

中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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

§ 1 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17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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

基金合同部分条款未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国泰中小板300成长ETF(场内简称:中小成长)

基金主代码 159917

交易代码 159917

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2012年3月15日

报告期末基金份额总额 54,132,924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。

§ 3 投资策略

本基金主要采取完全复制法，即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定期进行相应的调整。但因特殊情况(如停牌等)导致部分成份股长期停牌，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、市场流动性不足等导致基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行相应调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量减少跟踪误差。

在通胀下行、前期政策扶持力度及货币供应宽松的作用下，随着上市公司业绩下滑的放缓逐步释放以及实体经济逐步触底企稳的情况下，三季度中后期可能维持强大盘股的表现。对于中小板300成长指数而言，三季度的表现仍然值得期待。

中小板300成长指数从中小板300指数中，以高主营业务收入增长率、高净资产收益率、高净资产收益率等指标精选出100家上市公司，成分股基本面良好、成长性突出。投资者可积极利用中小板300成长ETF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增长的成果。

的反复、美国经济增长不及预期、大宗商品大幅回落等因素，即使出现了降准降息，场内资金仍会逐步流出，市场成交量不断萎缩，市场人气极度低迷。

其后，中小板300成长指数超越了市场中绝大多数的中小板指数，通过三大指标精选出成份股的成长性相对较好地体现。

作为完全复制的指数型证券投资基金，本基金避免了不必要的主动操作，减少了交易冲击成本，并通过精简管理降低基金组合风险。

本基金在2012年二季报的业绩表现：单位净值增长率为1.90%，同期业绩比较基准收益率为3.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金需求方面，基本面尚未得到改善，企业盈利的印证，虽然政府及监管部门出台更多的扶持政策及货币信贷政策，但幅度有限，不足以支撑其未来表现。

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。

基金合同部分条款未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 4 报告期末基金资产组合情况

基金总资产 53,210,011.03 元 占基金总资产的比例(%) 92.35

其中：股票 53,210,011.03 元 占基金总资产的比例(%) 92.35

2 固定收益投资 - -

其中：债券 - -

资产支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算准备金合计 3,857,347.08 元 6.69

其他各项资产 550,347.72 元 0.96

7 合计 57,617,705.83 元 100.00

§ 5 投资组合报告

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 53,210,011.03 92.35

其中：股票 53,210,011.03 92.35

2 固定收益投资 - -

其中：债券 - -

资产支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算准备金合计 3,857,347.08 元 6.69

其他各项资产 550,347.72 元 0.96

7 合计 57,617,705.83 元 100.00

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 1,930,609.55 3.50

B 采掘业 3,286,355.40 5.96

C 制造业 30,560,795.58 55.41

C0 食品、饮料 6,207,026.95 11.25

C1 纺织、服装、皮革 1,916,732.60 3.48

C2 木材、家具 205,286.13 0.37

C3 造纸、印刷 5,585,541.03 10.13

C4 石油、化学、塑胶、塑料 7,229,100.11 13.11

C5 电子 1,146,644.88 2.08

C6 金属、非金属 3,868,840.42 7.01

C7 机械、设备、仪表 3,777,237.46 6.85

C99 其他制造业 624,386.00 1.13

D 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 4,074,150.55 7.39

F 交通运输、仓储业 - -

G 信息技术业 2,907,587.36 5.27

H 批发和零售贸易 6,090,108.44 11.04

I 金融、保险业 1,591,810.00 2.89

J 房地产业 1,440,241.34 2.61

K 社会服务业 1,231,942.81 2.23

L 传播与文化产业 - -

M 综合类 96,410.00 0.17

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 002024 苏宁电器 554,963 4,656,139.57 8.44

2 002304 洋河股份 31,392 4,250,703.60 7.71

3 002142 宁波银行 159,000 1,391,810.00 2.89

4 002415 海康威视 56,732 1,543,110.40 2.80

5 002241 歌尔声学 36,326 1,325,535.74 2.40

6 002155 辰州矿业 67,600 1,308,736.00 2.37

7 002081 金螳螂 30,600 1,162,800.00 2.11

8 002106 莱宝高科 52,200 1,047,654.00 1.90

9 002353 杰瑞股份 20,962 1,016,657.00 1.84

10 002007 华兰生物 40,837 1,003,773.46 1.82

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投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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十名股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.8 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股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.9 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债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.10 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组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.11 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权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.12 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股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.13 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股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.14 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债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.15 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组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.16 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权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.17 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股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.18 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股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.19 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债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.20 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组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.21 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权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.22 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股指期货投资组合

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.23 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股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.24 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债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.25 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组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.26 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权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.27