

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

2015 年半年度报告摘要

2015 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：二〇一五年八月二十八日

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 2015 年 8 月 24 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。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的约定，本基金自 2015 年 8 月 8 日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”修改为“国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金合同部分条款相应修订。具体请查阅本公司于 2015 年 7 月 23 日披露的《关于修订国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同的公告》。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	178,506,202.41 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分析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	021-31081600转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqing1.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

登载基金半年度报告摘要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 层北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
--	-----------------------------------

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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	474,796,769.45
本期利润	345,235,124.84
加权平均基金份额本期利润	1.0004
本期基金份额净值增长率	64.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	1.5075
期末基金资产净值	418,615,715.88
期末基金份额净值	2.345

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

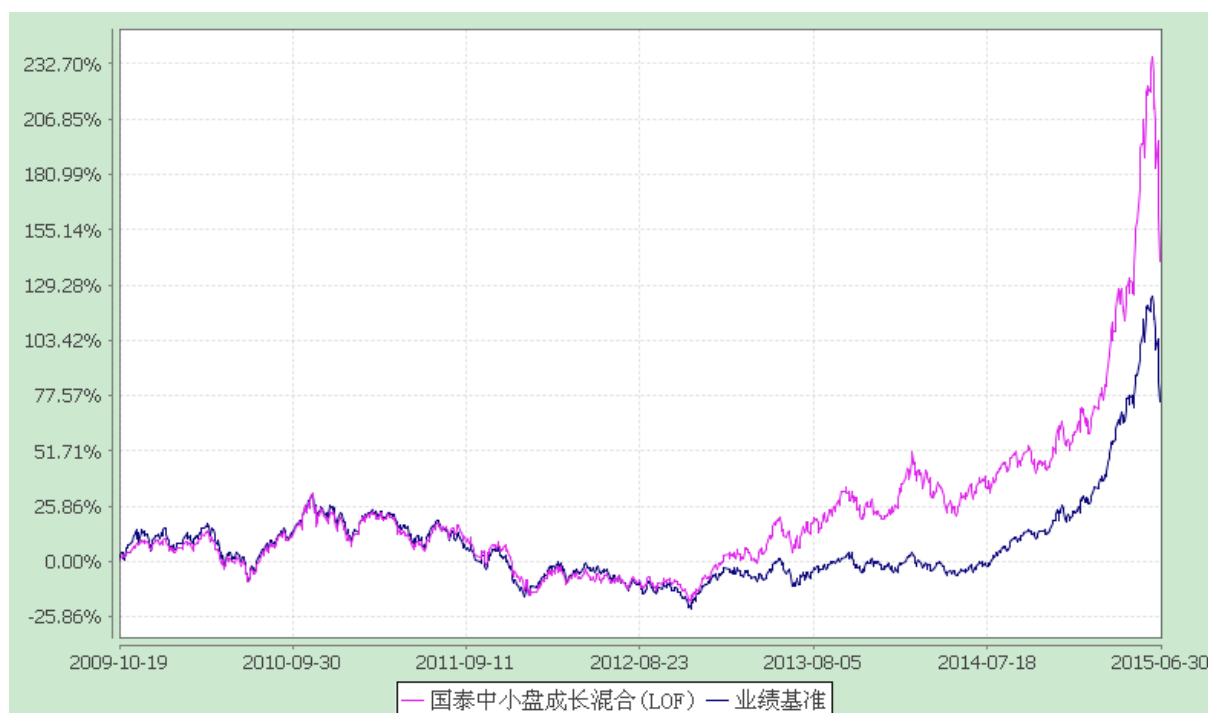
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-12.57%	4.20%	-10.86%	2.95%	-1.71%	1.25%
过去三个月	22.58%	3.18%	16.58%	2.24%	6.00%	0.94%
过去六个月	64.91%	2.54%	52.64%	1.77%	12.27%	0.77%
过去一年	86.85%	1.99%	85.52%	1.39%	1.33%	0.60%
过去三年	180.50%	1.63%	97.85%	1.19%	82.65%	0.44%
自基金合同生效起至今	154.53%	1.46%	82.87%	1.24%	71.66%	0.22%

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)

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 2015 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 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 54 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)、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、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、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、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、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、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金。

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		
杨飞	本基金的基金	2015-05-11	-	7 年	硕士研究生。2008 年 7 月至 2009

