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	855,801,500.64	716,744,468.36
本期申购	17,490,082.05	14,647,558.67
本期赎回（以“-”号填列）	-128,294,803.48	-107,444,795.39
本期末	744,996,779.21	623,947,231.64

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	-24,057,667.17	45,562,258.99	21,504,591.82
本期利润	30,028,745.92	74,872,699.79	104,901,445.71
本期基金份额交易产生的变动数	1,247,668.44	-20,852,698.92	-19,605,030.48
其中：基金申购款	-255,802.66	2,874,048.48	2,618,245.82
基金赎回款	1,503,471.10	-23,726,747.40	-22,223,276.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,218,747.19	99,582,259.86	106,801,007.05

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	203,757.98
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	6,375.45
其他	1,164.79
合计	211,298.22

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	443,106,583.49
减：卖出股票成本总额	412,022,832.93
买卖股票差价收入	31,083,750.56

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	27,383,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,475,861.19
减：应收利息总额	1,198,452.04
债券投资收益	-291,113.23

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,359,135.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,359,135.09

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	74,872,699.79
——股票投资	74,701,514.90
——债券投资	171,184.89
——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	74,872,699.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	162,110.55
合计	162,110.55

注：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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	1,348,292.42
银行间市场交易费用	-
合计	1,348,292.42

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	31,736.54
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	3,842.81
债券账户服务费	18,000.00
证书费	400.00
合计	232,497.84

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

本基金管理人于 2013 年 5 月 31 日发布《国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告》，本基金管理人获批设立子公司国泰元鑫资产管理有限公司，注册资本为 5000 万元人民币。本基金管理人持有 50%的股权，中投信托有限责任公司和上海津赞投资管理有限公司分别持有 30%和 20%的股权。国泰元鑫资产管理有限公司已在上海市工商行政管理局虹口分局完成工商注册登记，取得营业执照。

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	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
宏源证券股份有限公司（“宏源证券”）	基金代销机构、受基金管理人的控股股东(中国建投)控制的公司

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
宏源证券	294,857,492.81	33.21%	-	-

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
宏源证券	50,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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
宏源证券	268,437.63	33.48%	125,167.21	33.31%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
-	-	-	-	-

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,878,475.35	5,542,862.37

其中：支付销售机构的客户维护费	941,361.89	922,194.23
-----------------	------------	------------

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	979,745.85	923,810.37

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 0.25% / 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

份额单位：份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	56,611,737.00	56,611,737.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额	46,611,737.00	56,611,737.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.26%	6.60%

注：关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国建设银行	34,396,185.55	203,757.98	26,709,256.94	224,480.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

无。

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

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2013 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
002051	中工国际	2012-12-26	2013-12-28	非公开发行	20.22	23.80	455,391	9,208,006.02	10,838,305.80	-

注：基金可作为特定投资者，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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600335	国机汽车	2013-03-25	重大资产重组	11.55	2013-07-01	13.99	4,000,849	49,225,516.09	46,209,805.95	-
300027	华谊兄弟	2013-06-05	重大事项	28.55	2013-07-24	31.41	600,000	9,222,807.63	17,130,000.00	-

注：本基金截至 2013 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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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“长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金”的风险收益目标。

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。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建设银行，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 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2012 年 12 月 31 日：1.39%）。

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，其余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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以	不计息	合计
-----	-------	-------	------	-----	----

