

中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

基金管理人的董事及董事会正直本报告书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2015年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人数和资产净值，并不保证基金一定盈利。

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。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰中小板300成长ETF				
场内简称	中小板成长				
基金代码	160917				
交易代码	160917				
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				
报告期末基金份额总额	34,132,524,000份				
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。				
1.股票型基金 本基金主要采用完全复制法，即根据标的指数成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股的调整而进行相应调整。但因特殊情况（如成份股停牌等）导致无法跟踪标的指数成份股时，基金管理人将根据实际情况，对股票投资组合进行调整，以降低跟踪误差。	本基金主要采用完全复制法，即根据标的指数成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股的调整而进行相应调整。但因特殊情况（如成份股停牌等）导致无法跟踪标的指数成份股时，基金管理人将根据实际情况，对股票投资组合进行调整，以降低跟踪误差。				
2.债券型基金 本基金将根据宏观经济情况，将根据风险控制的原则，以套期保值为目的，主要选择国债、交易型开放式债券型基金、货币市场基金等品种，降低组合的系统性风险。	本基金将根据宏观经济情况，将根据风险控制的原则，以套期保值为目的，主要选择国债、交易型开放式债券型基金、货币市场基金等品种，降低组合的系统性风险。				
3.货币市场基金 本基金将根据宏观经济情况，将根据风险控制的原则，以套期保值为目的，主要选择货币市场基金，以实现资产的保值增值。	本基金将根据宏观经济情况，将根据风险控制的原则，以套期保值为目的，主要选择货币市场基金，以实现资产的保值增值。				
4.其他 本基金不投资于股票、权证、可转换债券、可分离交易的可转债、资产支持证券、基金、国债期货、股票期权、股指期货、国债期货、商品期货、商品期权等金融衍生品种。	本基金不投资于股票、权证、可转换债券、可分离交易的可转债、资产支持证券、基金、国债期货、股票期权、股指期货、国债期货、商品期货、商品期权等金融衍生品种。				
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合					
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
A 农、林、牧、渔业	748,530,077	1.30			
B 矿业	472,816,000	0.62			
C 制造业	36,132,710,61	62.72			
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,216,000	0.38			
E 建筑业	4,666,490,011	8.10			
F 批发和零售业	1,032,242,12	1.79			
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-			
H 住宿和餐饮业	-	-			
I 信息传输、软件和信息技术服务业	8,487,247,959	14.73			
J 金融业	-	-			
K 房地产业	1,678,830,70	2.91			
L 租赁和商务服务业	3,127,160,98	5.43			
M 科学研究、技术服务业	-	-			
N 水、环境和公共设施管理业	-	-			
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-			
P 教育	-	-			
Q 卫生和社会工作	-	-			
R 文化、体育和娱乐业	-	-			
S 综合	-	-			
合计	56,163,243,28	98.18			
5.3 报告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	002415	海康威视	67,773	2,089,631,10	3.61
2	002006	华东软件	62,000	1,916,800,00	3.33
3	002183	华阳通	66,286	1,742,685,20	3.02
4	002230	科大讯飞	29,830	1,561,160,00	2.69
5	002460	康得新	40,072	1,528,746,60	2.66
6	002081	梦网	41,521	1,460,293,07	2.53
7	002241	歌尔声学	36,490	1,214,789,00	2.11
8	002385	大华农	47,600	1,151,920,00	2.00
9	002230	大华股份	27,476	1,004,320,00	1.74
10	002006	大禹节水	46,364	941,096,50	1.63
5.4 报告期末按投资品种分类的债券投资组合					
本基金报告期末未持有债券。					
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细					
本基金报告期末未持有债券。					
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细					
本基金报告期末未持有贵金属。					
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及投资组合					
本基金报告期末未持有权证。					
5.8 报告期末按资产配置比例的债券投资组合					
本基金报告期末未持有债券。					
5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细					
本基金报告期末未持有股票。					
5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细					
本基金报告期末未持有贵金属。					
5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及投资组合					
本基金报告期末未持有权证。					
5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。					
5.13 其他各项资产构成					
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金	2,916,76			
2	应收证券清算款	4,449,21			
3	应收红利	-			
4	应收利息	247,69			
5	应收申购款	-			
6	其他应收款	-			
7	待摊费用	-			
8	其他	-			
9	合计	7,613,66			
5.14 报告期末持有的处于待购阶段的可转换债券明细					
本基金报告期末未持有可转换债券。					
5.15 报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明					
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。					
§ 6 开放式基金份额变动					
单位:份					
报告期初基金份额总额	24,132,524,000				
报告期赎回份额	36,000,000,000				
申购基金份额总额	26,000,000,000				
报告期净申购变动	-				
报告期末基金份额总额	34,132,524,000				
5.7 基金管理人承诺以固有资金投资本基金情况					
7.1 基金管理人持有本基金额度变动情况					
本基金报告期末本基金管理人运用固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金管理人承诺以固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.3 基金管理人运用固有资金投资本基金管理人承诺以固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.4 基金管理人运用固有资金投资本基金管理人承诺以固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.5 基金管理人运用固有资金投资本基金管理人承诺以固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.6 基金管理人运用固有资金投资本基金管理人承诺以固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理人承诺以固有资金投资本基金金额：截至报告期末，本基金管理人未持有本基金。					
7.8 备查文件目录					
1. 小中板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同 2. 小中板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议 3. 关于中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金的批复 4. 报告期临时信息披露的公告 5. 法律法规要求披露的其他文件					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
8.3 检查方式					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
8.4 报告期内基金的经营情况及业绩表现分析					
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析					
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.4.2 报告期内基金的经营情况及业绩表现分析					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.5 其他需要说明的事项					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.6 公开交易方式					
4.6.1 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.6.2 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.7 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.8 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.9 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.10 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.11 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.12 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.13 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.14 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.15 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.16 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.17 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.18 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.19 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.20 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.21 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.22 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.23 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.24 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.25 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.26 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.27 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.28 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.29 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.30 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.31 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.32 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.33 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.34 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.35 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.36 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.37 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.38 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.39 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.40 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.41 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.42 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.43 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.44 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.45 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.46 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层—19层。					
4.47 公开交易的执行情况					
本基金持有人国泰基金管理有限公司办公地址——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦					