

国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金  
(中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金)

2015 年 9 月 30 日

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：二〇一五年十月二十六日

## § 1 重要提示

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 10 月 21 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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来。中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2015 年 6 月 29 日起至 2015 年 7 月 28 日 17:00 止，根据中小成长 ETF 基金份额持有人大会 2015 年 7 月 29 日决议通过的《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，基金管理人于 2015 年 7 月 30 日发布《国泰基金管理有限公司关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，并向深圳证券交易所申请终止中小成长 ETF 基金的上市交易，获得深圳证券交易所《终止上市同意书》（深证上[2015]402 号）同意。中小成长 ETF 基金的终止上市日为 2015 年 8 月 27 日，即在 2015 年 8 月 26 日深圳证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人享有中小成长 ETF 终止上市后的相关权利。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、中国证监会《关于准予中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》和《国泰基金管理有限公司关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等的有关规定，《国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》自 2015 年 8 月 27 日起失效，《国泰国证新能源汽

车指数分级证券投资基金基金合同》于同一起生效，同时本基金更名为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原中小板 300 成长交易型开放式证券投资基金报告期自 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 8 月 26 日止，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金报告期自 2015 年 8 月 27 日起至 2015 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

基金简称	国泰国证新能源汽车指数分级
场内简称	新汽车
基金主代码	160225
交易代码	160225
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月27日
报告期末基金份额总额	287, 100, 501. 05份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组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而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、股指期货投资策略</p>

	<p>本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，坚持价值投资理念，把握市场交易机会。在严格遵守法律法规的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p>			
<p>业绩比较基准</p>	<p>国证新能源汽车指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p>			
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰新汽车份额、新汽车A份额、新汽车B份额。其中国泰新汽车份额为普通的股票型指数基金份额，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；新汽车A份额的预期风险和预期收益较低；新汽车B份额采用了杠杆式的结构，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。</p>			
<p>基金管理人</p>	<p>国泰基金管理有限公司</p>			
<p>基金托管人</p>	<p>中国银行股份有限公司</p>			
<p>下属分级基金的基金简</p>	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 33%; text-align: center;">新汽车</td> <td style="width: 33%; text-align: center;">新汽车 A</td> <td style="width: 33%; text-align: center;">新汽车 B</td> </tr> </table>	新汽车	新汽车 A	新汽车 B
新汽车	新汽车 A	新汽车 B		

称			
下属分级基金的场内简称	新汽车	新汽车 A	新汽车 B
下属分级基金的交易代码	160225	150357	150358
报告期末下属分级基金的份额总额	62, 837, 568. 05 份	112, 131, 466. 00 份	112, 131, 467. 00 份
风险收益特征	具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；	新汽车 A 份额的预期风险和预期收益较低；	新汽车 B 份额采用了杠杆式的结构，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

## 2.2 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
交易代码	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
报告期末基金份额总额	5, 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	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组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而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法</p>

	<p>按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金的标的指数为中小板300 成长指数。</p> <p>中小板300 成长指数（简称SME300 成长）由深圳证券交易所编制并发布。在中小板300 指数样本股中，综合考虑主营业务收入增长率、净利润增长率、净资产收益率三个成长指标，选择前100 只最具成长风格的股票构成中小板300 成长指数成份股，以刻画中小板成长股的整体运行状况。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人</p>

	认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券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	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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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8月27日-2015 年9月30日)	报告期 (2015年7月1日-2015 年8月26日)
1.本期已实现收益	-504,752.75	-1,335,652.09
2.本期利润	-1,285,655.33	-1,568,161.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0303	-0.1155
4.期末基金资产净值	287,107,098.19	9,586,533.50
5.期末基金份额净值	1.0000	1.868

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 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

(报告期: 2015年8月27日-2015年9月30日)

##### 3.2.1.1 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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年8月27日—2015年9月30日	3.31%	2.64%	9.82%	3.87%	-6.51%	-1.23%

