

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年三月三十一日

§ 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 2014 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务材料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	579,897,683.16 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	姓名	林海中	田青

负责人	联系电话	021-31081600转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	010-67595096
传真		021-31081800	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	167,330,201.54	-53,508,466.08	-90,667,560.53
本期利润	211,042,948.24	1,879,883.79	-312,867,889.80
加权平均基金份额本期利润	0.2884	0.0022	-0.2248
本期基金份额净值增长率	30.13%	0.70%	-21.74%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2220	-0.0281	0.0195
期末基金资产净值	651,505,707.81	738,249,060.18	786,238,867.24
期末基金份额净值	1.123	0.863	0.857

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
过去三个月	-8.10%	1.44%	-2.50%	1.04%	-5.60%	0.40%
过去六个月	14.48%	1.53%	10.88%	1.06%	3.60%	0.47%
过去一年	30.13%	1.47%	9.93%	1.09%	20.20%	0.38%
过去三年	2.56%	1.30%	-18.92%	1.16%	21.48%	0.14%
自基金合同生效起至今	21.89%	1.28%	-1.50%	1.23%	23.39%	0.05%

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)

自基金转型以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009 年 10 月 19 日至 2013 年 12 月 31 日)

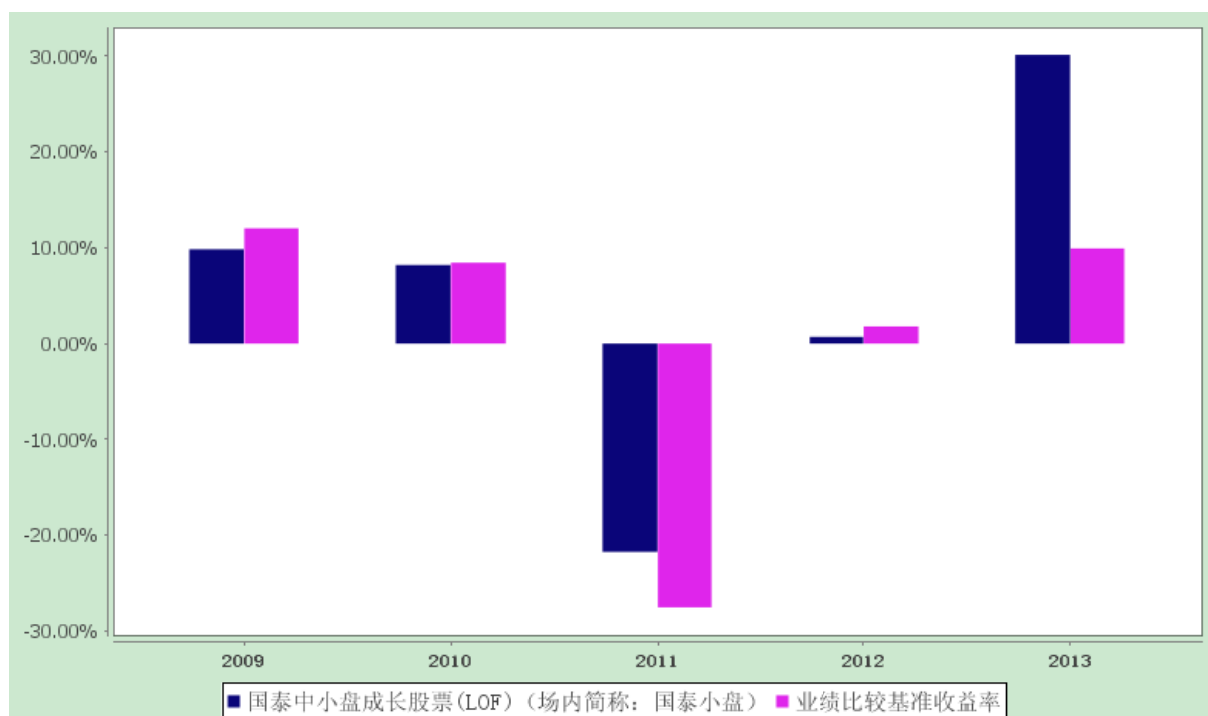


注：本基金的转型日为 2009 年 10 月 19 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：2009 年图示的指标计算期间为基金转型日 2009 年 10 月 19 日至 2009 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 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 42 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、国泰国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、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、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)。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、权益投资	2009-10-19	-	14	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

	总监				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 月至 2014 年 3 月任研究部总监。2011 年 6 月至 2012 年 2 月任公司投资副总监，2012 年 2 月至 2014 年 3 月任公司投资总监，2014 年 3 月起任权益投资总监。
周伟锋	本基金的基金经理、金鹰增长股票基金的基金经理助理	2013-06-13	-	6	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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 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）本基金管理人所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。

