中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购赎回业务公告

公告送出日期：2012年3月29日

1.公告基本信息

基金名称	中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金
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
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年3月15日
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2012年4月6日
赎回起始日	2012年4月6日

2.日常申购、赎回业务的办理时间

本基金自2012年4月6日开放日常申购、赎回业务。

申购和赎回的开放日为深圳证券交易所交易日（基金管理人暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放时间为上午9:30至11:30、下午1:00至3:00。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回开放日和具体业务办理时间进行调整并在指定媒体公告。

3.日常申购业务

3.1申购金额限制

投资者申购的基金份额需为最小申购单位的整数倍。本基金最小申购单位为100万份。基金管理人可根据市场情况，调整申购的数额限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

3.2申购费率

投资者在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3.3其他与申购相关的事项

（一）申购的场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购。

（二）申购原则

1、本基金采用份额申购的方式，即申购以份额申请。

2、本基金的申购对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购申请提交后不得撤销。

4、申购应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益、不违背交易所相关规则的情况下更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

（三）申购的程序

1、申购的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购的申请。投资者申购本基金时，须根据申购赎回清单备足申购对价，否则所提交的申购申请无效而不予成交。

2、申购申请的确认

基金投资者申购申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购的销售网点查询有关申请的确认情况。

3、申购的清算交收与登记

本基金申购过程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和登记结算机构的结算规则。

投资者T日申购成功后，登记结算机构在T+1日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代等的清算。在T+1日办理基金份额、现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

（四）申购的对价及其用途

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、投资者应收或应付的现金差额及其他对价。申购对价根据申购赎回清单和投资者申购的基金份额数额确定。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。

4.日常赎回业务

4.1赎回份额限制

投资者赎回的基金份额需为最小赎回单位的整数倍。本基金最小赎回单位为100万份。基金管理人可根据市场情况，调整赎回的数额限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

4.2赎回费率

投资者在赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

4.3其他与赎回相关的事项

（一）赎回的场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的赎回。

（二）赎回原则

1、本基金采用份额赎回的方式，即赎回以份额申请。

2、本基金的赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、赎回申请提交后不得撤销。

4、赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益、不违背交易所相关规则的情况下更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

（三）赎回的程序

1.赎回的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的业务办理时间提出赎回的申请。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的赎回的申请无效而不予成交。

2、赎回申请的确认

基金投资者赎回申请在受理当日进行确认。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。

3.赎回的清算交收与登记

本基金赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和登记结算机构的结算规则。

投资者T日赎回成功后，登记结算机构在T+1日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代等的清算。在T+1日办理基金份额、现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

（四）赎回的对价及其用途

1.赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、投资者应收或应付的现金差额及其他对价。赎回对价根据申购赎回清单和投资者赎回的基金份额数额确定。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。

5. 基金销售机构

本基金的销售机构为申购赎回代理券商，名单如下：光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、方正证券股份有限公司。

6.基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

7.其他需要提示的事项

（1）本公告仅对本基金开放申购赎回的有关事项和规定予以说明，投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在2012年1月19日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

（2）如有任何疑问，欢迎与我们联系：

客户服务中心电话：400-888-8688（免长途费），021-38569000

电子邮件地址：service@gtfund.com

（3）风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。

国泰基金管理有限公司

2012年3月29日

中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

国泰基金管理有限公司

二零一二年三月二十九日

一、重要声明与提示

中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2012年1月19日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上的《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金二级市场交易简称：中小成长。

4、二级市场交易代码：159917。

5、基金申购、赎回简称：中小成长。

6、申购、赎回代码：159917。

7、标的指数简称：SME300成长

8、标的指数代码：399602

9、2012年3月27日基金份额总额：345,132,924.00份。

10、2012年3月27日基金份额净值：1.000元。

11、本次上市交易份额：345,132,924.00份。

12、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

13、上市交易日期：2012年4月6日。

14、基金管理人：国泰基金管理有限公司。

15、基金托管人：中国银行股份有限公司。

16、申购赎回代理券商：光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、方正证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1206号文。

2、基金运作方式：交易型、开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金自2012年1月30日至2012年3月9日公开发售。其中，网下现金认购的日期为2012年1月30日至2012年3月9日，网下股票认购的日期为2012年2月27日至2012年3月9日，网上现金认购的日期为2012年1月30日至2012年3月9日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：网下现金发售30个工作日，网上现金发售30个工作日，网下股票认购10个工作日。

