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、申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、申银万国、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—国都安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

章赟：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、大成蓝筹稳健混合、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、嘉实价值优势股票型、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、备查文件目录

（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》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购的基金份额或赎回的对价；
16、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
17、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22、法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利

1、依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
2、依照基金合同的约定获得基金托管费；
3、监督基金管理人对本基金的投资运作；
4、在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
5、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；
6、法律法规、基金合同规定的其他权利。

（四）基金托管人的义务

1、安全保管基金财产；
2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；
5、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
6、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
7、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
8、按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
9、保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
10、根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
11、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
12、保存基金份额持有人名册；
13、复核基金管理人计算的基金资产净值；
14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；
16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17、按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
18、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
19、因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
20、法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（五）基金份额持有人的权利

1、分享基金财产收益；
2、参与分配清算后的剩余基金财产；
3、依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4、按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7、监督基金管理人的投资运作；
8、对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9、法律法规、基金合同规定的其他权利。

（六）基金份额持有人的义务

1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2、缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；
3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4、不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
5、执行基金份额持有人大会的决议；
6、返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
7、遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
8、法律法规及基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。本基金的基金份额持有人持有的每一基金份额为一参会份额，每一参会份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和联接基金（即“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”）的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（二）有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1、终止基金合同；
2、转换基金运作方式；
3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
4、更换基金管理人、基金托管人；
5、变更基金类别；
6、变更基金投资目标、范围或策略；
7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
8、本基金与其他基金合并；
9、终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
10、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的基金合同变更等其他事项；
11、法律法规和中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率；
2、法律法规要求增加的基金费用的收取；
3、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率和收费方式、调低赎回费率；
4、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
5、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
6、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
7、基金管理人、证券交易所、登记结算机构在法律法规或中国证监会许可的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则；
8、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

4、单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1、会议召开的时间、地点、方式；
2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
4、会务常设联系人姓名、电话；
5、权益登记日；
6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的提交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%（含50%，下同）以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；
4、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；
5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

（5）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

若召集人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所持表决权的50%以上选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日在公证机关的公证下统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

（八）表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

（2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人的授权代表担任；如果基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人（如果基金管理人为召集人，基金托管人为监督人；如果基金托管人为召集人，基金管理人为监督人）派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

4.如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（十一）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）收益分配原则

1、当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配；
2、在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次基金收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；
3、本基金收益分配采取现金分红方式；
4、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
5、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
6、每一基金份额享有同等分配权；
7、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日；
8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率，并计算基金净值增长率与标的指数净值增长率的差额，当差额超过1%时，基金管理人有权进行收益分配。

2、基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

3、根据前述收益分配原则确定收益评价日本基金的可分配收益、收益分配比例及收益分配数额。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益评价日的基金可分配收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

（五）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、标的指数许可使用费；
4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
5、基金合同生效以后的信息披露费用；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
8、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
9、基金上市费及年费；
10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.5%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、标的指数许可使用费

在通常情况下，标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.03%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.03%÷当年天数
H 为每日应计提的标的指数许可使用费
E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数许可使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数许可使用费收取下限为每季度5万元，即不足5万元时按照5万元收取。

指数许可使用费每日计提，按季支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于每季度结束后10个工作日内从基金财产中一次性支付。

因标的指数使用许可授权方的原因，标的指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的收取标准发生变更的，基金管理人可对上述标的指数许可使用费进行相应变更。

4、本条第（一）款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）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。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。如法律法规或监管机构允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；
（2）向他人贷款或者提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
（8）当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。对于因上述第（5）、（6）项情形导致无法投资的标的指数成份股和备选成份股，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

2、基金投资组合比例限制

（1）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（2）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

（3）本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%；

（4）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（5）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

（a）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

（b）在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（c）在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（d）基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（e）在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（f）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（6）法律法规和基金合同规定的其他限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。如法律法规或监管部门变更上述限制性规定，以变更后的规定为准。

由于证券期货市场波动、上市公司合并、标的指数调整或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

基金份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（二）基金资产净值的公告方式

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；
2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
（4）对基金财产进行评估和变现；
（5）制作清算报告；
（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
（7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
（8）对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；
（2）交纳所欠税款；
（3）清偿基金债务；
（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

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