

# 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

## 2015年第4季度报告

### 2015年12月31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：二〇一六年一月二十日

## § 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2016年1月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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 | 36,931,519.93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       | 1、股票投资策略<br>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成             |

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。

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0.35%，年跟踪误差不超过4%。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。

## 2、债券投资策略

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。

## 3、股指期货投资策略

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。

## 4、资产支持证券投资策略

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

|                 |   |                            |   |
|-----------------|---|----------------------------|---|
|                 | <p>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> |                            |   |
| 业绩比较基准          | <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>  |                            |   |
| 基金管理人           | <p>国泰基金管理有限公司</p>   |                            |   |
| 基金托管人           | <p>中国银行股份有限公司</p>   |                            |   |
| 下属分级基金的基金简称     | <p>新汽车</p>  | <p>新汽车A</p>                | <p>新汽车B</p>                                       |
| 下属分级基金的场内简称     | <p><b>新汽车</b></p>   | <p><b>新汽车A</b></p>         | <p><b>新汽车B</b></p>                                |
| 下属分级基金的交易代码     | <p>160225</p>   | <p>150357</p>              | <p>150358</p>                                     |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>22,843,472.93份</p>   | <p>7,044,023.00份</p>       | <p>7,044,024.00份</p>                              |
| 风险收益特征          | <p>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</p>   | <p>新汽车A份额的预期风险和预期收益较低。</p> | <p>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> |

|  |                                |  |  |
|--|--------------------------------|--|--|
|  | 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。 |  |  |
|--|--------------------------------|--|--|

### § 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10月1日-2015年12月31日) |
| 1. 本期已实现收益      | 2, 235, 089. 50          |
| 2. 本期利润         | 6, 513, 854. 95          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0664                  |
| 4. 期末基金资产净值     | 42, 123, 554. 45         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 1406                  |

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。

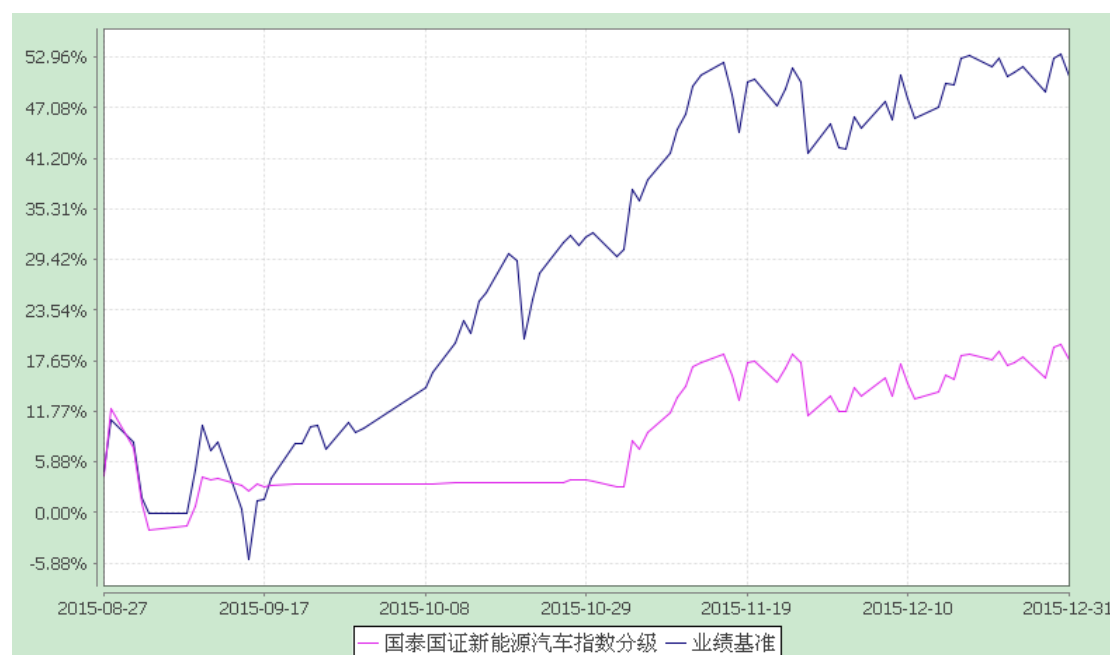
#### 3.2 基金净值表现

##### 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    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 14.06% | 1.69%     | 37.15%     | 2.29%         | -23.09% | -0.60% |