	经理、国泰金龙行业混合、国泰估值优势股票（LOF）、国泰成长优选股票的基金经理				年 8 月在诺德基金管理有限公司任助理研究员,2009年9月至2011年 2 月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011 年 2 月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理,2015 年 3 月起兼任国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）的基金经理,2015 年 5 月起兼任国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）和国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理。
张玮	本基金的基金经理	2009-10-19	2015-05-11	15 年	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 月至 2015 年 5 月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 月至 2015 年 5 月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 月至 2015 年 5 月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 月兼任公司投资副总监,2012 年 2 月至 2014 年 3 月兼任公司投资总监,2014 年 3 月至 2015 年 5 月任权益投资总监。

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

2015 年在流动性宽松以及杠杆资金入市的背景下，A 股市场出现了大幅震荡。2015 年前 5 月在加杠杆资金的推动下，A 股市场走出了单边牛市，以创业板为代表的新兴行业超额收益明显，但随着政府清查场外配资带来的去杠杆过程导致 A 股市场在 6 月出现了大幅下跌。市场经过大幅调整后，新兴行业中真成长的公司未来将获得明显的绝对收益与相对收益。

今年上半年宏观经济增速在低位运行，经济结构面临调整，因此传统经济行业投资机会不大，但以新兴行业为代表的转型行业出现整体性的投资机会。上半年计算机、传媒、电子、医药等新兴行业出现了明显的超额收益。随着年中去资金杠杆过程的结束，市场的风险偏好将会明显下降，业绩突出、估值合理的新兴成长股将会在市场调整后脱颖而出。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2015 年上半年净值增长率为 64.91%，同期业绩比较基准收益率为 52.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，短期业绩、长期价值、合理估值将是投资过程中最重要考虑的因素。从投资方向上看，铁路信息化与铁路后市场、金融 IT、军民融合、消费电子将是基金下半年主要布局的领域。

由于市场缺乏新增资金，存量资金的博弈必然导致市场的波动加大，因此基金下半年将保持合理的仓位灵活操作。

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、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, 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: 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	89,716,836.05	26,782,146.73
结算备付金	2,460,186.65	1,881,779.59
存出保证金	396,652.14	261,531.96
交易性金融资产	393,103,140.67	592,209,557.95
其中：股票投资	393,103,140.67	572,219,557.95
基金投资	-	-
债券投资	-	19,990,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	10,817,469.05
应收利息	10,269.13	403,014.87
应收股利	-	-
应收申购款	465,298.01	173,505.62
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	486,152,382.65	632,529,005.77
负债和所有者权益	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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	3,447,132.12	-
应付赎回款	59,846,110.43	2,709,457.24
应付管理人报酬	736,867.51	852,916.64
应付托管费	122,811.26	142,152.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,655,173.92	1,388,401.63
应交税费	-	-
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	449,462.85	99,381.56
负债合计	67,536,666.77	5,471,418.55
所有者权益：	-	-
实收基金	149,524,566.83	369,359,835.85

未分配利润	269,091,149.05	257,697,751.37
所有者权益合计	418,615,715.88	627,057,587.22
负债和所有者权益总计	486,152,382.65	632,529,005.77

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.345 元，基金份额总额 178,506,202.41 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	357,084,587.14	82,405,946.28
1.利息收入	329,811.26	347,975.37
其中：存款利息收入	186,304.41	328,780.53
债券利息收入	143,506.85	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	19,194.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	485,472,905.27	-4,374,739.96
其中：股票投资收益	481,430,483.49	-10,153,212.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	138,000.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,904,421.78	5,778,472.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-129,561,644.61	86,143,430.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	843,515.22	289,280.33
减：二、费用	11,849,462.30	8,390,248.27
1. 管理人报酬	4,921,592.50	5,503,786.87
2. 托管费	820,265.46	917,297.79
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,868,900.80	1,729,681.60
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	238,703.54	239,482.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	345,235,124.84	74,015,698.01
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	345,235,124.84	74,015,698.01

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	369,359,835.85	257,697,751.37	627,057,587.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	345,235,124.84	345,235,124.84
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）	-219,835,269.02	-333,841,727.16	-553,676,996.18
其中：1.基金申购款	41,258,617.76	79,848,732.73	121,107,350.49
2.基金赎回款	-261,093,886.78	-413,690,459.89	-674,784,346.67
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）	149,524,566.83	269,091,149.05	418,615,715.88
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	485,683,767.66	165,821,940.15	651,505,707.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,015,698.01	74,015,698.01
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）	44,962,428.99	24,901,726.90	69,864,155.89
其中：1.基金申购款	199,171,444.85	102,099,637.37	301,271,082.22
2.基金赎回款	-154,209,015.86	-77,197,910.47	-231,406,926.33
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	530,646,196.65	264,739,365.06	795,385,561.71

