纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

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

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]262号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。

本基金投资于证券期货市场,基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括:(1)本基金特有的风险,主要包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资人参考IOPV做出投资决策的风险和IOPV计算错误的风险、第三方机构服务的风险、管理风险等;(2)投资风险,主要包括市场风险等;(3)运作风险,主要包括操作风险等;(4)不可抗力风险;等等。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%。本基金属于股票型基金,预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

在目前结算规则下,投资人当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回,即T日申购的基金份额,T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。当日买入的基金份额,同日可以赎回,但不得卖出。由于登记结算机构对现金替代采取非净额结算交收模式,当投资人赎回申请被登记结算机构确认后,被赎回的基金份额即被记减,但此时投资人尚未收到赎回现金替代款。投资人投资本基金时需具有证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

投资人一旦认购、申购或赎回本基金,即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代的交收方式已经认可。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号《招募说明书的内容与格式》》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称"《试行办法》")、《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》(以下简称"《通知》")等有关法律法规以及《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1.基金或本基金:指纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

2.基金管理人:指国泰基金管理有限公司

3.基托管人:指中国建设银行股份有限公司

4.基金合同:指《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5.托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6.招募说明书或本招募说明书:指《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7.基金份额发售公告:指《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告》

8.法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9.《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10.《销售办法》:指中国证监会于2011年6月9日颁布、自同年10月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11.《信息披露办法》:指中国证监会于2004年6月8日颁布、自同年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12.《运作办法》:指中国证监会于2004年6月29日颁布、自同年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13.《试行办法》:指中国证监会于2007年6月18日公布、自同年7月5日起实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及发布机关对其不时做出的修订

14.中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15.银行业监督管理机构:指中国银行业监督管理委员会

16.国家外汇局:指国家外汇管理局或其授权的代表机构

17.交易型开放式指数证券投资基金:指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金",亦称"ETF(Exchange Traded Fund)"或者"ETF基金"

18.联接基金:指将其绝大部分基金财产投资于本基金,与本基金的投资目标相似,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金

19.基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

20.个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

21.机构投资者:指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

22.合格境外机构投资者:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

23.投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

24.基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

25.基金销售业务:指基金管理人或代销机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回等业务

26.销售机构:指直销机构和代销机构

27.直销机构:指国泰基金管理有限公司

28.代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,包括发售代理机构和申购赎回代理券商

29.基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

30.发售代理机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

31.申购赎回代理券商:指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司,又称为"代办证券公司"

32.登记结算业务:指《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

33.登记结算机构:指中国证券登记结算有限责任公司

34.境外托管人:指符合法律法规规定的条件,接受基金托管人委托,负责本基金境外资产托管业务的境外金融机构;境外托管人由基金托管人选择、更换和撤销

35.基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

36.基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

37.存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38.工作日:指上海证券交易所的正常交易日

39.开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日(即上海证券交易所和美国纳斯达克证券交易所的共同交易日)

40.T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

41.T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

42.交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

43.认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

44.发售:指在基金募集期内,销售机构向投资人销售本基金基金份额的行为

45.申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

46.赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为申购赎回清单所规定对价的行为

47.巨额赎回:若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回

48.申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

49.申购对价:指投资人申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额及其他对价

50.赎回对价:指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的现金替代、现金差额及其他对价

51.组合证券:指本基金标的指数成份股中所包含的全部或部分证券

52.标的指数:指NASDAQ OMX集团编制并发布的纳斯达克100指数及其未来可能发生的变更

53.完全复制法:指一种跟踪指数的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券,并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组合,达到复制指数的目的

54.现金替代:指申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金

55.现金差额:指最小申购、赎回单位的资产净值与按T日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的最小申购、赎回单位数量计算

56.最小申购、赎回单位:指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资人申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

57.基金份额参考净值:指中证指数有限公司在开市后根据当日的申购赎回清单和中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价,计算并通过上海证券交易所发布的基金份额参考净值,简称IOPV

58.预估现金部分:指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值,预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结

59.指定交易:指《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的"全面指定交易"

60.基金份额折算:指基金管理人根据基金运作的需要,在基金资产净值不变的前提下,按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值

61.元:指人民币元

62.基金利润:指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额

63.收益评价日:指基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之基准日

64.基金净值增长率:指收益评价日基金份额净值与基金上市前一开放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)

65. 标的指数同期增长率:指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一开放日标的指数收盘值之比减去1乘以100%(经汇率调整,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)