7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。

8、发售机构

（1）直销机构

网下现金发售直销机构：国泰基金管理有限公司。

（2）代销机构

本基金的网下股票发售的发售代理机构为中国中投证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、民生证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、华泰证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、中航证券有限公司、东海证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、广州证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司等。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司进行：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、华福证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、中银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信金通、中信万通、中信证券、中银证券、中原证券等。

（二）基金合同生效

中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金自2012年1月30日起向社会公开募集，截至2012年3月9日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，此次募集的有效净认购金额为人民币345,104,845.00元（含所募集股票市值），经基金注册登记机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计28,079.00元人民币。本次募集认购资金已于2012年3月15日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集股票已于2012年3月15日由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理过户。

本次募集有效认购户数为2,253户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，设立募集期间募集（含所募集股票市值）及利息结转的基金份额共计345,132,924.00份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2012年3月15日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2012】74号。

2、上市交易日期：2012年4月6日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：中小成长。

5、二级市场交易代码：159917。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、本次上市交易份额：345,132,924.00份。

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）场内持有人户数

截至2012年3月27日，本基金份额持有人户数为2,256户，平均每户持有的场内基金份额为152,984份。

（二）场内持有人结构

截至2012年3月27日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为232,662,068.00份，占基金总份额的67.42%；个人投资者持有的场内基金份额为112,470,856.00份，占基金总份额的32.58%。

（三）场内前十名基金份额持有人的情况：

截至2012年3月27日，场内前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	长春市天盛投资有限公司	59,604,966	17.27%
2	中融人寿保险股份有限公司—万能保险产品	20,002,200	5.80%
3	红塔证券股份有限公司	20,000,833	5.80%
4	国都—华夏—国都宏心投资集合资产管理计划	10,001,000	2.90%
5	北京大学教育基金会	10,000,833	2.90%
6	渤海证券—建行—滨海1号民生价值集合资产管理计划	10,000,833	2.90%
7	中航证券有限公司	10,000,416	2.90%
8	国泰君安证券股份有限公司	10,000,416	2.90%
9	招商证券股份有限公司	8,000,888	2.32%
10	国元证券股份有限公司	8,000,666	2.32%
合计		165,613,051	48.01%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：国泰基金管理有限公司

2、法定代表人：陈勇胜

3、总经理：金旭

4、注册资本：1.1亿元人民币

5、注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基字【1998】5号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000060090

