

信息披露 disclosure

国泰成长优选股票型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十八日

重要提示
基金管理人、基金托管人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法律责任。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。

根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同》的约定,本基金自2015年8月8日起基金名称由“国泰成长优选股票型证券投资基金”修改为“国泰成长优选股票型证券投资基金”,基金合同相应条款相应修订。具体请查阅公司于2015年7月23日披露的《关于修订〈国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同〉的公告》。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日期

2.2 基金主要目标

本基金通过精选具有良好成长性和良好业绩的上市公司,结合价值投资和成长投资策略进行积极投资,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。

1. 资产配置: 本基金为股票型基金,资产配置范围(Meta)通过宏观经济、政策环境、流动性、估值、行业景气度等因素进行判断,采用打分法确定资产配置比例。

2. 选股策略: 本基金在资产配置的基础上,通过以下几个方面优选成长型股票:(1)企业成长性,关注收入和利润的成长性;(2)通过研发投入、销售数据等指标的成长,并寻找具有持续性的,选择核心竞争力的个股;(3)通过估值模型,寻找估值合理或低估的个股,进行积极投资。在综合考虑宏观经济风险和估值的前提下,完成本基金投资组合的构建。

3. 风险控制策略: 本基金风险控制策略包括:长期跟踪宏观经济形势和利率,结合利率的变动,控制宏观风险及权益类资产配置,通过资产配置调整等方法,实现积极的风险管理。

4. 收益分配策略: 本基金在严格控制风险的前提下,主动进行权益投资,基金收益分配方式为现金分红,在充分流动性前提下,本基金收益分配方式为现金分红。

5. 跟踪回报投资策略: 本基金跟踪回报策略以跟踪指数为目的,在跟踪指数的前提下,通过行业轮动,参与跟踪指数的投资,以管理投资组合的跟踪误差,改善组合的风险收益特征。跟踪回报策略主要采用被动型,交易跟踪的跟踪组合。本基金在进行跟踪回报时,将通过对行业和市场进行跟踪,进行跟踪组合的构建,并定期跟踪组合的跟踪误差和持仓集中度。

业绩比较基准: 摩根大通沪深300指数收益率*80%+中证500指数收益率*20%

风险收益特征: 本基金为股票型基金,股票资产的投资占基金资产净值60%以上,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种。

2.3 基金管理人相关信息

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人, 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: 招商银行股份有限公司

6.4.8.2.1 基金管理人

项目: 本期, 上期

当期发生的基金应支付的费用: 1,736,462.23

其中: 支付销售机构的客户维护费: 169,528.26

注: 支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按照前一基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管人

项目: 本期, 上期

当期发生的基金应支付的费用: 106,000.94

注: 支付基金托管人招商银行的托管费按照前一基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.5 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.1 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.2 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.3 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.4 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.5 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.6 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.7 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.8 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.9 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.10 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.11 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.12 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.13 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.14 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.15 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.16 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.17 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.18 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.19 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.20 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.21 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.22 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.23 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.24 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.25 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.26 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.27 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.28 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.29 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.30 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.31 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.32 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.33 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.34 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.35 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.36 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.37 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.38 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.39 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.40 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.41 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.42 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.43 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.44 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.45 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.46 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.47 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.48 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.49 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.50 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.51 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.52 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.53 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.54 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.55 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.56 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.57 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.58 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.59 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.60 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.61 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.62 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.63 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.64 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.65 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.66 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.67 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.68 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.69 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.70 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.71 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.72 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.73 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.74 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.2.1 基金管理人

项目: 本期, 上期

当期发生的基金应支付的费用: 1,736,462.23

其中: 支付销售机构的客户维护费: 169,528.26

注: 支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按照前一基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管人

项目: 本期, 上期

当期发生的基金应支付的费用: 106,000.94

注: 支付基金托管人招商银行的托管费按照前一基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.5 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.1 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.2 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.3 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.4 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.5 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.6 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.7 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.8 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.9 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.10 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.11 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.12 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.13 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.14 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.15 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.16 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.17 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.18 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.19 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.20 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.21 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.22 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.23 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.24 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.25 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.26 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.27 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.28 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.29 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.30 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.31 关联方为基金管理人、基金托管人及其他关联方投资本基金的情况