注: 1) 自2015年8月27日起中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金。

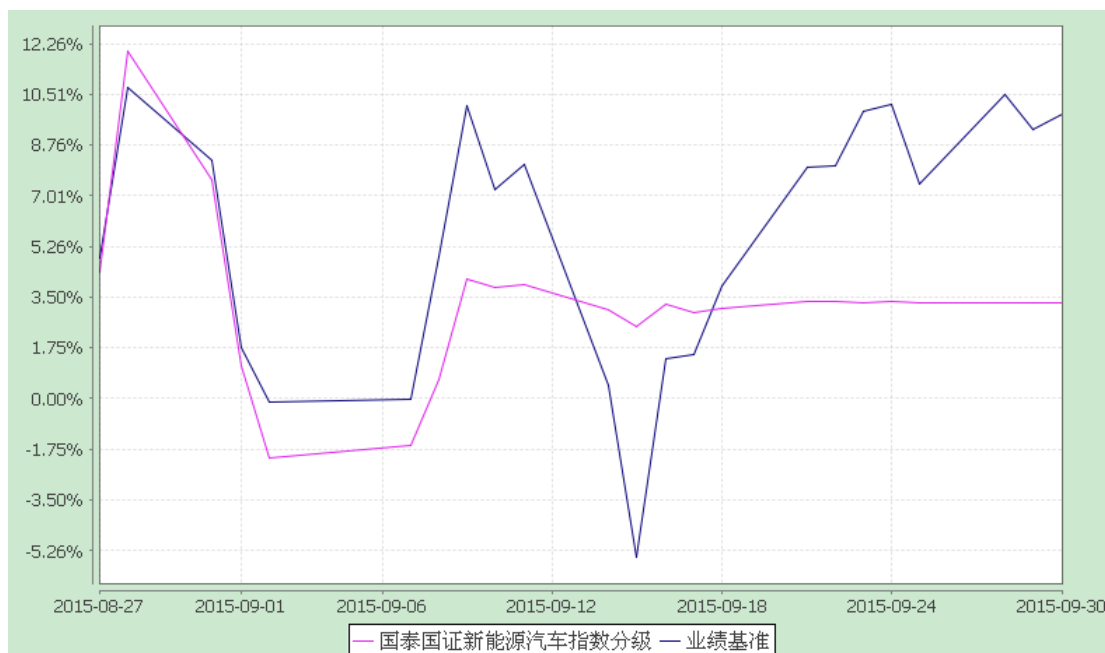
2) 本基金已于2015年8月27日起, 对所持有的长期停牌股票等估值日没有市价, 且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的股票, 估值方法由按交易所收盘价调整为指数收益法。

3) 本基金采用还原后的单位净值作为期初数来计算本季度的净值增长率, 期初净值已按国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的估值方法进行计算。

##### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015年8月27日-2015年9月30日)





注：1) 本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，截止至 2015 年 9 月 30 日，本基金运作时间未满一年。  
 2) 本基金的建仓期为 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.2 中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2015年7月1日-2015年8月26日)

