国泰事件驱动策略股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

2012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：二〇一二年七月二十日

第一节 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2012年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

第二节 基金产品概况

基金简称	国泰事件驱动股票
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月7日
报告期末基金份额总额	5,968,[illegible]份
投资目标	深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会，袁在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资，争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件袁在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上，将事件性因素作为投资的主线，并将事件驱动投资策略贯彻到本基金的投资管理中。 具体而言，基金的投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，采用基金管理人的资产配置评估模型，根据对宏观经济、企业盈利、流动性、估值等相关因素的分析判断确定不同资产类别的配置比例；其次是行业配置，从估值水平和发展前景两个角度出发，重点考虑因素对行业影响的分析，采取定性和定量分析相结合的方法，对行业进行优化配置和动态调整；最后，在大类资产配置和行业配置的基础上，通过对影响上市公司当前及未来价值的事件性因素进行全面的分析，深入挖掘受益于事件因素或市场估值未能充分体现事件影响的上市公司股票，在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下，优化本基金投资组合的构建，并依据事件影响的深入对其进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+[illegible]证综合债券指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于股票型基金的风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益的品种。
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

第三节 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

注：1.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 本报告期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	净值增长率①	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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国泰事件驱动策略股票型证券投资基金

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

[illegible]年[illegible]月[illegible]日至2012年6月30日

注：1.本基金的合同生效日为2010年7月7日，建仓期结束时，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。

第四节 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王航	本基金的基金经理兼国泰金鑫封闭的基金经理	[illegible]	原	[illegible]	硕士研究生，2002年7月-2007年7月任职于南方证券有限公司；[illegible]年[illegible]月加盟国泰基金管理有限公司；[illegible]年任社保[illegible]组合基金经理助理兼国泰金鼎保本基金和国泰金象保本基金经理助理兼国泰金马稳健混合的基金经理助理，[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月任国泰金鑫证券投资基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任金鑫证券投资基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任国泰事件驱动策略股票型证券投资基金的基金经理

注：1.此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日。2.任基金经理、任职日期为基金合同生效日。

4.2 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。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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，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。基金发生内幕交易、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，基金与本基金管理人所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，通过科学决策、范围运作、核心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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，通过严格的内部风控制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，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，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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度市场总体呈现前高后低走势，进入于一季度对于货币政策放松预期较高，在未达预期的情况下，进入上经济数据月度环比变差，在经济周期高度相关的强周期类品种出现大幅回调，一季度表现落后的医药和部分新兴产业则由于较为确定的成长性而重新获得资金追捧，在现出明显的板块轮动特征。基金保持较高权益类资产仓位，并在配置信息设备、银行、银金融、医疗服务和中低端消费品逐

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2012年二季度的净值增长率为[illegible]，同期业绩比较基准收益率为[illegible]。

4.6 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，政策重点将从控通胀转向稳增长和调结构，因此组合仍将重点配置转型受益的相关行业。今年以来，经济领域、资断领域、金融领域及制度建设方面的改革是一条明确清晰的投资主线。下半年这些改革措施将会得到进一步深化和细化，因于目前沪深300指数整体估值仍在历史最低水平，因此我们对整体市场保持谨慎乐观。跌空间有限，围绕转型和改革展开的结构性投资机会在下半年依然突出。结构上我们除了继续保持增长确定的安防监控、医疗服务和中低端消费行业的配置外，也将重点关注受益于阶梯电价改革、资金价格成本和原材料价格下降的电力行业。研究美国页岩气的发展对能源和工业格局的深远影响，并发掘相关行业的投资机会。

第五节 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	[illegible]	[illegible]
2	其中：股票	[illegible]	[illegible]
3	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
4	其中：债券	[illegible]	[illegible]
5	资产支持证券	0.00	0.00
6	金融衍生品投资	0.00	0.00
7	买入返售金融资产	0.00	0.00
8	其中：应收证券清算款	0.00	0.00
9	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
10	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
11	合计	[illegible]	[illegible]

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
C1	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	0.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	0.00	0.00
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	0.00	0.00
H	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
J	房地产业	0.00	0.00
K	社会服务业	[illegible]	[illegible]
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	[illegible]	[illegible]

