

国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

[2016] 第一季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和基金份额持有人信息等内容,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。

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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)
场内简称	国泰小盘
基金主代码	160211
交易代码	160211
基金运作方式	上市开放式基金
基金合同生效日	2009年10月14日
报告期末基金份额总额	281,896,726.87份

本基金主要投资于具有高成长性的行业基本面良好的中小股票。在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

投资目标 本基金的大盘股仓位主要通过定期对宏观经济及行业的动态分析,评估未来一段时间的投资价值,并结合资金的配置比例,10%股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小股票为投资对象,实现每日下限为10%的个股个数限制。

业比较基准 本基金的业绩基准=35%×沪深300指数+65%×天天大盘成长指数+20%现金。

风险收益特征 本基金属于混合型基金,基金资产整体的预期风险和预期风险高于货币市场基金和纯债型基金,低于股票型基金。

基金管理人 国泰基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益		-9,544,038.78
2.本期利润		-47,131,615.44
3.加权平均基金份额本期利润		-0.1801
4.期末基金资产净值		672,000,390.54
5.期末基金份额净值		2.3864

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,本期利润为期初至本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所示的数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

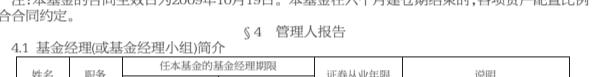
过去三个月 -11.08% 3.27% -14.46% 2.56% 3.40% 0.79%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰中小盘成长型混合型证券投资基金(LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年10月19日至2016年3月31日)



注:本基金的合同生效日为2009年10月19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(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
杨树(原任基金经理)	杨树(原任基金经理)	2015-06-11	8年	硕士研究生,2006年7月至2009年6月在国泰基金管理有限公司担任助理研究员,2009年5月至2011年2月在国泰基金管理有限公司担任研究员,2011年2月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年10月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年6月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年12月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2016年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理。
王雷(原任基金经理)	王雷(原任基金经理)	2015-06-11	8年	硕士研究生,2006年7月至2009年6月在国泰基金管理有限公司担任助理研究员,2009年5月至2011年2月在国泰基金管理有限公司担任研究员,2011年2月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年10月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年6月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年12月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2016年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理。
刘鸣鸣(原任基金经理)	刘鸣鸣(原任基金经理)	2015-06-11	8年	硕士研究生,2006年7月至2009年6月在国泰基金管理有限公司担任助理研究员,2009年5月至2011年2月在国泰基金管理有限公司担任研究员,2011年2月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年10月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年6月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年12月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2016年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理。
陈立(原任基金经理)	陈立(原任基金经理)	2015-06-11	8年	硕士研究生,2006年7月至2009年6月在国泰基金管理有限公司担任助理研究员,2009年5月至2011年2月在国泰基金管理有限公司担任研究员,2011年2月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年10月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年6月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2015年12月起任国泰基金管理有限公司基金经理,2016年1月起任国泰基金管理有限公司基金经理。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。

本基金未进行份额折算,未发生持有人利益损害的情况。

§5 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	203,363,442.00
报告期期间申购份数	160,899,125.14
减去报告期期间赎回份数	82,306,341.75
报告期期间基金净变动数	-
报告期期末基金份额总额	281,896,726.87

5.1 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.5 5月15日前最后一期股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末不存在股票中存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	203,363,442.00
报告期期间申购份数	160,899,125.14
减去报告期期间赎回份数	82,306,341.75
报告期期间基金净变动数	-
报告期期末基金份额总额	281,896,726.87

注:1.报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.5.5 5月15日前最后一期股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末不存在股票中存在流通受限情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期初暂持金额	13,311,737.00
报告期期间申购份数	12,461,969.04
减去报告期期间赎回份数	-
报告期期间基金净变动数	-
报告期期末暂持金额	25,771,706.04

注:1.此处在报告期初暂持金额中扣除了因分红导致的分红再投金额。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。

本基金未进行份额折算,未发生持有人利益损害的情况。

§8 报告期内基金投资组合情况

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权杖投资	666,962,150.00	83.67
2	固定收益投资	666,962,150.00	83.67
3	其中:债券	666,962,150.00	83.67
4	贵金属投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	92,119,224.46	13.58
9	其他各项资产	19,308,212.51	2.56
10	合计	678,389,576.05	100.00

注:(1)本基金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,本期利润为期初至本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所示的数字。

5.2 基金产品概况

本基金的合同生效日期为2009年10月22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。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权杖投资	666,962,150.00	83.67
2	固定收益投资	666,962,150.00	83.67
3	其中:债券	666,962,150.00	83.67
4	贵金属投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	