

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

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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、净值表现和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利益不受损失。

基金管理人过往业绩并不预示其未来表现,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2015年1月1日起至3月31日止。

基金简称	国泰中小盘300成长ETF
场内简称	中小成长
基金代码	150917
交易代码	150917
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年3月16日
报告期末基金份额总额	34,132,924.00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。

投资策略
1. 股票投资策略
本基金主要采用完全复制法,按照标的指数的成份股构成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。同时,本基金在追求跟踪标的指数的基础上,将综合考虑流动性、交易成本等因素,在追求跟踪标的指数的基础上,适当进行优化调整,以期获得更好的跟踪效果。

2. 债券投资策略
本基金在追求跟踪标的指数的基础上,将综合考虑流动性、交易成本等因素,在追求跟踪标的指数的基础上,适当进行优化调整,以期获得更好的跟踪效果。

3. 股指期货投资策略
本基金在追求跟踪标的指数的基础上,将综合考虑流动性、交易成本等因素,在追求跟踪标的指数的基础上,适当进行优化调整,以期获得更好的跟踪效果。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%。

风险收益特征
本基金为股票型基金,预期风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,本基金为股票型基金,预期风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2015年1月1日至2015年3月31日)
1.本期已实现收益	5,469,036.68
2.本期利润	17,116,189.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0623
4.期末基金资产净值	67,610,774.04

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	净值增长率基准差②	业绩比较基准③	收益比较基准④	①-③	②-④
过去三个月	51.25%	1.66%	51.79%	1.53%	-0.54%	0.03%

3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率区间偏离度绝对值最大值

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率区间偏离度绝对值最大值为:0.03%。

注:本基金合同生效日为2012年3月16日,本基金在三个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介
4.2 基金管理人(或基金管理人)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
徐皓	基金经理	2014-01-13	8年	徐皓先生,1978年生,毕业于复旦大学,曾任国泰基金研究员、基金经理,2014年1月加入国泰基金,任基金经理,2014年1月13日起任本基金基金经理。

注:1、上述的任职日期和离任日期均指公告中生效之日,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。

3、基金管理人(或基金管理人)简介

4.2 基金管理人(或基金管理人)简介

4.3 基金管理人(或基金管理人)简介

4.4 基金管理人(或基金管理人)简介

4.5 基金管理人(或基金管理人)简介

4.6 基金管理人(或基金管理人)简介

4.7 基金管理人(或基金管理人)简介

4.8 基金管理人(或基金管理人)简介

4.9 基金管理人(或基金管理人)简介

4.10 基金管理人(或基金管理人)简介

4.11 基金管理人(或基金管理人)简介

4.12 基金管理人(或基金管理人)简介

4.13 基金管理人(或基金管理人)简介

4.14 基金管理人(或基金管理人)简介

4.15 基金管理人(或基金管理人)简介

4.16 基金管理人(或基金管理人)简介

4.17 基金管理人(或基金管理人)简介

4.18 基金管理人(或基金管理人)简介

4.19 基金管理人(或基金管理人)简介

4.20 基金管理人(或基金管理人)简介

4.21 基金管理人(或基金管理人)简介

4.22 基金管理人(或基金管理人)简介

4.23 基金管理人(或基金管理人)简介

4.24 基金管理人(或基金管理人)简介

4.25 基金管理人(或基金管理人)简介

4.26 基金管理人(或基金管理人)简介

4.27 基金管理人(或基金管理人)简介

4.28 基金管理人(或基金管理人)简介

4.29 基金管理人(或基金管理人)简介

4.30 基金管理人(或基金管理人)简介

4.31 基金管理人(或基金管理人)简介

4.32 基金管理人(或基金管理人)简介

4.33 基金管理人(或基金管理人)简介

4.34 基金管理人(或基金管理人)简介

4.35 基金管理人(或基金管理人)简介

4.36 基金管理人(或基金管理人)简介

4.37 基金管理人(或基金管理人)简介

4.38 基金管理人(或基金管理人)简介

4.39 基金管理人(或基金管理人)简介

4.40 基金管理人(或基金管理人)简介

4.41 基金管理人(或基金管理人)简介

4.42 基金管理人(或基金管理人)简介

4.43 基金管理人(或基金管理人)简介

4.44 基金管理人(或基金管理人)简介

4.45 基金管理人(或基金管理人)简介

4.46 基金管理人(或基金管理人)简介

4.47 基金管理人(或基金管理人)简介

4.48 基金管理人(或基金管理人)简介

4.49 基金管理人(或基金管理人)简介

4.50 基金管理人(或基金管理人)简介

4.51 基金管理人(或基金管理人)简介

4.52 基金管理人(或基金管理人)简介

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

信息披露

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

【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

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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、净值表现和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利益不受损失。