2013 年 6 月 30 日			上		
资产					
银行存款	34,396,185.55	-	-	-	34,396,185.55
结算备付金	945,751.68	-	-	-	945,751.68
存出保证金	166,061.07	-	-	-	166,061.07
交易性金融资产	29,985,000.00	80,743.11	-	677,021,052.62	707,086,795.73
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	885,380.22	885,380.22
应收申购款	-	-	-	74,438.00	74,438.00
资产总计	75,492,998.30	80,743.11	-	677,980,870.84	753,554,612.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19,786,443.78	19,786,443.78
应付赎回款	-	-	-	724,970.75	724,970.75
应付管理人报酬	-	-	-	966,799.17	966,799.17
应付托管费	-	-	-	161,133.18	161,133.18
应付交易费用	-	-	-	375,729.85	375,729.85
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利润	-	-	-	279,108.68	279,108.68
其他负债	-	-	-	225,157.67	225,157.67
负债总计	-	-	-	22,806,373.56	22,806,373.56
利率敏感度缺口	75,492,998.30	80,743.11	-	655,174,497.28	730,748,238.69
上年度末 2012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	87,378,737.16	-	-	-	87,378,737.16
结算备付金	475,946.42	-	-	-	475,946.42
存出保证金	-	-	-	827,800.70	827,800.70
交易性金融资产	56,115,400.00	91,019.41	-	569,513,031.63	625,719,451.04
买入返售金融资产	58,200,242.30	-	-	-	58,200,242.30
应收利息	-	-	-	1,410,186.00	1,410,186.00
应收申购款	890.22	-	-	41,509.11	42,399.33

资产总计	202,171,216.10	91,019.41	-	571,792,527.44	774,054,762.95
负债					
应付证券清算款	-	-	-	32,564,157.06	32,564,157.06
应付赎回款	-	-	-	1,046,462.72	1,046,462.72
应付管理人报酬	-	-	-	815,791.76	815,791.76
应付托管费	-	-	-	135,965.26	135,965.26
应付交易费用	-	-	-	201,072.65	201,072.65
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利润	-	-	-	279,108.68	279,108.68
其他负债	-	-	-	476,114.16	476,114.16
负债总计	-	-	-	35,805,702.77	35,805,702.77
利率敏感度缺口	202,171,216.10	91,019.41	-	535,986,824.67	738,249,060.18

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 2013 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 4.11%(2012 年 12 月 31 日：7.61%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2012 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%。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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	677,021,052.62	92.65	569,513,031.63	77.14
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	677,021,052.62	92.65	569,513,031.63	77.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基准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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	45%天相中盘+55%天相小盘上升5%	增加约2,959	增加约2,886
	45%天相中盘+55%天相小盘下降5%	减少约2,959	减少约2,886

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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 602,923,683.98 元，属于第二层级的余额为 104,163,111.75 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 553,065,236.37 元，第二层级 72,654,214.67 元，无第三层级)。

(iii) 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和债券，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，本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	677,021,052.62	89.84
	其中：股票	677,021,052.62	89.84

2	固定收益投资	30,065,743.11	3.99
	其中：债券	30,065,743.11	3.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	1.33
	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	35,341,937.23	4.69
6	其他各项资产	1,125,879.29	0.15
7	合计	753,554,612.25	100.00

7.2 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	17,426,536.00	2.38
C	制造业	301,887,772.38	41.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,935,600.00	1.36
E	建筑业	124,457,391.62	17.03
F	批发和零售业	46,209,805.95	6.32
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	17,436,119.80	2.39
J	金融业	1,764,100.00	0.24
K	房地产业	24,053,264.04	3.29
L	租赁和商务服务业	92,139,226.20	12.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,060,800.00	0.15
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	38,162,442.85	5.22
S	综合	2,487,993.78	0.34
	合计	677,021,052.62	92.65