金净值)			
------	--	--	--

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：张峰，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王嘉浩

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 2015 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 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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与最近一期年度报告相一致,会计估计较最近一期年度报告有变更。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.2 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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内,申银万国证券股份有限公司吸收合并了基金管理人原关联方宏源证券股份有限公

司，并更名为申万宏源集团股份有限公司（以下简称“申万宏源”）。根据股权比例，申万宏源仍然为基金管理人控股股东中国建银投资有限责任公司的控股子公司。

6.4.7.2 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、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	300,404,906.19	8.15%	-	-

6.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
申万宏源	-	-	-	-

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	273,488.33	8.15%	273,488.33	10.30%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	-	-	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,921,592.50	5,503,786.87
其中：支付销售机构的客户维护费	586,516.27	754,539.29

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	820,265.46	917,297.79

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2015年1月1日至2015年6月30 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
期初持有的基金份额	23,311,737.00	23,311,737.00
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	13,311,737.00	23,311,737.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	7.46%	3.68%

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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	89,716,836.05	162,954.34	104,325,615.58	313,498.15

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
600401	*ST 海润	2014-09-16	2015-09-14	非公开发行	7.72	3.82	1,500,000.00	11,580,000.00	5,730,000.00	-
600401	*ST 海润	2015-05-28	2015-09-14	非公开发行转增	-	3.82	3,000,000.00	-	11,460,000.00	-

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。

6.4.9.2 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
000035	中国天楹	2015-06-17	重大事项	19.69	2015-07-17	21.09	616,800.00	14,793,417.06	12,144,792.00	-
000150	宜华健康	2015-04-15	重大事项	55.88	-	-	392,000.00	12,897,271.00	21,904,960.00	-
002620	瑞和股份	2015-06-09	重大事项	42.71	2015-08-13	52.55	146,124.00	7,798,619.68	6,240,956.04	-
002649	博彦科技	2015-05-31	重大事项	61.61	2015-08-18	75.43	517,309.00	29,914,716.56	31,871,407.49	-
300195	长荣股份	2015-06-23	重大事项	28.36	2015-08-24	28.76	497,500.00	18,803,178.98	14,109,100.00	-
300203	聚光科技	2015-04-20	重大事项	41.19	2015-08-12	33.88	337,605.00	7,052,608.43	13,905,949.95	-

注：本基金截至 2015 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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) 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 2015 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 275,735,975.19 元，属于第二层次的余额为 117,367,165.48 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 554,087,350.65 元，第二层次 38,122,207.30 元，无第三层次)。

于 2015 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(2014 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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.1)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

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	393,103,140.67	80.86
	其中：股票	393,103,140.67	80.86
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	-	-
	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	92,177,022.70	18.96
7	其他各项资产	872,219.28	0.18
8	合计	486,152,382.65	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	-	-
C	制造业	274,061,955.86	65.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,240,956.04	1.49
F	批发和零售业	26,020,495.40	6.22
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	52,729,981.37	12.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	21,904,960.00	5.23
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	12,144,792.00	2.90
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	393,103,140.67	93.91

7.3 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	002649	博彦科技	517,309	31,871,407.49	7.61
2	002104	恒宝股份	1,268,658	30,054,508.02	7.18
3	002551	尚荣医疗	666,273	28,909,585.47	6.91
4	002675	东诚药业	523,958	23,908,203.54	5.71
5	000150	宜华健康	392,000	21,904,960.00	5.23
6	300150	世纪瑞尔	1,565,959	20,858,573.88	4.98
7	600129	太极集团	693,394	18,874,184.68	4.51
8	600401	*ST 海润	4,500,000	17,190,000.00	4.11
9	601313	江南嘉捷	827,107	15,475,171.97	3.70
10	603766	隆鑫通用	576,832	14,478,483.20	3.46