### 3.2.2 自基金转型以来基金累计份额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  
 累计份额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日至2015年12月31日)



注：1) 本基金合同生效日为2015年8月27日，截止至2015年12月31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。

## § 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 | 2015-08-27  | -    | 8年     | 硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师（国家一级）。 |

|  |   |  |  |   |
|--|---|--|--|---|
|  | <p>基金经理<br/>(原<br/>国泰<br/>中小<br/>板300<br/>成长E<br/>TF)<br/>、国<br/>泰国<br/>证有<br/>色金<br/>属行<br/>业指<br/>数分<br/>级、<br/>国泰<br/>纳斯<br/>达克1<br/>00指<br/>数(QD<br/>II)、<br/>国泰<br/>纳斯<br/>达克1<br/>00(Q<br/>DII-<br/>ETF)<br/>、国<br/>泰国<br/>证房<br/>地产<br/>行业<br/>指数<br/>分级<br/>的基<br/>金经<br/>理</p> |  |  | <p>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月至2015年7月任国泰中小板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（原国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金）的基金经理。</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

2015年四季度在经历了第三季度的两次大幅杀跌后风险得到较大释放，存在技术性反弹及估值修复的需求。10月随着美国市场转暖，以及汇率企稳，A股在十一长假后开始一波较明显的反弹，风险偏好见底回升，主题及中小创反弹明



显，12月份随着险资增持以及供给端改革预期，房地产、有色板块活跃，有明显上涨。新能源汽车板块由于持续销量超预期以及政策支持的不不断出台，成为四季度反弹热点录得较大涨幅。

作为完全跟踪标的指数的被动型基金，本基金避免了不必要的主动操作，减少了交易冲击成本，并通过精细化管理确保基金组合与指数权重基本一致，由于处于基金转型后的建仓期，对基金的跟踪误差管理带来一定的挑战，后续跟踪误差将逐步减小。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2015年第四季度的净值增长率为14.06%，同期业绩比较基准收益率为37.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过了2015年第三季度的暴跌之后以及2016年年初的两次大跌熔断，危机及系统性风险有较大释放。

不断超预期的销量数据以及逐步衍化成熟的商业运营模式，其产业链包括整车、电池材料、上游材料、电机和电控、充电桩等，而在互联网技术、思维以及盈利模式的蜕变革新下，新能源汽车已不单纯再是汽车，而是一个整合O2O、车联网、大数据等功能的移动载体及平台。新能源汽车具有超越周期的属性，成为在整体经济放缓、各行业景气度下滑下为数不多的亮点，满足不同类型消费者包括公共服务及民用等多层次需求，具备极强的成长性。建议投资者积极对国泰新能源汽车指数分级基金（160225）进行配置。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金已超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万万元。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 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              | 39,205,781.74 | 87.36  |
|   | 其中：股票             | 39,205,781.74 | 87.36  |
| 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      | 3,548,540.46  | 7.91   |
| 7 | 其他各项资产            | 2,125,272.84  | 4.74   |
| 8 | 合计                | 44,879,595.04 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 1,749,927.00 | 4.15         |
| 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  | 520,710.00   | 1.24         |

|   |               |              |      |
|---|---------------|--------------|------|
| 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            | 2,270,637.00 | 5.39 |

#### 5.2.2 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              | 988,564.40    | 2.35         |
| C  | 制造业              | 33,062,173.94 | 78.49        |
| 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           | 318,840.00    | 0.76         |
| 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  | 354,090.00    | 0.84         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | 394,193.80    | 0.94         |
| 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        | 1,817,282.60  | 4.31  |
|   | 合计        | 36,935,144.74 | 87.68 |