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

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	300058	蓝色光标	1,698,718	70,836,540.60	9.69
2	300147	香雪制药	2,991,138	50,191,295.64	6.87
3	600335	国机汽车	4,000,849	46,209,805.95	6.32
4	002140	东华科技	1,760,000	43,665,600.00	5.98
5	600572	康恩贝	3,439,437	38,143,356.33	5.22
6	300043	星辉车模	3,540,000	37,665,600.00	5.15
7	601117	中国化学	3,780,801	35,993,225.52	4.93
8	300055	万邦达	868,353	33,952,602.30	4.65
9	600660	福耀玻璃	4,389,500	31,560,505.00	4.32
10	002022	科华生物	1,660,708	24,595,085.48	3.37
11	601928	凤凰传媒	2,500,885	21,032,442.85	2.88
12	601888	中国国旅	631,764	18,447,508.80	2.52
13	300027	华谊兄弟	600,000	17,130,000.00	2.34
14	000731	四川美丰	1,772,483	14,729,333.73	2.02
15	300075	数字政通	507,506	14,362,419.80	1.97
16	600073	上海梅林	2,145,954	13,369,293.42	1.83
17	600887	伊利股份	420,915	13,166,221.20	1.80
18	300157	恒泰艾普	379,200	13,112,736.00	1.79
19	000049	德赛电池	209,913	12,594,780.00	1.72
20	002051	中工国际	455,391	10,838,305.80	1.48
21	000725	京东方 A	4,800,000	10,656,000.00	1.46
22	002028	思源电气	609,874	9,593,318.02	1.31
23	000669	金鸿能源	240,000	9,081,600.00	1.24
24	300195	长荣股份	366,600	8,178,846.00	1.12
25	600383	金地集团	1,100,000	7,546,000.00	1.03
26	000024	招商地产	299,983	7,283,587.24	1.00
27	002567	唐人神	920,000	6,946,000.00	0.95
28	002005	德豪润达	743,992	6,919,125.60	0.95
29	600703	三安光电	299,969	5,891,391.16	0.81
30	600894	广日股份	700,000	5,614,000.00	0.77
31	000002	万科 A	500,000	4,925,000.00	0.67
32	600067	冠城大通	500,000	3,995,000.00	0.55
33	600600	青岛啤酒	87,960	3,340,720.80	0.46
34	603000	人民网	70,000	3,073,700.00	0.42
35	300178	腾邦国际	169,951	2,855,176.80	0.39

36	000012	南 玻 A	300,000	2,781,000.00	0.38
37	600149	廊坊发展	399,999	2,487,993.78	0.34
38	300164	通源石油	160,000	2,372,800.00	0.32
39	000716	南方食品	170,000	2,091,000.00	0.29
40	600583	海油工程	300,000	1,941,000.00	0.27
41	002007	华兰生物	80,000	1,806,400.00	0.25
42	600369	西南证券	230,000	1,764,100.00	0.24
43	002672	东江环保	30,000	1,060,800.00	0.15
44	300124	汇川技术	30,000	1,049,700.00	0.14
45	600885	宏发股份	80,000	1,004,800.00	0.14
46	600509	天富热电	100,000	854,000.00	0.12
47	002244	滨江集团	36,152	303,676.80	0.04
48	002310	东方园林	200	7,658.00	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	601117	中国化学	35,406,269.16	4.80
2	002022	科华生物	24,255,333.42	3.29
3	601928	凤凰传媒	21,588,359.74	2.92
4	300195	长荣股份	16,798,932.22	2.28
5	300027	华谊兄弟	15,374,620.14	2.08
6	002479	富春环保	15,301,526.39	2.07
7	600073	上海梅林	14,945,997.36	2.02
8	600572	康恩贝	14,700,504.67	1.99
9	002106	莱宝高科	13,302,393.82	1.80
10	600887	伊利股份	12,925,749.25	1.75
11	000725	京东方 A	12,244,573.00	1.66
12	300075	数字政通	11,386,777.47	1.54
13	300157	恒泰艾普	10,544,352.08	1.43
14	000830	鲁西化工	9,928,467.27	1.34
15	600345	长江通信	9,153,956.00	1.24
16	000049	德赛电池	8,821,835.13	1.19
17	000731	四川美丰	8,571,843.59	1.16
18	002028	思源电气	8,209,788.10	1.11
19	600498	烽火通信	8,120,116.75	1.10
20	002275	桂林三金	7,871,541.10	1.07

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	300058	蓝色光标	35,310,636.13	4.78
2	600660	福耀玻璃	27,929,620.06	3.78
3	000069	华侨城 A	22,190,546.80	3.01
4	600489	中金黄金	17,998,958.85	2.44
5	002479	富春环保	17,487,237.21	2.37
6	002398	建研集团	15,617,136.55	2.12
7	002430	杭氧股份	15,076,977.28	2.04
8	002106	莱宝高科	13,169,276.90	1.78
9	600141	兴发集团	13,129,424.29	1.78
10	600697	欧亚集团	11,271,025.82	1.53
11	300027	华谊兄弟	10,875,125.96	1.47
12	002311	海大集团	10,813,444.79	1.46
13	600060	海信电器	10,299,540.33	1.40
14	002567	唐人神	10,120,526.95	1.37
15	600345	长江通信	9,476,841.48	1.28
16	000830	鲁西化工	9,358,003.82	1.27
17	600498	烽火通信	9,254,488.60	1.25
18	601166	兴业银行	8,940,000.00	1.21
19	600547	山东黄金	8,841,826.04	1.20
20	601117	中国化学	8,641,457.66	1.17

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	444,829,339.02
卖出股票的收入（成交）总额	443,106,583.49

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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	29,985,000.00	4.10
	其中：政策性金融债	29,985,000.00	4.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	80,743.11	0.01
8	其他	-	-
9	合计	30,065,743.11	4.11

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	120228	12 国开 28	300,000	29,985,000.00	4.10
2	125887	中鼎转债	730	80,743.11	0.01

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种

选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	166,061.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	885,380.22
5	应收申购款	74,438.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,125,879.29

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	125887	中鼎转债	80,743.11	0.01

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600335	国机汽车	46,209,805.95	6.32	重大资产重组

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
20,926	35,601.49	180,820,057.44	24.27%	564,176,721.77	75.73%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国泰基金管理有限公司	26,583,337.00	30.69%
2	广州市科技进步基金会	2,000,000.00	2.31%
3	姜桂敏	1,140,136.00	1.32%
4	厦门市一帆科技有限公司	1,000,060.00	1.15%
5	关展辉	1,000,000.00	1.15%
6	郭建华	940,562.00	1.09%
7	吴芳	448,406.00	0.52%
8	黄城	400,230.00	0.46%
9	姜登斌	389,215.00	0.45%
10	邓敏宪	338,270.00	0.39%

注：上述份额均为场内份额，持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,161,827.25	0.16%

注：1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）；

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 10 月 19 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	855,801,500.64
本报告期基金总申购份额	17,490,082.05
减：本报告期基金总赎回份额	128,294,803.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	744,996,779.21

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：

2013 年 3 月 6 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》刊登了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十四次会议审议通过，同意梁之平先生因工作需要离职。

2013 年 6 月 25 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高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过，同意李志坚先生出任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关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	
国泰君安	2	92,731,649.75	10.44%	82,234.01	10.26%	-
海通证券	2	214,925,098.56	24.21%	192,892.07	24.06%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	183,937,453.03	20.72%	165,717.42	20.67%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	27,430,050.59	3.09%	24,972.54	3.12%	-
国金证券	1	74,054,177.77	8.34%	67,419.58	8.41%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	294,857,492.81	33.21%	268,437.63	33.48%	-

注：1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，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），并经公司批准。

2、本期退租东莞证券 1 个席位。

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	20,800.00	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-

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》	2013-03-14
2	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》	2013-04-01
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》	2013-04-17
4	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-04-26

5	国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、《证券日报》	2013-05-31
6	国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2013-06-14
7	国泰基金管理有限公司关于赎回旗下国泰中小盘成长股票型证券投资基金的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2013-06-20

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于同意国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)募集的批复
- 2、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同
- 3、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)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——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

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
二〇一三年八月二十四日