4.3.3 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

2013 年国内的宏观经济运行相对平稳，全年来看，GDP 的增速与年初的预期也基本一致，通胀也控制在一个相对较为合理的区间。与相对平稳的经济表现不完全一致的是，股市在 2013 年的表现有了非常大的分化。上证指数以全年下跌 6.75%收盘，并在年中创出了 4 年以来的新低，而代表经济结构转型方向、成长股的代表—创业板指数则在 2013 年持续创出新高，全年以上涨 82.73%的涨幅收盘，其间的差异在 A 股历史上也较为罕见！行业表现的分化更为明显，符合经济结构转型以及新的经济方式的传媒、信息服务、环保等行业大幅上涨的同时，与经济结构转型相对受损的煤炭、有色等行业则出现了大幅下跌。

从本基金 2013 年的操作来看，基于我们对宏观经济以及经济结构转型的预判，一方面我们保持了相对较为积极的策略，维持了相对较积极的股票仓位配置。另一方面，在配置结构上，我们着重在符合经济结构转型方向的行业与公司中进行了布局，在传媒、信息服务等基本面向好的行业中进

行了重点布局，因此，本基金在今年获得了相对较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2013 年度净值增长率为 30.13%，同期业绩比较基准为 9.93%。

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，我们认为弱复苏的局面仍将持续。对于 2014 年，我们在宏观经济方面重点关注的是信托类资产的风险释放，预计在上半年存在一定的压力。随着十八届三中全会的召开，政府的改革决心大家都已经看到，我们相信政府会把更多地精力将投放在市场效率改善，民生、生活环境等的提高，包括国有企业改革，土地流转方面的改革，一方面会使得相关企业获益，其最大的功效将是促进整个国家资源配置更加合理，经济运行更加有效。同时，随着居民生活水平的提高，经济结构的转型也正在自发地进行，消费在经济中的重要性会越来越高。此外，随着移动互联网等先进技术逐渐融入老百姓的生活，使得社会效率得到一定的提高，也推动了很多传统行业的变革。

对于证券市场而言，我们判断未来一段时间内仍将是结构性行情为主。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。短期来看这些行业与公司估值相对较高，我们仍将保持适度谨慎，仔细甄别，耐心寻找更好的买入时机。与此同时，我们也会继续关注那些估值更为合理，受益于技术创新的传统行业与公司。

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 审计报告

本基金 2013 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：	-	-
银行存款	43,538,289.81	87,378,737.16
结算备付金	1,044,181.39	475,946.42
存出保证金	164,443.16	827,800.70
交易性金融资产	579,109,333.05	625,719,451.04
其中：股票投资	579,109,333.05	569,513,031.63
基金投资	-	-
债券投资	-	56,206,419.41
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	24,970,229.96	58,200,242.30
应收证券清算款	6,132,040.50	-
应收利息	19,995.26	1,410,186.00
应收股利	-	-
应收申购款	98,198.82	42,399.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	655,076,711.95	774,054,762.95
负债和所有者权益	本期末 2013 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	32,564,157.06

应付赎回款	1,279,427.73	1,046,462.72
应付管理人报酬	838,947.47	815,791.76
应付托管费	139,824.57	135,965.26
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	665,672.97	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	80,992.24	476,114.16
负债合计	3,571,004.14	35,805,702.77
所有者权益：	—	—
实收基金	485,683,767.66	716,744,468.36
未分配利润	165,821,940.15	21,504,591.82
所有者权益合计	651,505,707.81	738,249,060.18
负债和所有者权益总计	655,076,711.95	774,054,762.95

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.123 元，基金份额总额 579,897,683.16 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	228,169,625.85	17,217,376.84
1. 利息收入	1,494,918.30	2,605,140.51
其中：存款利息收入	467,262.07	456,812.95
债券利息收入	874,804.14	1,892,226.41

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	152,852.09	256,101.15
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	182,495,726.76	-40,924,596.41
其中：股票投资收益	175,314,232.23	-48,220,847.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-232,476.75	572,384.24
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,413,971.28	6,723,866.35
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	43,712,746.70	55,388,349.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	466,234.09	148,482.87
减：二、费用	17,126,677.61	15,337,493.05
1. 管理人报酬	11,383,739.94	10,668,503.49
2. 托管费	1,897,289.89	1,778,083.88
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,376,042.16	2,374,708.64
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	469,605.62	507,821.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	211,042,948.24	1,879,883.79
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	211,042,948.24	1,879,883.79