### 5.3 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

#### 5.3.1 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  | 600066 | 宇通客车 | 91,266  | 2,052,572.34 | 4.87         |
| 2  | 002466 | 天齐锂业 | 13,472  | 1,896,184.00 | 4.50         |
| 3  | 000009 | 中国宝安 | 101,185 | 1,817,282.60 | 4.31         |
| 4  | 000559 | 万向钱潮 | 76,377  | 1,728,411.51 | 4.10         |
| 5  | 002594 | 比亚迪  | 25,469  | 1,640,203.60 | 3.89         |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 33,110  | 1,562,792.00 | 3.71         |
| 7  | 002460 | 赣锋锂业 | 21,429  | 1,348,526.97 | 3.20         |
| 8  | 600478 | 科力远  | 59,457  | 1,303,297.44 | 3.09         |
| 9  | 002276 | 万马股份 | 41,764  | 1,257,096.40 | 2.98         |
| 10 | 002407 | 多氟多  | 15,249  | 1,162,888.74 | 2.76         |

#### 5.3.2 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  | 002056 | 横店东磁 | 25,000 | 702,750.00 | 1.67         |
| 2  | 002664 | 信质电机 | 20,000 | 635,400.00 | 1.51         |
| 3  | 002219 | 恒康医疗 | 22,650 | 411,777.00 | 0.98         |
| 4  | 002174 | 游族网络 | 4,500  | 379,800.00 | 0.90         |
| 5  | 002368 | 太极股份 | 2,100  | 140,910.00 | 0.33         |

### 5.4 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。

### 5.5 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。

#### **5.6 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。

#### **5.7**

#### **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。

#### **5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **5.9.1 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。

##### **5.9.2 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。

#### **5.10 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“赣锋锂业”公司违规情况外），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。

根据2015年2月10日深圳证券交易所发布的对赣锋锂业股份有限公司的处罚决定，2014年3月3日，赣锋锂业股份有限公司披露了股票交易异常波动公告，明确表示，“公司没有任何根据深交所《股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等，公司的董事会也未获悉公司有根据深交所《股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的、对公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息。”而事实上，根据公司在2014年9月2日披露的《关于收到江西证监局警示函及整改情况的公告》，2013年11月起公司即与深圳市美拜电子有限公司（以下简称“美拜电子”）等企业接触，筹划、商谈收购相关事宜。在2014年3月3日披露股价异常波动公告时，公司已经在筹划发行股份购买美拜电子事宜，但却在公告中否认正在筹划重大事项。公司的上述行为违反了深交所《股票上市规则（2012年修订）》第2.1条、第2.4条和11.5.3条的规定。经深圳证券交易所纪律处分委员会审议通过，决定对江西赣锋锂业股份有限公司给予通报批评的处分；对公司董事长兼总裁李良彬、副董事长兼副总裁王晓申与时任副总裁、时任财务负责人兼董事会秘书邵瑾给予通报批评的处分。对于江西赣锋锂业股份有限公司及相关当事人的上述违规行为和深圳证券交易所给予的上述处分，深圳证券交易所将记入上市公司诚信档案，并向社会公布。

本基金管理人此前投资赣锋锂业股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。该情况发生后，本基金管理人就赣锋锂业股份有限公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为赣锋锂业股份有限公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2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。

### 5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 43,535.08    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 859.08       |
| 5  | 应收申购款   | 2,080,878.68 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,125,272.84 |

### 5.11.4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。

### 5.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2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  | 002664 | 信质电机 | 635,400.00     | 1.51         | 重大事项     |
| 2  | 002219 | 恒康医疗 | 411,777.00     | 0.98         | 重大事项     |
| 3  | 002174 | 游族网络 | 379,800.00     | 0.90         | 重大事项     |

## § 6开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 新汽车            | 新汽车A            | 新汽车B            |
|--------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 62,837,568.05  | 112,131,466.00  | 112,131,467.00  |
| 报告期基金总申购份额   | 36,301,982.93  | -               | -               |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 286,470,964.05 | -               | -               |
| 报告期基金拆分变动份额  | 210,174,886.00 | -105,087,443.00 | -105,087,443.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 22,843,472.93  | 7,044,023.00    | 7,044,024.00    |

## § 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

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

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 备查文件目录

### 8.1 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

## 8.2 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。

## 8.3 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>

国泰基金管理有限公司

二〇一六年一月二十日