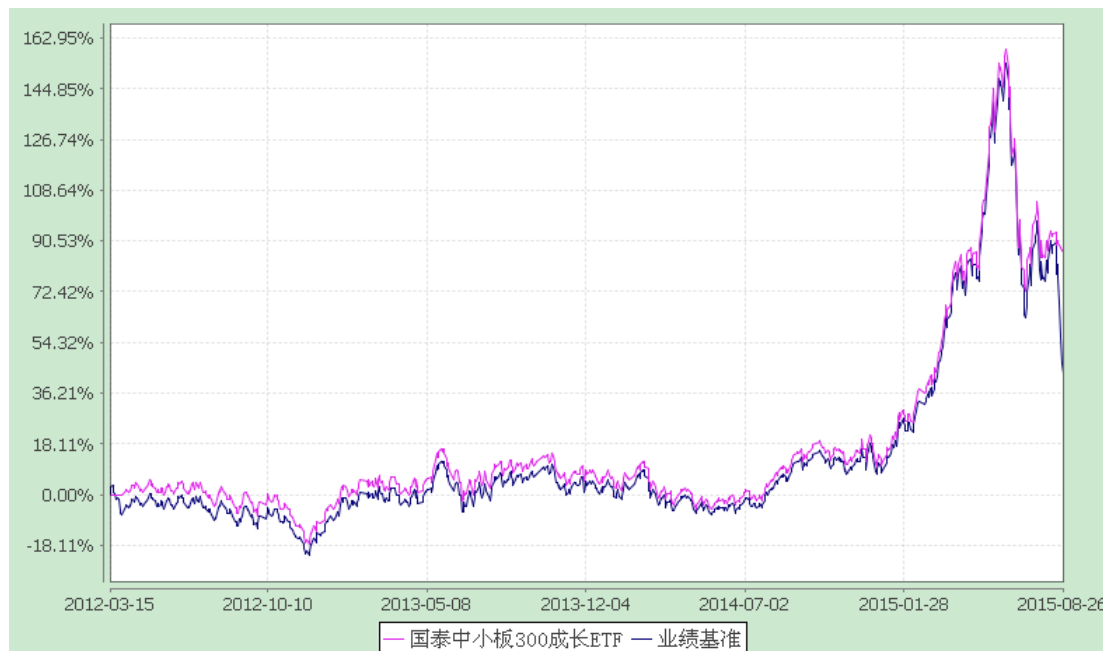
#### 3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年7月1日—2015年8月26日	-5.80%	2.30%	-27.42%	3.34%	21.62%	-1.04%

注：1) 自2015年8月27日起中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金。  
 2) 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金对所持有的长期停牌股票等估值日没有市价,且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的股票,估值方法由按交易所收盘价调整为指数收益法。

### 3.2.2.2 自基金合同生效日至 2015 年 8 月 26 日以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2012 年 3 月 15 日-2015 年 8 月 26 日)



注：本基金合同生效日为 2012 年 3 月 15 日。本基金在 3 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐皓	本基金的基金经理（由国泰国证中小板 300 成长 ETF 转型）、	2015-08-27	-	8 年	硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师（国家一级）。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010 年 5 月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011 年 6 月至 2014 年 1 月担任上证 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

	<p>国泰 中小 板 300 成长 ETF 联接、 国泰 纳斯 达克 100 指 数 (QDII )、国 泰纳 斯达 克 100 (QD II-ET F)、 国泰 国证 有色 金属 行业 指数 分级、 国泰 国证 房地 产行 业指 数分 级的 基金 经理</p>				<p>金联接基金及国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理助理，2012 年 3 月至 2014 年 1 月兼任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、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基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 8 月 26 日任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2014 年 6 月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2014 年 11 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金和纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 8 月 27 日起任国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（由国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型）的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国泰中小板 300 成长 ETF:

2015 年三季度初，上证指数继续连续大幅暴跌，杠杆资金相互踩踏，一系列的救市利好政策也没能令指数立即企稳，大量股票连续跌停或停牌，市场情绪悲观到冰点，直到 3500 点大盘方企稳后并开始技术性反弹。上攻 4200 点无效后，

8 月下旬又连续杀跌，直到 2850 点后于季末震荡于 3100 点一带。

本轮的深幅调整，为系统性杀跌行情，各板块、主题难有幸免。由于本季度中旬开始，本基金开始筹划转型并逐步减仓，其间仓位较轻，避免了区间净值的大幅回吐。从本基金跟踪的中小成长指数 399602 的全年走势以及本基金最终的净值表现来看，表现十分优异。

作为完全跟踪标的指数的被动型基金，由于三季度遭遇成份股连续大幅下跌以及停牌，叠加后期的减仓操作，本基金获得了较大超额收益但对跟踪误差有一定影响。

国泰国证新能源汽车分级：

本基金由 159917 中小成长 ETF 转型而来，原成份股停牌股复牌后相继卖出，经过特殊申购期后规模有较大增长，目前尚在建仓期内，后续会根据基金合同规定在建仓期内完成建仓并有效跟踪标的指数。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰新能源汽车自基金合同生效日起至本季末的净值增长率为 3.31%，同期业绩比较基准收益率为 9.82%。