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	-	211,042,948.24	211,042,948.24
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）	-231,060,700.70	-66,725,599.91	-297,786,300.61
其中：1. 基金申购款	43,021,150.99	13,763,123.88	56,784,274.87
2. 基金赎回款	-274,081,851.69	-80,488,723.79	-354,570,575.48
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）	485,683,767.66	165,821,940.15	651,505,707.81
项目	上年度可比期间		
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	-	1,879,883.79	1,879,883.79
三、本期基金份额交易	-51,616,563.01	1,746,872.16	-49,869,690.85

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	68,596,408.27	301,810.48	68,898,218.75
2. 基金赎回款	-120,212,971.28	1,445,061.68	-118,767,909.60
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）	716,744,468.36	21,504,591.82	738,249,060.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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：张琼，会计机构负责人：王嘉浩

7.4 报表附注

7.4.1 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 2011 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 2014 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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》、《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 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, 股权的股息、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。

(3) 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。自 2013 年 1 月 1 日起, 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, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
宏源证券股份有限公司(“宏源证券”)	基金代销机构、受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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
宏源证券	341,941,446.69	15.94%	86,740,844.25	5.67%

7.4.8.1.2 权证交易

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权证交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年12月31日		2012年1月1日至2012年12月31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	26.04%	-	-

7.4.8.1.4 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12月31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	311,302.66	16.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2012年1月1日至2012年12月31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	75,812.00	5.78%	-	-

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,383,739.94	10,668,503.49
其中：支付销售机构的客户维护费	1,767,250.12	1,798,366.98

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,897,289.89	1,778,083.88

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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2013年1月1日至2013年12月31 日	2012年1月1日至2012年12月31 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	33,300,000.00	-
期末持有的基金份额	23,311,737.00	56,611,737.00
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	4.02%	6.62%

注：基金管理人国泰基金管理有限公司在本年度赎回本基金的场内份额 3,271,600.00 份的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理，适用费率为 0.50%；赎回本基金的场外交易份额 30,028,400.00 份的交易委托中国建设银行办理，适用费率为 0.50%

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	43,538,289.81	449,155.40	87,378,737.16	442,435.46

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。

7.4.8.6 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有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
600572	康恩贝	2013-11-25	重大资产重组	13.51	-	-	1,400,000.00	15,133,288.40	18,914,000.00	-
300010	立思辰	2013-12-05	重大资产重组	11.88	2014-03-05	13.07	299,901.00	3,220,278.57	3,562,823.88	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有卖出回购金融资产。

7.4.10 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) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 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级的余额为 556,632,509.17 元，属于第二层级的余额为 22,476,823.88 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) 公允价值所属层级间的重大变动

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还是第三层级。

(iv) 第三层级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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	579,109,333.05	88.40
	其中：股票	579,109,333.05	88.40
2	固定收益投资	—	—

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	24,970,229.96	3.81
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	44,582,471.20	6.81
7	其他各项资产	6,414,677.74	0.98
8	合计	655,076,711.95	100.00

8.2 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	6,825,500.00	1.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	302,438,291.18	46.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,830,728.40	3.50
E	建筑业	49,670,859.40	7.62
F	批发和零售业	94,886,726.17	14.56
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	28,675,307.50	4.40
J	金融业	1,521,000.00	0.23
K	房地产业	6,201,500.00	0.95
L	租赁和商务服务业	54,390,000.00	8.35

M	科学研究和技术服务业	10,203,920.40	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	1,465,500.00	0.22
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	579,109,333.05	88.89

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300147	香雪制药	2,991,138	55,635,166.80	8.54
2	600335	国机汽车	4,271,562	55,487,590.38	8.52
3	300058	蓝色光标	1,050,000	54,390,000.00	8.35
4	600660	福耀玻璃	3,889,500	32,243,955.00	4.95
5	300043	星辉车模	1,720,925	30,684,092.75	4.71
6	300197	铁汉生态	930,436	25,354,381.00	3.89
7	601933	永辉超市	1,650,929	21,940,846.41	3.37
8	600079	人福医药	716,435	20,310,932.25	3.12
9	600401	海润光伏	2,449,161	19,201,422.24	2.95
10	600572	康恩贝	1,400,000	18,914,000.00	2.90

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	38,831,821.16	5.26
2	300197	铁汉生态	27,345,578.14	3.70
3	002022	科华生物	24,255,333.42	3.29