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半年度报告正文。

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	600682	南京新百	46,282,041.14	7.38
2	002104	恒宝股份	42,014,743.38	6.70
3	300150	世纪瑞尔	40,291,638.20	6.43
4	002649	博彦科技	39,630,212.10	6.32
5	002111	威海广泰	37,810,883.35	6.03
6	002551	尚荣医疗	35,933,567.73	5.73
7	600129	太极集团	33,793,706.17	5.39
8	300109	新开源	31,105,526.16	4.96
9	002675	东诚药业	30,871,255.26	4.92
10	601166	兴业银行	26,443,410.94	4.22
11	601313	江南嘉捷	23,499,142.73	3.75
12	600728	佳都科技	22,586,946.89	3.60
13	002007	华兰生物	22,481,870.76	3.59
14	603766	隆鑫通用	22,367,057.42	3.57
15	300273	和佳股份	22,197,814.87	3.54
16	600270	外运发展	21,826,817.15	3.48
17	600276	恒瑞医药	21,454,409.12	3.42
18	300020	银江股份	21,284,783.00	3.39
19	600521	华海药业	21,112,801.73	3.37
20	600976	健民集团	20,892,956.49	3.33
21	000887	中鼎股份	20,833,347.92	3.32
22	600271	航天信息	20,756,820.45	3.31
23	000100	TCL 集团	20,521,864.00	3.27
24	600993	马应龙	20,420,858.65	3.26
25	600750	江中药业	20,306,803.93	3.24
26	002410	广联达	19,988,915.32	3.19
27	002009	天奇股份	19,616,172.36	3.13
28	600060	海信电器	19,310,443.61	3.08
29	300195	长荣股份	18,803,178.98	3.00
30	002507	涪陵榨菜	18,438,788.50	2.94
31	601988	中国银行	17,754,205.69	2.83
32	002620	瑞和股份	17,398,579.40	2.77
33	000661	长春高新	17,191,967.13	2.74
34	002456	欧菲光	17,040,047.37	2.72
35	002539	新都化工	16,878,738.76	2.69
36	600138	中青旅	16,865,985.88	2.69
37	600699	均胜电子	16,740,108.00	2.67
38	300088	长信科技	16,065,417.98	2.56
39	600498	烽火通信	15,733,982.01	2.51
40	601727	上海电气	15,700,011.00	2.50
41	002250	联化科技	15,482,298.00	2.47
42	002284	亚太股份	15,364,966.70	2.45
43	002573	清新环境	15,198,437.30	2.42
44	600511	国药股份	15,078,891.64	2.40

45	000069	华侨城 A	15,069,360.14	2.40
46	600064	南京高科	15,062,297.50	2.40
47	300115	长盈精密	15,045,645.00	2.40
48	002381	双箭股份	14,911,659.65	2.38
49	000035	中国天楹	14,793,417.06	2.36
50	600350	山东高速	14,791,409.26	2.36
51	002451	摩恩电气	14,729,007.83	2.35
52	300302	同有科技	14,284,045.90	2.28
53	002433	太安堂	14,238,131.50	2.27
54	002285	世联行	14,157,589.37	2.26
55	603939	益丰药房	13,955,370.57	2.23
56	300039	上海凯宝	13,575,108.79	2.16
57	000150	宜华健康	12,897,271.00	2.06
58	600588	用友网络	12,820,504.65	2.04
59	002073	软控股份	12,721,459.70	2.03

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	300043	互动娱乐	86,321,465.33	13.77
2	600660	福耀玻璃	65,059,844.79	10.38
3	600682	南京新百	61,739,837.70	9.85
4	300058	蓝色光标	60,251,826.72	9.61
5	300147	香雪制药	57,056,610.91	9.10
6	002111	威海广泰	51,479,318.21	8.21
7	601318	中国平安	49,693,860.93	7.92
8	002588	史丹利	48,871,065.71	7.79
9	600773	西藏城投	48,562,236.53	7.74
10	600335	国机汽车	48,256,623.48	7.70
11	600563	法拉电子	42,914,096.03	6.84
12	600271	航天信息	35,835,322.27	5.71
13	300109	新开源	35,443,376.10	5.65
14	600657	信达地产	35,293,314.12	5.63
15	601166	兴业银行	31,831,978.00	5.08
16	600728	佳都科技	31,493,217.04	5.02
17	002104	恒宝股份	29,704,675.70	4.74
18	000887	中鼎股份	27,085,227.39	4.32
19	002470	金正大	26,505,164.94	4.23
20	600521	华海药业	26,270,225.45	4.19