国泰中小成长 ETF 自 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 8 月 26 日的净值增长率为 -5.80%，同期业绩比较基准收益率为 -27.42%。

#### 4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国泰中小板 300 成长 ETF：

本轮暴跌后，国家维稳救市，危机及系统性风险解除，杠杆出清使市场更加规范健康，股价将逐渐向企业价值回归，与经济转型关联密切的板块有望重新获得资金青睐，相对创业板及大盘指数目前的情况而言，中小板块兼具成长与蓝筹双重属性，配置价值较强。经过了数次深幅的调整，市场信心正在逐渐恢复。相信四季度收官之战，大盘及各板块会有不错的表现。

中小板 300 成长 ETF(159917)已于 8 月 27 日转型为新能源汽车分级 160225。

国泰国证新能源汽车分级：

后汽车时代的新能源汽车具有超越周期的属性，成为在整体经济放缓、各行业景气度下滑时为数不多的亮点，满足不同类型消费者如公共服务及民用等多层次需求，具备极强的成长性。有理由相信新能源汽车行业产业链以及其不断衍化颠覆的商业运营模式将有望成为中国未来十年拉动及保障经济增长最不可或缺的中坚力量。

国泰国证新能源汽车指数分级基金（160225），跟踪国证新能源汽车指数（399417），可以减少投资者选股时间精力成本，分散投资降低风险。目前经过大盘几轮深幅调整结合新能源汽车行业的高成长性，安全边际大幅提升，十分具备吸引力，已经进入中长期配置的较好时点，欢迎广大投资者积极参与。

#### 4.4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，中小板 300 成长交易型开放式证券投资基金已超过连续二十个

工作日基金资产净值低于五千万元。中小板 300 成长交易型开放式证券投资基金已于 2015 年 8 月 27 日正式转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

(报告期：2015年8月27日-2015年9月30日)

#### 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,964,068.66	0.68
	其中：股票	1,964,068.66	0.68
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	285,376,003.57	99.29
7	其他各项资产	81,431.87	0.03
8	合计	287,421,504.10	100.00

#### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.1.2.1 积极投资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	66,360.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	984,796.80	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	100,764.00	0.04
F	批发和零售业	-	-
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	337,863.00	0.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	448,852.86	0.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、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	1,938,636.66	0.68

5.1.2.2 指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,432.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、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	25,432.00	0.01

### 5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.1.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002176	江特电机	2,200	25,432.00	0.01

#### 5.1.3.2 报告期末积极投资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

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	002183	怡亚通	10,347.00	448,852.86	0.16
2	002219	恒康医疗	9,060.00	317,824.80	0.11
3	002174	游族网络	4,500.00	268,290.00	0.09
4	002030	达安基因	7,769.00	264,146.00	0.09
5	002353	杰瑞股份	10,996.00	248,509.60	0.09

#### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.1.5 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



本基金本报告期末未持有债券。

#### **5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **5.1.7 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### **5.1.8 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投资明细**

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### **5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### **5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

##### **5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

##### **5.1.11 投资组合报告附注**

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

**5.1.11.3其他各项资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,723.65
2	应收证券清算款	29,982.32
3	应收股利	-
4	应收利息	38,725.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,431.87

**5.1.11.4报告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可转换债券。

**5.1.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**5.1.11.5.1报告期末指数投资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	002176	江特电机	25,432.00	0.01	重大事项

**5.1.11.5.2报告期末积极投资前五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	002183	怡亚通	448,852.86	0.16	重大事项
2	002219	恒康医疗	317,824.80	0.11	重大事项
3	002174	游族网络	268,290.00	0.09	重大事项
4	002030	达安基因	264,146.00	0.09	重大事项

