

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

2014 年度 报告 摘要

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:二〇一五年三月三十日
重要提示:基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制、披露基金年度报告过程中,可能存在虚假记载、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法律责任。

注1:此处的任职日期和离任日期指公司法定代表人发生之日,在作出基金经理、任日期为基金合同生效日。
注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。

单位:人民币元
项目 本报告 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 2 columns: 基金基本情况 (Fund Basic Information) and 基金投资组合情况 (Fund Portfolio Situation). Includes details on fund name, type, and asset allocation.

Table with 3 columns: 项目 (Item), 本报告 (This Report), 上年度可比期间 (Previous Report). Shows performance metrics for the fund and its components.

Table with 3 columns: 项目 (Item), 本报告 (This Report), 上年度可比期间 (Previous Report). Shows performance metrics for the fund and its components.

2.1 基金基本情况

基金名称: 国泰中小板300成长ETF联接基金
基金代码: 002653
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

2.2 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.1期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists industry allocations at the end of the period.

2.3 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

2.4 信息披露方式

基金年度报告备置地点: 上海市虹口区公平路18号恒慧大厦16层1609室
基金管理人网站: http://www.guotai.com.cn

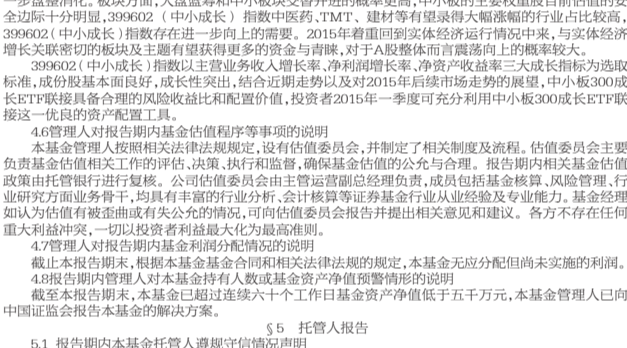
8.2期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 stock holdings.

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 3 columns: 3.1.1 期间数据和指标 (Period Data and Indicators), 2014年 (2014), 2013年 (2013), 2012年1-12月(2012.1-12.31). Shows financial performance metrics.

3.2 基金净值增长率及其与同期比较基准收益率变动的比较



8.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 bond holdings.

3.3 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.4 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.4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

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 资产支持证券名称 (Asset Support Security Name), 数量(元) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 asset-backed securities.

3.5 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.6 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.5期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 warrant holdings.

3.7 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.8 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.6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指期货投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 合约名称 (Contract Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 futures holdings.

3.9 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.10 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 合约名称 (Contract Name), 数量(手) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 futures holdings.

3.11 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.12 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 warrant holdings.

3.13 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.14 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 warrant holdings.

3.15 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.16 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 warrant holdings.

3.17 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.18 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.11期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 warrant holdings.

3.19 基金管理人及基金托管人

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
基金管理人地址: 济南市经二路纬三路

3.20 基金投资组合情况

本基金为ETF联接基金,以ETF为主要投资对象,为投资者提供便捷的投资渠道。
本基金的投资范围包括:国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具等。

8.12期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (Percentage). Lists top 10 warrant holdings.