

## 国泰中小盘成长股票型证券投资基金 LOF)

## [2013] 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:二〇一三年七月十八日

注:本基金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2013年7月16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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别责任。

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2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:国泰中小盘成长股票(LOF)(场内简称:国泰中小)

基金代码: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7月19日

报告期末基金份额总额:744,996,779.21份

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,追求超越业绩比较基准的长期稳定的绝对收益。

本基金的大类资产配置主要通过宏观经济趋势判断分析,评估未来一段

段时间股票、债券市场对资产配置的主动调整股票、债券及现金资产的配置比例。

其中,股票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,并根据市场情况适时调整股票、债券及现金资产的配置比例。

本基金的风格特征: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

股票型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 28,593,606.17

2.本期利润 23,431,197.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.0294

4.期末基金份额净值 730,748,238.69

5.期末基金份额总额 677,021,052.62

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利润。

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,费用计算后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本期基金份额净值增长率及其与同期基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 净值增长率标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 业绩比较基准收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.29% 1.56% -4.91% 1.19% 7.20% 0.37%

3.2.2 本基金转型以来基金净值增长率与同期基准收益率的比较

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF) 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图(2009年1月1日至2013年6月30日)

注:本基金的合同生效日为2009年10月10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 基金经理、本基金投资策略

姓名 职称 任期日期 离任日期 说明

本基金的基金经理

张伟 2009-10-19 -

13

本基金的基金经理

周伟伟 2013-6-13 -

5

注:1.本基金的任日期和离任日期均指公司决定生效之日起,首任基金经理,任日期为基金经理决定生效之日起。

2.涉及从业人员的含义从广义上理解,从业人员包括基金管理人员的直系亲属。

3.本基金的基金经理严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金评价办法》等有关法律法规的规定,严格遵守基金合同和招募说明书的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度地保护投资人利益的原则,根据法律法规的规定,结合基金投资管理的其他基金投资经验,在有效控制风险的前提下,精选个股,构建合理的投资组合。

4.1 公平交易制度和公平交易情况

本基金在公平交易制度和公平交易情况的报告期内,未发现基金经理存在不公平交易和利益输送的明显行为。

4.2 公平交易制度执行情况

本基金的基金经理严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金评价办法》等有关法律法规的规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各环节的公平交易制度执行情况进行有效的监控,确保不出现不公平交易和利益输送的情况。

4.3 公平交易制度执行的说明

本基金的基金经理严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金评价办法》等有关法律法规的规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各环节的公平交易制度执行情况进行有效的监控,确保不出现不公平交易和利益输送的情况。

4.4 公平交易制度执行的监督情况

本基金的基金经理严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金评价办法》等有关法律法规的规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各环节的公平交易制度执行情况进行有效的监控,确保不出现不公平交易和利益输送的情况。

4.5 代理人对公平交易、证券市场及行业走势的简要预测

从目前情况来看,本基金的基金经理将继续保持对经济基本面的分析,并结合行业、品种选择、品种筛选、择时进行投资,以降低投资组合的波动风险。

4.6 代理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要预测

4.4 报告期内基金投资组合和绩效表现

4.4.1 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.2 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.3 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.4 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.5 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.6 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.7 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.8 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.9 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.10 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.11 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.12 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.13 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.14 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.15 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.16 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.17 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.18 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.19 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.20 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.21 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.22 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.23 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.24 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.25 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.26 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.27 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.28 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.29 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.30 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.31 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.32 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.33 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.34 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.35 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.36 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.37 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.38 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.39 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.40 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.41 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.42 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.43 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.44 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.45 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.46 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.47 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.48 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.49 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.50 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.51 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.52 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.53 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.54 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.55 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.56 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.57 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.58 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.59 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.60 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.61 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.62 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.63 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.64 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.65 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.66 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.67 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.68 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.69 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.70 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.71 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.72 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.73 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.74 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.75 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.76 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.77 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.78 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.79 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.80 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.81 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.82 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.83 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.84 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.85 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.86 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.87 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.88 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.89 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.90 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.91 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.92 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.93 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.94 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.95 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.96 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.97 报告期内基金资产配置和业绩表现

4.4.98 报告期内基金资产配置和业绩表现