基金管理人过往业绩并不预示其未来表现,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2015年1月1日起至3月31日止。

基金简称	国泰中小盘300成长ETF
场内简称	中小成长
基金代码	150917
交易代码	150917
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年3月16日
报告期末基金份额总额	34,132,924.00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。

投资策略
1. 股票投资策略
本基金主要采用完全复制法,按照标的指数的成份股构成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。同时,本基金在追求跟踪标的指数的基础上,将综合考虑流动性、交易成本等因素,在追求跟踪标的指数的基础上,适当进行优化调整,以期获得更好的跟踪效果。

2. 债券投资策略
本基金在追求跟踪标的指数的基础上,将综合考虑流动性、交易成本等因素,在追求跟踪标的指数的基础上,适当进行优化调整,以期获得更好的跟踪效果。

3. 股指期货投资策略
本基金在追求跟踪标的指数的基础上,将综合考虑流动性、交易成本等因素,在追求跟踪标的指数的基础上,适当进行优化调整,以期获得更好的跟踪效果。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%。

风险收益特征
本基金为股票型基金,预期风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,本基金为股票型基金,预期风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2015年1月1日至2015年3月31日)
1.本期已实现收益	5,469,036.68
2.本期利润	17,116,189.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0623
4.期末基金资产净值	67,610,774.04

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	净值增长率基准差②	业绩比较基准③	收益比较基准④	①-③	②-④
过去三个月	51.25%	1.66%	51.79%	1.53%	-0.54%	0.03%

3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率区间偏离度绝对值最大值

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率区间偏离度绝对值最大值为:0.03%。

注:本基金合同生效日为2012年3月16日,本基金在三个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介
4.2 基金管理人(或基金管理人)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
徐皓	基金经理	2014-01-13	8年	徐皓先生,1978年生,毕业于复旦大学,曾任国泰基金研究员、基金经理,2014年1月加入国泰基金,任基金经理,2014年1月13日起任本基金基金经理。

注:1、上述的任职日期和离任日期均指公告中生效之日,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。

3、基金管理人(或基金管理人)简介

4.2 基金管理人(或基金管理人)简介

4.3 基金管理人(或基金管理人)简介

4.4 基金管理人(或基金管理人)简介

4.5 基金管理人(或基金管理人)简介

4.6 基金管理人(或基金管理人)简介

4.7 基金管理人(或基金管理人)简介

4.8 基金管理人(或基金管理人)简介

4.9 基金管理人(或基金管理人)简介

4.10 基金管理人(或基金管理人)简介

4.11 基金管理人(或基金管理人)简介

4.12 基金管理人(或基金管理人)简介

4.13 基金管理人(或基金管理人)简介

4.14 基金管理人(或基金管理人)简介

4.15 基金管理人(或基金管理人)简介

4.16 基金管理人(或基金管理人)简介

4.17 基金管理人(或基金管理人)简介

4.18 基金管理人(或基金管理人)简介

4.19 基金管理人(或基金管理人)简介

4.20 基金管理人(或基金管理人)简介

4.21 基金管理人(或基金管理人)简介

4.22 基金管理人(或基金管理人)简介

4.23 基金管理人(或基金管理人)简介

4.24 基金管理人(或基金管理人)简介

4.25 基金管理人(或基金管理人)简介

4.26 基金管理人(或基金管理人)简介

4.27 基金管理人(或基金管理人)简介

4.28 基金管理人(或基金管理人)简介

4.29 基金管理人(或基金管理人)简介

4.30 基金管理人(或基金管理人)简介

4.31 基金管理人(或基金管理人)简介

4.32 基金管理人(或基金管理人)简介

4.33 基金管理人(或基金管理人)简介

4.34 基金管理人(或基金管理人)简介

4.35 基金管理人(或基金管理人)简介

4.36 基金管理人(或基金管理人)简介

4.37 基金管理人(或基金管理人)简介

4.38 基金管理人(或基金管理人)简介

4.39 基金管理人(或基金管理人)简介

4.40 基金管理人(或基金管理人)简介

4.41 基金管理人(或基金管理人)简介

4.42 基金管理人(或基金管理人)简介

4.43 基金管理人(或基金管理人)简介

4.44 基金管理人(或基金管理人)简介

4.45 基金管理人(或基金管理人)简介

4.46 基金管理人(或基金管理人)简介