4	601928	凤凰传媒	22,709,859.74	3.08
5	600401	海润光伏	21,486,812.43	2.91
6	601933	永辉超市	20,983,169.28	2.84
7	600079	人福医药	20,802,258.71	2.82
8	300195	长荣股份	18,924,132.22	2.56
9	300212	易华录	16,313,506.10	2.21
10	600073	上海梅林	16,260,922.46	2.20
11	300027	华谊兄弟	15,374,620.14	2.08
12	002479	富春环保	15,301,526.39	2.07
13	600880	博瑞传播	15,112,723.45	2.05
14	600887	伊利股份	15,027,408.25	2.04
15	600572	康恩贝	14,700,504.67	1.99
16	000673	当代东方	14,453,075.62	1.96
17	601299	中国北车	13,880,230.65	1.88
18	600016	民生银行	13,658,973.92	1.85
19	600383	金地集团	13,328,186.04	1.81
20	002106	莱宝高科	13,302,393.82	1.80

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	70,484,601.12	9.55
2	002140	东华科技	53,099,370.07	7.19
3	300027	华谊兄弟	49,409,661.97	6.69
4	300043	星辉车模	45,591,545.72	6.18
5	601117	中国化学	34,861,893.95	4.72
6	601928	凤凰传媒	33,884,534.07	4.59
7	600660	福耀玻璃	31,730,120.06	4.30
8	300055	万邦达	29,106,650.44	3.94
9	002022	科华生物	26,178,648.38	3.55
10	600572	康恩贝	25,365,878.69	3.44
11	601888	中国国旅	22,969,891.03	3.11
12	000069	华侨城 A	22,190,546.80	3.01
13	300195	长荣股份	19,254,445.12	2.61
14	300157	恒泰艾普	18,254,888.30	2.47
15	600489	中金黄金	17,998,958.85	2.44
16	002479	富春环保	17,487,237.21	2.37

17	600880	博瑞传播	17,058,937.35	2.31
18	002567	唐人神	17,054,835.78	2.31
19	002398	建研集团	15,617,136.55	2.12
20	002430	杭氧股份	15,076,977.28	2.04
21	600016	民生银行	14,985,060.79	2.03
22	000731	四川美丰	14,839,398.54	2.01
23	600073	上海梅林	14,837,133.23	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	967,915,489.88
卖出股票的收入（成交）总额	1,177,213,115.61

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

8.5 期末按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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

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

8.11.3 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	164,443.16
2	应收证券清算款	6,132,040.50
3	应收股利	-
4	应收利息	19,995.26
5	应收申购款	98,198.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,414,677.74

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600572	康恩贝	18,914,000.00	2.90	重大资产

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
17,239	33,638.71	156,519,997.44	26.99%	423,377,685.72	73.01%

9.2 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	23,311,737.00	31.73%
2	广州市科技进步基金会	2,000,000.00	2.72%
3	郭建华	799,156.00	1.09%
4	曹秀山	527,869.00	0.72%
5	吴芳	448,406.00	0.61%
6	黄城	400,230.00	0.54%
7	姜登斌	389,215.00	0.53%
8	邓敏宪	338,270.00	0.46%
9	李清	304,021.00	0.41%
10	涂小山	300,063.00	0.41%

注：上述份额均为场内份额，持有人均为场内持有人。

9.3 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	988,776.85	0.17%

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份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

§ 10 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
报告期期间基金总申购份额	51,362,406.28
减：报告期期间基金总赎回份额	327,266,223.76
报告期期间基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	579,897,683.16

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 6 月 25 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，李志坚先生出任公司副总经理。

2013 年 11 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任职公告》，经本基金管理人第五届董事会第三十三次会议审议通过，贺燕萍女士出任公司副总经理。

2013 年 11 月 27 日，经本基金管理人股东会 2013 年第五次临时会议审议通过，原董事 Philippe SEBTON 先生、吴鹏先生任期已满，不再担任公司董事职务，选举 Santo BORSELLINO 先生为公司第六届董事会董事。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总

经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 64,000.00 元，目前的审计机构已提供服务的年限为 4 年。

11.6 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、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
银河证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	843,254,866.65	39.31%	764,924.31	39.30%	-
国金证券	1	481,946,615.36	22.47%	438,762.82	22.54%	-
宏源证券	1	341,941,446.69	15.94%	311,302.66	16.00%	-
兴业证券	2	294,612,032.85	13.73%	266,475.72	13.69%	-
国泰君安	2	98,366,931.55	4.59%	87,364.45	4.49%	-
民族证券	1	44,578,014.86	2.08%	40,583.33	2.09%	-
中航证券	1	27,430,050.59	1.28%	24,972.54	1.28%	-
申银万国	1	12,998,646.94	0.61%	11,834.01	0.61%	-

注：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。

11.7.2 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
银河证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	86,578.00	80.63%	57,000,000.00	29.69%	-	-
国金证券	-	-	55,000,000.00	28.65%	-	-
宏源证券	-	-	50,000,000.00	26.04%	-	-
兴业证券	20,800.00	19.37%	30,000,000.00	15.63%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-