## 5.2 中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金

(报告期: 2015年7月1日-2015年8月26日)

### 5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,347,296.52	94.67
	其中: 股票	9,347,296.52	94.67
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	507,853.89	5.14
7	其他各项资产	18,066.56	0.18
8	合计	9,873,216.97	100.00

### 5.2.2 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	77,672.80	0.81
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,385,591.73	66.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	417,434.80	4.35
F	批发和零售业	-	-
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	1,162,660.24	12.13
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,274,216.95	13.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,720.00	0.31
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	9,347,296.52	97.50

### 5.2.3 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投资明细

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	139,673	4,524,008.47	47.19
2	002183	怡亚通	10,347	756,883.05	7.90
3	002410	广联达	23,884	599,727.24	6.26
4	002400	省广股份	22,591	517,333.90	5.40
5	002353	杰瑞股份	10,996	487,672.60	5.09
6	002174	游族网络	4,500	402,885.00	4.20
7	002030	达安基因	7,769	341,059.10	3.56
8	002219	恒康医疗	9,060	337,394.40	3.52
9	002325	洪涛股份	8,925	222,054.00	2.32
10	002310	东方园林	4,976	190,580.80	1.99

### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.2.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.2.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.2.8 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投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

#### 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

#### 5.2.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,220.71

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,845.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,066.56

#### 5.2.11.4 报告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可转换债券。

#### 5.2.11.5 报告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	002415	海康威视	4,524,008.47	4,719.00	重大事项
2	002183	怡亚通	756,883.05	790.00	重大事项
3	002410	广联达	599,727.24	626.00	重大事项
4	002400	省广股份	517,333.90	540.00	重大事项
5	002353	杰瑞股份	487,672.60	509.00	重大事项
6	002174	游族网络	402,885.00	420.00	重大事项
7	002030	达安基因	341,059.10	356.00	重大事项
8	002219	恒康医疗	337,394.40	352.00	重大事项
9	002325	洪涛股份	222,054.00	232.00	重大事项
10	002310	东方园林	190,580.80	199.00	重大事项

## § 6 开放式基金份额变动

### 6.1 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

单位：份

项目	新汽车	新汽车A	新汽车B
基金合同生效 日（2015年8月 27日）	5,132,924.00	-	-

基金合同生效 日起至报告期 期末基金总申 购份额	182,708,370.64	-	-
减：基金合同 生效日起至报 告期期末基金 总赎回份额	-	-	-
基金合同生效 日起至报告期 期末基金拆分 变动份额	-125,003,726.59	112,131,466.00	112,131,467.00
本报告期期末 基金份额总额	62,837,568.05	112,131,466.00	112,131,467.00

## 6.2 中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2015年7月1日-2015年8月26日)

单位：份

本报告期期初基金份额总额	11,132,924.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	29,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	35,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分 变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,132,924.00

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

### 7.1.1 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 7.1.2 中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，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交易明细

### 7.2.1 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金。

### 7.2.2 中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来。中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2015 年 6 月 29 日起至 2015 年 7 月 28 日 17:00 止，根据中小成长 ETF 基金份额持有人大会 2015 年 7 月 29 日决议通过的《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，基金管理人于 2015 年 7 月 30 日发布《国泰基金管理有限公司关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，并向深圳证券交易所申请终止中小成长 ETF 基金的上市交易，获得深圳证券交易所《终止上市同意书》（深证上[2015]402 号）同意。中小成长 ETF 基金的终止上市日为 2015 年 8 月 27 日，即在 2015 年 8 月 26 日深圳证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人享有中小成长 ETF 终止上市后的相关权利。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、中国证监会《关于准予中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》和《国泰基金管理有限公司关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等的有关规定，《国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》自 2015 年 8 月 27 日起失效，《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》于同一起生效，同时本基金更名为国泰国



证新能源汽车指数分级证券投资基金。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复
- 2、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同
- 3、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议
- 4、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

二〇一五年十月二十六日