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	大华股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	中信证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	上海家化	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	海通证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	通策医疗	[illegible]	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	七匹狼	[illegible]	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	新华医疗	[illegible]	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	北京城建	[illegible]	[illegible]	[illegible]
9	[illegible]	海康威视	[illegible]	[illegible]	[illegible]
10	[illegible]	唐人神	[illegible]	[illegible]	[illegible]

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	[illegible]	[illegible]
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	0.00	0.00
	其中：政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债	0.00	0.00
8	其他	0.00	0.00
9	合计	[illegible]	[illegible]

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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，在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	0.00
2	应收证券清算款	[illegible]
3	应收股利	0.00
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	[illegible]
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	[illegible]

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第六节 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

第七节 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.1.1 国泰事件驱动策略股票型证券投资基金基金合同

7.1.2 国泰事件驱动策略股票型证券投资基金托管协议

7.1.3 关于同意国泰事件驱动策略股票型证券投资基金募集的批复

7.1.4 报告期内披露的各项公告

7.1.5 法律法规要求备查的其他文件

7.2 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[illegible]号上海环球金融中心[illegible]楼

7.3 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：[illegible]

客户投诉电话：[illegible]

公司网址：[illegible]

国泰基金管理有限公司
二〇一二年七月二十日

国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 第二季度 报告

2012年6月30日

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年七月二十日

第一节 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

第二节 基金产品概况

基金简称	国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月7日
报告期末基金份额总额	2,[illegible]份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，以期尽量降低跟踪误差。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过[illegible]，年跟踪误差不超过[illegible]。因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 （1）债券投资策略 基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债。债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 （2）股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以期货流动性好、交易活跃的股指期货合约为主，基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中小板300指数增长交易型开放式指数证券投资基金联接基金业绩比较基准收益率为：[illegible]。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

第三节 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

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、减：公允价值变动收益、减：费用后的余额。2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期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

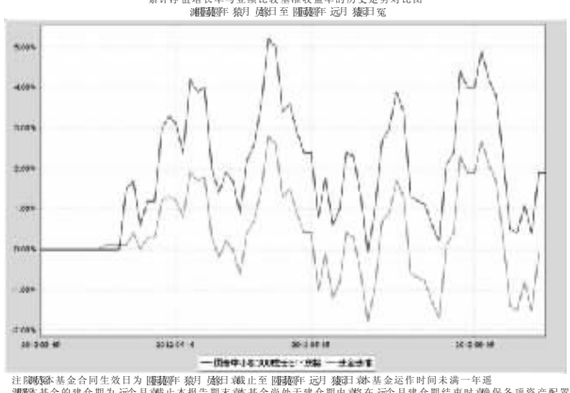
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中小板300指数增长交易型开放式指数证券投资基金

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

[illegible]年[illegible]月[illegible]日至2012年6月30日



注：1.本基金合同生效日为2010年7月7日，建仓期结束时，本基金在一个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

第四节 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章赞	本基金的基金经理兼国泰上证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、国泰沪深300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金联接基金的基金经理	[illegible]	原	远	博士，2008年7月任职于平安资产管理公司，[illegible]年[illegible]月加盟国泰基金管理有限公司，任数量金融分析师；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理；[illegible]年[illegible]月起担任上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任中小板300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金联接基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任中小板300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金联接基金的基金经理

注：1.此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日。2.任基金经理、任职日期为基金合同生效日。

4.2 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。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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，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。基金发生内幕交易、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，基金与本基金管理人所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，通过科学决策、范围运作、核心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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，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，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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度市场总体呈现前高后低走势，年初于平安资产管理公司工作的[illegible]年[illegible]月加盟国泰基金管理有限公司，任数量金融分析师；[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理；[illegible]年[illegible]月起担任上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理；[illegible]年[illegible]月起兼任中小板300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金联接基金的基金经理。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2012年二季度的净值增长率为：[illegible]，同期业绩比较基准收益率为：[illegible]。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

