

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

2014 半年度 报告摘要

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	金额单位:人民币元
				占期初基金资产净值比例(%)
1	600563	法拉电子	430,076,495.28	6.61
2	600401	海润光伏	38,250,820.81	5.87
3	600284	浦东建设	35,028,853.60	5.38
4	600919	金隅药业	26,370,125.60	4.05
5	600406	国电南瑞	26,091,281.45	4.00
6	600212	三钢闽光	24,792,099.63	3.81
7	300274	阳光电源	18,363,667.25	2.82
8	002551	康美医疗	17,134,087.68	2.63
9	600571	信雅达	17,081,916.45	2.62
10	300166	东方国信	16,423,979.23	2.52
11	002080	中材科技	15,547,281.46	2.39
12	300007	慈星股份	15,469,073.60	2.37
13	600728	佳都科技	13,946,833.90	2.14
14	004093	马应龙	13,813,310.94	2.12
15	000423	东阿阿胶	13,720,260.48	2.11
16	600820	隧道股份	12,855,909.51	1.97
17	000916	华北高速	12,495,843.50	1.92
18	002309	中钢科技	12,104,314.04	1.86
19	002390	信邦制药	11,192,263.20	1.72
20	600617	联华合纤	10,240,000.00	1.57

9	600571	闻泰科技	17,091,106.45	2.62
10	300166	东方国信	16,423,999.23	2.53
11	002080	中材科技	15,547,281.46	2.39
12	300307	思慧股份	15,469,073.60	2.37
13	600728	佳都科技	13,946,633.90	2.12
14	600993	乌衣龙	13,813,104.44	2.14
15	000423	东阿阿胶	13,720,260.48	2.11
16	600520	健盛股份	12,855,509.31	1.92
17	000916	华鲁化工	12,495,843.30	1.91
18	002309	中科曙光	12,104,314.04	1.86
19	002390	信邦制药	11,192,263.20	1.72
20	600617	联华化学	10,240,000.00	1.57

注：1.金额按买入成交金额（或成交金额按以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
2. 7.4.2 累计买入金额按照期初基金资产净值2%至20名前的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	金额单位：人民币元
1	600284	浦东建设	32,209,603.54	4.94
2	300197	铁汉生态	24,397,647.22	3.74
3	600406	国电南瑞	21,696,262.56	3.33
4	600019	人福医药	18,085,474.24	2.78
5	002312	永辉超市	16,740,408.38	2.57
6	300192	易世达	16,670,410.53	2.55

7	600571	信达地产	15,267,138.71	2.34
8	600335	国际汽车	14,722,394.31	2.26
9	600887	伊力股份	14,565,042.24	2.23
10	002080	中材科技	14,101,753.01	2.16
11	600728	佳都科技	14,090,364.77	2.16
12	600933	马应龙	13,759,841.07	2.11
13	002234	英威腾	13,064,985.45	2.01
14	002309	中利科技	12,595,038.92	1.93
15	002090	贤思国际	12,475,206.16	1.90

15	600820	隧道股份	12,158,224.42	1.87
16	002433	太安堂	11,745,571.66	1.80
17	000916	华北高速	11,645,415.97	1.79
18	300334	津膜科技	11,013,428.13	1.69
19	600766	中国国旅	10,732,101.54	1.65

注：卖出金额按卖出成交金额（或成交价款减去成交数量）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（或买入）总额			559,708,871.10
卖出股票的收入（或卖出）总额			579,646,967.11
注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（或成交价款减去成交数量）填列，不考虑相关交易费用。			
7.5 期末按公允价值计量的投资组合			
本基金本报告期末未持有债券。			
7.6 期末按公允价值计量金融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资产。

7.6 本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 本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 本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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金总资产的比例计提的待摊费用及递延费用说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货待摊费用和损益情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金本报告期投资的股指期货情况

本基金本报告期末未持有股指期货。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。套期保值将主要针对流动性好、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定价。

本基金管理人将充分考量股指期货的收益性、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。

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

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 本期股指期货投资情况

根据本基金合同,本基金不能投资于股指期货。

7.12 股指期货投资情况说明

7.12.1 报告期末基金投资的前十名证券的发行主体没有经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。

7.12.2 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	178,625.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	20,768.95
5	应收申购款	101,059,273.38
6	其他应收款	—
7	待摊费用	10,347.11
8	其他	—
9	合计	101,288,914.59

7.12.4 期末未付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。

7.12.5 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。

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

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
17,887	35,419.20	227,756,215.43	33.95%	405,787,020.59	64.05%

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	23,311,737.00	2.86%
2	广州市科技進步基金会	2,000,000.00	0.25%
3	杨留云	930,000.00	1.30%
4	郭建华	644,771.00	0.65%

5	吴芳	448,406.00	0.63%
6	黄城	400,230.00	0.56%
7	蒙宜斌	389,215.00	0.55%
8	邓敏文	338,270.00	0.47%
9	李浩	304,021.00	0.43%
10	苏崇德	300,033.00	0.42%

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	844,960.54	0.13%

9 开放式基金份额变动

	单位：份
基金合同生效日至（2009年10月19日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期初基金份额总额	579,897,683.16
本报告期基金总申购份额	237,790,580.34
减：本报告期基金总赎回份额	184,145,027.53
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	633,543,236.02

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“专门基金托管人”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2014年2月7日发布任免通知，解聘尹开中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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 报告期内及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 报告期内,托管人及其高级管理人员受稽查处罚等情况

报告期内,基金管理人、托管人及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 基金运用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金运用证券公司交易单元进行股票及资金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总金额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	--	--	--	--	
厦门证券	1	--	--	--	--	
银河证券	1	--	--	--	--	
渤海证券	1	--	--	--	--	
宏源证券	1	--	--	--	--	
中航证券	1	--	--	--	--	
海通证券	2	595,383,843.25	53.08%	542,033.98	53.08%	
兴业证券	2	336,420,591.99	29.99%	306,277.21	29.99%	
国泰君安	2	110,487,618.78	9.85%	100,587.92	9.85%	
申银万国	1	44,643,448.49	3.98%	40,643.76	3.98%	
民生证券	1	34,822,845.32	3.10%	31,702.88	3.10%	

注:基金席位的选择标准是:

(1)资产雄厚,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;

经营行为规范,在最近一年内无重大违规经营行为;

(6)内部管理规定严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(7)公司有良好的研究实力,能为基金运作提供具有相当价值的关于宏观经济形势、行业发展趋势及证券市场走势、个股分析的研究报告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;

这个程序是,根据对各券商提供的信息,并经公司批准,符合券商业务标准的,由公司研究部提出席位券商的增减意见(调整名单及调整原因),并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
国金证券	—	—	—	—	—	—
厦门证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
南通证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	6,000,000.00	100.00%	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—