66.基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

67.基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

68.基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

69.基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

70.货币市场工具:指银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的金融工具

71.指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

72.不可抗力:指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免的客观情况

三、风险揭示

本基金的投资运作中可能出现的风险包括本基金特有的风险、投资风险、运作风险及不可抗力风险四类,其中,本基金特有的风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资者参考IOPV做出投资决策的风险和IOPV计算错误的风险、投资者参考IOPV做出投资决策;投资风险主要包括市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、衍生品风险、金融模型风险、信用风险等;运作风险主要包括操作风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险、证券借贷/正回购/逆回购风险等。

(一)本基金特有的风险

1.标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2.标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动,导致指数波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

3.基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离:

(1)由于标的指数调整成份股或变更编制方法,使ETF基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差;

(2)由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化,使ETF基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差;

(3)由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使ETF基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差;

(4)成份股派发现金红利、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率,从而产生跟踪偏离度;

(5)由于基金投资过程中的证券交易成本,以及基金管理费和托管费的存在,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差;

(6)在ETF基金指数化投资过程中,基金管理人的管理能力,例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等,都会对ETF基金的收益产生影响,从而影响ETF基金对标的指数的跟踪程度;

(7)如果指数编制机构发布的指数数据出现错误,基金投资组合的收益率与标的指数的收益率也可能发生偏离;

(8)其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同;基金申购与赎回带来的现金变动等。

4.标的指数变更的风险

尽管可能性很小,但根据基金合同规定,如出现变更标的指数的情形,本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变,投资组合将随之调整,基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致,投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

5.基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险

因涉及境外市场股票的买卖,在投资人申购、赎回本基金时,本基金组合证券中全部或部分证券需以一定数量的现金进行现金替代,并由基金管理人按照招募说明书的规定代理申赎投资人进行相关证券买卖,投资人需承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性(含汇率波动风险)。

6.基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金的运作力求使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内,但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响,存在不同于基金份额净值的情形,即存在价格折溢价的风险。

7.退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市,或被基金份额持有人大会决议提前终止上市,导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

8.申购失败的风险

如果投资人申购时未能提供符合要求的申购对价,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资人的申购申请,则投资人的申购申请失败。此外,如果基金可用的外汇额度不足,申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约,投资人的申购申请也可能失败。

9.赎回失败的风险

如果投资人赎回时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,或者投资人在登记结算机构办理基金份额交收时持有的符合要求的基金份额不足,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资人的赎回申请,则投资人的赎回申请失败。另外,基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购时并持有的基金份额无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

10.投资人参考IOPV做出投资决策的风险和IOPV计算错误的风险

IOPV与实时的基金份额净值存在差异,IOPV计算可能出现错误,投资人若参考IOPV进行投资决策可能导致损失。

11.第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:

(1)受多种因素影响,申购赎回代理券商代理申购、赎回业务可能受到限制、暂停或终止,从而影响投资人申购、赎回。

(2)登记结算机构可能调整结算制度,从而对投资人基金份额、资金等的结算方式发生变化,制度调整可能给投资人带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3)证券交易所、期货交易所、证券与期货登记结算机构、申购赎回代理券商、基金托管人及其他代理机构可能违约,导致基金或投资人利益受损的风险。

12.管理风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资人利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中,可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险,例如,申购赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

(二)投资风险

1.市场风险:本基金投资于海外市场,面临海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂,包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等,都将影响基金净值的升跌。此外,基金主要投资的美国市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定,因此美国市场证券的每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌,从而带来投资风险的增加。

2.政府管制风险:在特殊情况下,基金所投资市场有可能面临政府管制措施,包括对货币兑换进行限制、限制资本外流、征收高额税收等,会对基金投资造成影响。

3.监管风险:由于监管层或监管模式出现非预期的变动,某些已经存在的或者运作的交易可能被新的监管层或监管体系认定为非法交易,或受到更严格的管理,将导致基金运作承受监管风险。基金运作可能被迫进行调整,由此可能对基金净值产生影响。

(下转B18版)

纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告

重要提示

1.纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会证监许可[2013]262号文核准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2.本基金为交易型开放式指数证券投资基金。

3.本基金的管理人为国泰基金管理有限公司(以下简称"本公司"),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行"),境外托管人为道富银行(STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY),登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5.本基金自2013年4月15日至2013年4月19日进行发售。投资人可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。其中,通过基金管理人进行网下现金认购的日期为2013年4月15日至2013年4月19日,通过发售代理机构进行网下现金认购的日期为2013年4月15日至2013年4月19日,网上现金认购的日期为2013年4月17日至2013年4月19日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,我司将作出相应调整并及时公告。

6.募集规模及规模控制方案

基金管理人将在中国证监会和国家外汇局核准的额度(美元额度需折算为人民币)内设定本基金募集规模上限。

在国家外汇局核准的外汇额度范围内,本基金募集期内的预定募集规模为5亿美元(折合31亿元人民币)。

本基金在募集期内最终确认的有效认购金额拟不超过5亿美元(折合31亿元人民币)(不包括利息)。在募集期内的任何一日(包括首日),若预计当日的有效认购申请金额(不包括利息)接近、达到或超过5亿美元(折合31亿元人民币)时,基金管理人将在募集期内接受的有效认购金额(不包括利息)接近、达到或超过5亿美元(折合31亿元人民币),本基金管理人将于次日在本公司网站上公告提前结束发售,并自公告日起不再接受认购申请。

若在募集期内接受的有效认购金额(不包括利息)未超过5亿美元(折合31亿元人民币),则对所有有效认购申请全部予以确认;若在募集期内接受的有效认购金额(不包括利息)超过5亿美元(折合31亿元人民币),则最后一个发售日的有效认购申请采用"比例确认"的原则给予部分确认,未确认部分的认购款项退还给投资人,之前提交的有效认购申请全部予以确认。

本基金管理人在基金募集期间不得调整该募集规模上限。

基金合同生效后,基金的资产规模不受上述限制,但基金管理人有权根据基金的外汇额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

7.本基金网上现金认购通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

8.本基金网下现金认购通过基金管理人及其指定的发售代理机构办理。

9.投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

10.网上现金认购以基金份额申请,单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份;网下现金认购以基金份额申请,投资人单笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人可以多次认购,累计认购份额不设上限。如发生比例配售部分确认,认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。

11.投资人在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购、网下现金认购申请提交后均不得撤销。

12.销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构的确认结果为准。

13.本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明,投资人欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2013年4月10日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.gtfund.com),投资人亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集相关事宜。

14.募集期内,本基金还有可能新增或者变更发售代理机构,敬请留意近期本公司及各发售代理机构的公告,或按打本公司及各发售代理机构客户服务电话咨询。

15.本公司可根据基金销售情况适当延长或缩短基金销售时间,并及时公告。

16.投资人如有任何问题,可拨打本公司客户服务电话(400-888-8688),基金托管人中国建设银行客服电话(95533)以及各发售代理机构客户服务电话。

17.基金管理人可综合各种情况依法及依据基金合同对募集安排做适当调整。

18.基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商,报上海证券交易所,经有关部门认可后,由上海证券交易所公告。本基金上市后,指定交易未在申购赎回代理券商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖,如投资人需进行本基金的申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

19.风险提示

证券投资基金(以下简称"基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的预期风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的预期风险也越大。

本基金投资于证券期货市场,基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括:(1)本基金特有的风险,主要包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资人参考IOPV做出投资决策的风险和IOPV计算错误的风险、第三方机构服务的风险、管理风险等;(2)投资风险,主要包括市场风险等;(3)运作风险,主要包括操作风险等;(4)不可抗力风险;等等。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%。本基金属于股票型基金,预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

投资人应当认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过本基金管理人或发售代理机构购买本基金,发售代理机构名单详见本公告。投资人按1.00元初始面值购买基金份额以后,有可能面临基金份额净值跌破1.00元,从而遭受损失的风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

20.本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次募集的基本情况

(一)基金名称和基金代码

基金名称:纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

基金简称:国泰纳斯达克100(QDII-ETF)

基金认购代码:513103

基金上市代码:513100

基金申赎赎回代码:513101

(二)基金类型

境外股票指数基金

(三)基金运作方式

交易型开放式

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金份额初始面值

基金份额的初始面值为人民币1.00元。

(六)投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

(七)募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(八)有效认购的确认方式

在国家外汇局核准的外汇额度范围内,本基金在募集期内最终确认的有效认购金额拟不超过5亿美元(折合31亿元人民币)(不包括利息)。在募集期内的任何一日(包括首日),若预计当日的有效认购申请金额(不包括利息)接近、达到或超过5亿美元(折合31亿元人民币),本基金管理人将于次日在本公司网站上公告提前结束发售,并自公告日起不再接受认购申请。

若在募集期内接受的有效认购金额(不包括利息)未超过5亿美元(折合31亿元人民币),则对所有有效认购申请全部予以确认;若在募集期内接受的有效认购金额(不包括利息)超过5亿美元(折合31亿元人民币),则最后一个发售日的有效认购申请采用"比例确认"的原则给予部分确认,未确认部分的认购款项退还给投资人,之前提交的有效认购申请全部予以确认。

如发生部分确认,申请确认比例的计算如下,计算结果保留到百分比整数位:

投资人认购申请确认金额=当日提交的有效认购申请金额×认购申请确认比例。

当发生部分确认时,认购费按照认购申请确认金额所对应的认购费率计算,而且认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。认购申请确认金额以四舍五入的方法保留到小数点后两位。