8、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

9、股权结构：

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

10、内部组织结构及职能：

公司目前下设22个部门和2个分公司，其主要职能如下：

基金管理部：负责权益类公募基金的投资管理工作；

固定收益部：负责固定收益类公募基金的投资和研究工作；

研究开发部：负责公司的投资策略、宏观经济的研究及上市公司的研究和调研等工作；

金融工程部：负责量化投资的研究、基金的风险与绩效分析、提供数量化技术支持等工作；

交易管理部：负责公司所有产品的交易执行、管理和风险控制等相关工作；

财富管理中心：负责企业年金、专户理财和投资咨询业务的市场拓展、投资管理、产品设计、客户服务等相关工作；

基金销售部：负责基金代销机构的业务协调、基金产品的直销和代销业务等工作；

产品规划部：负责产品的基础研究及产品开发、设计、报批等工作；

国际业务部：负责国际业务的发展规划、市场拓展和管理等工作；

营销策划部：负责公司市场营销及产品品牌推广等工作；

客户服务部：负责公司的客户服务等工作；

稽核监察部：负责揭示、控制公司各项业务风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务；

运营管理部：负责公司基金和账户的估值核算、资金清算、注册登记、账户管理等工作；

信息技术部：负责公司信息系统的建设和维护等工作；

财务管理部：负责公司财务预决算及成本管理和财务分析等工作；

人力资源部：负责公司人力资源开发与管理工作；

财富大学：负责公司的各类培训工作；

总经理办公室：负责公司战略管理、办公管理及公司品牌建设等工作；

董事会办公室：负责董事会相关工作；

行政管理部：负责公司行政管理及后勤保障等工作；

渠道总部业务管理团队：负责渠道总部的管理维护工作，促进公司市场影响力和销售业绩的提升；

电子商务部（筹备）；

北京分公司：负责与当地主管机关及相关单位的联络沟通、所辖区域内基金销售等工作；

深圳分公司：负责与当地主管机关及相关单位的联络沟通以及所辖区域内基金销售工作。

11、人员情况：

截至2011年12月31日，本基金管理人共有员工238人，其中126人具有硕士学历，10人具有博士学历。

12、信息披露负责人：李峰

电话：021-38561699

13、基金管理业务情况简介：

截至2011年12月31日，国泰基金管理有限公司旗下共管理19只开放式基金、3只封闭式基金及多个社保投资组合、企业年金投资组合和特定客户资产管理计划。

14、本基金基金经理

章赞：博士，6年基金证券从业经历，曾任职于平安资产管理公司。2008年5月加盟国泰基金管理有限公司，任数量金融分析师，2010年3月至2011年5月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理；2011年3月起担任上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2011年5月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人情况

1、名称：中国银行股份有限公司

2、住所：北京市西城区复兴门内大街1号

3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

4、首次注册登记日期：1983年10月31日

5、变更注册登记日期：2004年8月26日

6、法定代表人：肖钢

7、基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

8、注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

9、存续期间：持续经营

10、联系人：唐州徽

11、联系电话：010-66594855

12、基金托管部人员情况：

截至2011年9月末，中国银行资产托管部共有员工110余人。

13、基金托管业务经营情况：

截至2011年9月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成监管稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）等128只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）一级交易商

光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、方正证券股份有限公司。

（四）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：汪棣、单峰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至2012年3月27日的资产负债表（未经审计）如下：

资产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资 产：		负 债：	
银行存款	61,528,049.07	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	97,151.00	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	97,151.00	应付证券清算款	-
基金投资	-	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	56,587.80
资产支持证券投资	-	应付托管费	11,317.56
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	86,760,010.00	应付交易费用	3,353.92
应收证券清算款	197,182,669.17	应交税费	-
应收利息	50,478.21	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	递延所得税负债	-
递延所得税资产	-	其他负债	270,758.47
其他资产	-	负债合计	342,017.75
		所有者权益：	
		实收基金	345,132,924.00
		未分配利润	143,415.70
		所有者权益合计	345,276,339.70
资产总计	345,618,357.45	负债和所有者权益总计	345,618,357.45

注：1、截至2012年3月27日，基金份额净值1.000元，基金份额总额345,132,924.00份。

2、本报告期自2012年3月15日起至2012年3月27日止。本基金合同于2012年3月15日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2012年3月27日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例(%)
权益投资	97,151.00	0.03%
其中：股票	97,151.00	0.03%
固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	86,760,010.00	25.10%
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	61,528,049.07	17.80%
其他各项资产	197,233,147.38	57.07%
合计	345,618,357.45	100.00%

（二）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,170.00	0.01%
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	71,981.00	0.02%
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业		
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	97,151.00	0.03%

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	002302	西部建设	4,900	71,981.00	0.02%
2	002108	沧州明珠	3,000	25,170.00	0.01%

（四）按券种分类的债券投资组合

截止2012年3月27日，本基金未持有债券。

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截止2012年3月27日，本基金未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	197,182,669.17
3	应收股利	-
4	应收利息	50,478.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,233,147.38

4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002302	西部建设	71,981.00	0.02%	公告重大事项

九、重大事项揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、各查文件目录

（一）中国证监会核准中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

（二）《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）法律意见书

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

国泰基金管理有限公司

二〇一二年三月二十九日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利

1、依法募集基金，办理基金备案手续；

2、依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

3、根据法律法规、基金合同、深圳证券交易所及登记结算机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回等业务的规则；

4、根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，依照基金合同获得基金管理费，以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

5、在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

6、根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

7、委托和更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并按照基金合同规定对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

8、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

9、在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

10、依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

11、按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

12、以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

13、在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

14、依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

15、选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

16、法律法规、基金合同规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

1、依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

6、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

7、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

8、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

9、依法接受基金托管人的监督；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、采取适当合理的措施使计算基金份额认购对价、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

12、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

13、严格按照《基金法