21	002007	华兰生物	25,885,087.62	4.13
22	002410	广联达	25,857,013.16	4.12
23	300273	和佳股份	25,815,319.05	4.12
24	600270	外运发展	24,665,350.94	3.93
25	300020	银江股份	24,382,404.20	3.89
26	600617	国新能源	23,283,087.07	3.71
27	600388	龙净环保	22,660,495.79	3.61
28	000100	TCL 集团	22,656,299.99	3.61
29	002285	世联行	22,241,589.26	3.55
30	600498	烽火通信	21,922,948.60	3.50
31	300150	世纪瑞尔	21,823,976.40	3.48
32	600276	恒瑞医药	21,346,556.43	3.40
33	600060	海信电器	21,329,250.44	3.40
34	002433	太安堂	21,276,034.95	3.39
35	002496	辉丰股份	21,015,380.85	3.35
36	000902	新洋丰	20,993,587.95	3.35
37	000661	长春高新	20,851,805.67	3.33
38	601727	上海电气	20,589,708.93	3.28
39	300302	同有科技	20,089,870.12	3.20
40	002539	新都化工	19,918,976.55	3.18
41	600511	国药股份	19,351,052.45	3.09
42	300038	梅泰诺	18,890,271.56	3.01
43	002284	亚太股份	18,775,236.57	2.99
44	601668	中国建筑	17,773,680.57	2.83
45	002573	清新环境	17,555,299.03	2.80
46	601988	中国银行	17,273,612.64	2.75
47	600064	南京高科	17,195,900.93	2.74
48	603939	益丰药房	16,699,227.00	2.66
49	300115	长盈精密	16,397,259.61	2.61
50	600138	中青旅	16,303,749.60	2.60
51	600420	现代制药	16,184,116.57	2.58
52	002649	博彦科技	15,237,953.71	2.43
53	002507	涪陵榨菜	15,144,915.18	2.42
54	600350	山东高速	15,069,699.09	2.40
55	600588	用友网络	14,944,511.34	2.38
56	000069	华侨城 A	14,894,362.16	2.38
57	300039	上海凯宝	14,600,339.19	2.33
58	600976	健民集团	14,423,800.96	2.30
59	002250	联化科技	13,652,208.00	2.18
60	603898	好莱客	13,311,790.50	2.12
61	002381	双箭股份	12,964,135.02	2.07
62	600687	刚泰控股	12,809,245.38	2.04
63	002051	中工国际	12,636,555.86	2.02

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,577,398,843.24
卖出股票的收入（成交）总额	2,108,512,099.40

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。

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

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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"*st 海润"公告其公司违规情况外），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 2015 年 4 月 24 日上海证券交易所发布《关于对海润光伏科技股份有限公司股东、董事长兼总经理 YANG HUAJIN（杨怀进）、股东江阴市九润管业有限公司、江苏紫金电子集团有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》，上交所决定对海润光伏科技股份有限公司股东、董事长兼总经理 YANG HUAJIN（杨怀进）予以公开谴责；对海润光伏科技股份有限公司股东江阴市九润管业有限公司、江苏紫金电子集团有限公司和海润光伏科技股份有限公司董事李延人、任向东、吴益善、张永欣、张正，独立董事洪冬平、金曹鑫、徐小平予以通报批评。对于上述纪律处分，将抄报江苏省人民政府，并记入上市公司诚信档案。

本基金管理人此前投资*st 海润股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就*st 海润受处罚事件进行了及时分析和研究，认为*st 海润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	396,652.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,269.13
5	应收申购款	465,298.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	872,219.28

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

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	002649	博彦科技	31,871,407.49	7.61	重大事项
2	000150	宜华健康	21,904,960.00	5.23	重大事项
3	600401	*ST 海润	17,190,000.00	4.11	非公开发行

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
8,781	20,328.69	24,695,167.86	13.83%	153,811,034.55	86.17%

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	13,311,737.00	7.46%
2	广州市科技进步基金会	1,750,900.00	0.98%
3	吴芳	448,406.00	0.25%
4	黄斌	400,000.00	0.22%
5	邓敏宪	338,270.00	0.19%
6	郭建华	321,332.00	0.18%
7	许泽荣	260,377.00	0.15%
8	冯忠帆	238,673.00	0.13%
9	蓝芬芬	197,342.00	0.11%

10	缪瑾	184,311.00	0.10%
----	----	------------	-------

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	93,582.12	0.05%

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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	440,979,407.73
本报告期基金总申购份额	49,258,409.20
减：本报告期基金总赎回份额	311,731,614.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	178,506,202.41

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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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	
厦门证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	1,348,090,265.30	36.58%	1,227,306.01	36.58%	-
海通证券	2	976,277,393.38	26.49%	888,802.27	26.49%	-
国金证券	1	679,787,887.71	18.45%	618,880.39	18.45%	-
申万宏源	2	300,404,906.19	8.15%	273,488.33	8.15%	-
国泰君安	2	209,669,605.30	5.69%	190,882.95	5.69%	-
渤海证券	1	170,765,212.01	4.63%	155,464.27	4.63%	-

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
厦门证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的约定，本基金自 2015 年 8 月 8 日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”修改为“国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金合同部分条款相应修订。具体请查阅本公司于 2015 年 7 月 23 日披露的《关于修订国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同的公告》。