信贷需求及经济基本面尚未得到触底企稳的印证，资金参与情绪不高，市公司中报业绩和经济数据的不确定性及负面预期可能使市场继续保持谨慎，而政府及监管层面出台更多的扶持政策及货币管控持续放松的概率较大，围环境的冲击也已逐步消化，在一定程度上有利于缓解投资者的悲观情绪及市场的承跌动能。

在通胀下行、货币政策扶持累积及货币供应放松的作用下，随着上市公司业绩下滑的风险逐步释放以及实体经济逐步触底企稳的情况下，二季度中后期大盘出现阶段性回调上涨的概率较大，届时市场的整体运行态势及投资者的参与热情将有所好转。从大小盘轮动模型的运行结果可以看出，中小盘在今后相当长的一段时间内可能维持强于大盘股的表现。于中小板300指数而言，二季度的表现仍然值得期待。

中小板300指数从指数从中小板300指数中选取高主营业务收入增长率、高净利润增长率、高净资产收益率三大指标精选出300家上市公司，成份股基本面良好，成长性突出，投资者可积极利用国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金这一优良的资产配置工具，分享中国优质中小企业高速成长的成果。

第五节 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：应收证券清算款	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
6	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
7	合计	[illegible]	[illegible]

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	0.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	0.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	0.00	0.00
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	0.00	0.00
H	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	0.00	0.00
J	房地产业	0.00	0.00
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	苏宁电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	洋河股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	宁波银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	海康威视	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	歌尔声学	[illegible]	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	金螳螂	[illegible]	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	双鹭药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	大北农	[illegible]	[illegible]	[illegible]
9	[illegible]	莱宝高科	[illegible]	[illegible]	[illegible]
10	[illegible]	华兰生物	[illegible]	[illegible]	[illegible]

5.4 报告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。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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，在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	[illegible]
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	[illegible]

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第六节 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

第七节 备查文件目录

7.1 备查文件目录

7.1.1 国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同

7.1.2 国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议

7.1.3 关于同意国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的批复

7.1.4 报告期内披露的各项公告

7.1.5 法律法规要求备查的其他文件

7.2 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[illegible]号上海环球金融中心[illegible]楼

7.3 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：[illegible]

客户投诉电话：[illegible]

公司网址：[illegible]

国泰基金管理有限公司
二〇一二年七月二十日

中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金

2012 第二季度 报告

2012年6月30日

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年七月二十日

第一节 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

第二节 基金产品概况

基金简称	国泰中小板300指数增强成长交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月7日
报告期末基金份额总额	3,[illegible]份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	（1）股票投资策略 本基金主要采取完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，以期尽量降低跟踪误差。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过[illegible]，年跟踪误差不超过[illegible]。因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 （2）债券投资策略 基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债。债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 （3）股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以期货流动性好、交易活跃的股指期货合约为主，基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中小板300指数增长交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准收益率为：[illegible]。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

第三节 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年4月1日-2012年6月30日）
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

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、减：公允价值变动收益、减：费用后的余额。2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本报告期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

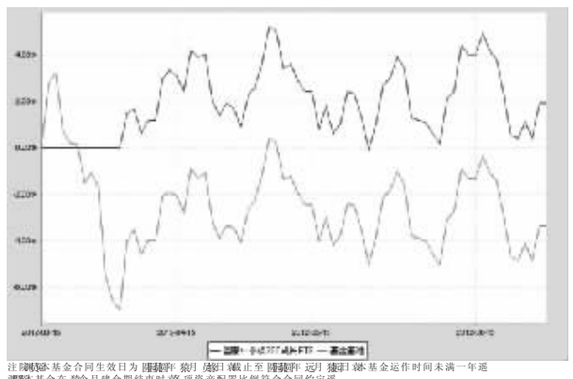
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中小板300指数增长交易型开放式指数证券投资基金

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

[illegible]年[illegible]月[illegible]日至2012年6月30日



注：1.本基金合同生效日为2010年7月7日，建仓期结束时，本基金在一个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

第四节 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章赞	本基金的基金经理兼国泰上证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、国泰沪深300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金、国泰中小板300指数证券投资基金联接基金的基金经理