如发生比例配售,认购申请确认比例将于募集结束日起的2个工作日内予以公告。

(九)销售机构

1.发售主协调人:具体名单详见本份额发售公告"八(三)1.发售协调人"。

2.发售副主协调人:具体名单详见本份额发售公告"八(三)1.发售协调人"。

3.网下现金认购直销机构:国泰基金管理有限公司

4.网下现金认购发售代理机构:具体名单详见本份额发售公告"八(三)3.网下现金发售代理机构"。

5.网上现金认购发售代理机构:具体名单详见本份额发售公告"八(三)4.网上现金发售代理机构"。

(十)募集时间安排和基金合同生效

本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自2013年4月15日至2013年4月19日进行发售。投资人可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。其中,通过基金管理人进行网下现金认购的日期为2013年4月15日至2013年4月19日,通过发售代理机构进行网下现金认购的日期为2013年4月15日至2013年4月19日,网上现金认购的日期为2013年4月17日至2013年4月19日。如上海证券交易所或基金管理人对认购时间作出调整,将另行公告。

本基金自基金份额发售之日起3个月内,基金募集金额不少于2亿人民币,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售,且基金募集达到基金备案条件,基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

(十一)募集资金利息的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额归投资人所有,其中利息转份额以基金管理人的记录为准;网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后产生的利息,计入基金财产,不折算为投资人基金份额。

二、发售方式及相关规定

(一)发售方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购两种方式。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购;网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。

(二)认购费率

认购费用由投资人承担,不超过认购份额的0.8%,认购费率如下表所示:

认购份额M	认购费率
M<50万份	0.8%
50万份≤M<100万份	0.5%
M≥100万份	1000元/笔

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用,投资人申请重复现金认购的,须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。发售代理机构办理网上现金认购和网下现金认购时可参照上表费率结构收取一定的佣金。

(三)认购金额的计算

1.通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购佣金和认购金额的计算公式为:

认购佣金=认购份额×佣金比率

认购金额=认购份额×(1+佣金比率)

认购佣金由发售代理机构在投资人认购确认时收取,投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例:某投资人到某发售代理机构网点认购1,000份本基金,该发售代理机构确认的佣金比率为0.8%,则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金=1,000×0.8%=8元

认购金额=1,000×(1+0.8%)=1,008元

即投资人需准备1,008元资金,方可认购到1,000份本基金基金份额。

2.通过基金管理人进行网下现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购费用和认购金额的计算公式为:

认购费用=认购份额×认购费率

认购金额=认购份额×(1+认购费率)

总认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/基金份额初始面值

认购费用由基金管理人在投资人认购申请时收取,投资人需以现金方式交纳认购费用。

例:某投资人到基金管理人直销中心认购100,000份基金份额,认购金额产生的利息为10元,则需准备的资金金额计算如下:

认购费用=100,000×0.8%=800元

认购金额=100,000×(1+0.8%)=100,800元

总认购份额=100,000+10/1.00=100,010份

即投资人若通过基金管理人认购本基金100,000份,需准备100,800元资金,假定该笔认购金额产生利息10元,则投资人可得到100,010份本基金基金份额。

3.通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算:同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

三、投资者开户

投资人认购本基金时需具有上海证券账户,上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

1.如投资人需新开立上海证券账户,则应注意:

开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2.如投资人已开立上海证券账户,则应注意:

(1)如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

(2)当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购,建议投资人在进行认购的1个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

四、网上现金认购

1.认购时间:2013年4月17日至2013年4月19日上海证券交易所交易时间。

2.认购限额:网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资人可以多次认购,累计认购份额不设上限。

3.认购手续:

(1)开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户,办理指定交易或转指定交易在本基金的发售代理机构。

(2)在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3)投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托,可多次申报,申报一经确认,认购资金即被冻结。

五、网下现金认购

(一)直销机构

1.认购时间:2013年4月15日至2013年4月19日(周六、周日不受理),具体业务办理时间为9:30-16:00。

2.认购限额:网下现金认购以基金份额申请。投资人单笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人可以多次认购,累计认购份额不设上限。

3.认购手续:

投资者须先开立上海证券交易所的A股账户或基金账户,然后到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

①个人投资者提供有效身份证件原件及复印件;

②机构投资者提供机构营业执照复印件,事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件,业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书,印鉴卡一式三份;

③上海证券交易所A股股东代码卡或证券投资基金账户代码卡、个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证,以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户时登记的证件一致;

④个人投资者提供指定银行账户的证明原件及复印件,机构投资者提供指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件(或指定银行出具的开户证明)。个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证,以证明所提交的