国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金之食品A与食品B基金份额上市交易公告书

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2014年11月5日
公告日期：2014年10月31日

一、重要声明与提示

《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金之食品A与食品B基金份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）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，国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书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。

本基金托管人保证本公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。

中国证监会、深圳证券交易所对国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金之食品A与食品B基金份额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。

本上市交易公告书中财务资料未经审计。凡本公告书未涉及的有关内容，请投资人详细查阅刊登在2014年9月10日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金
基金份额名称：国泰食品份额；场内简称：国泰食品；基金代码：160222
基金份额名称：食品A份额；场内简称：食品A；交易代码：150198
基金份额名称：食品B份额；场内简称：食品B；交易代码：150199
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、基金份额结构：本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“国泰食品份额”，分为场外国泰食品份额和场内国泰食品份额。分级份额包括两类，稳健收益类份额（简称“食品A份额”）和积极收益类份额（简称“食品B份额”）。食品A份额与食品B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。
5、本基金的存续期限为不定期。
6、食品A份额、食品B份额与国泰食品份额的资产合并投资运作。
7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额，将被确认为国泰食品份额。投资者场内认购所得的份额，将按1∶1的基金份额配比自动分拆为食品A份额和食品B份额。基金合同生效后，投资者认购所得的国泰食品份额场内份额的分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。
8、基金合同生效后，国泰食品份额（基金代码：160222）设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。食品A份额（场内简称：食品A；交易代码：150198）与食品B份额（场内简称：食品B；交易代码：150199）只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。
9、国泰食品份额的申购与赎回
投资人可通过场外或场内两种方式，申购或赎回国泰食品份额（基金代码：160222）。
办理国泰食品份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理国泰食品份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对食品A份额或食品B份额单独开放场内申购、赎回。
10、场内份额配对转换
场内份额配对转换是指本基金场内的国泰食品份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指场内的国泰食品份额按照1:1的基金份额配比分拆成食品A份额和食品B份额的行为。合并指食品A份额和食品B份额按照1:1的基金份额配比合并成国泰食品份额场内份额的行为。
11、基金份额折算
基金份额定期折算的频率为每个会计年度进行1次（可不进行定期折算的除外）。基金份额不定期折算的条件是国泰食品份额的份额净值大于或等于1.5000元以及食品B份额的份额净值小于或等于0.2500元。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“第二十一部分 基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。
12、基金份额总额
截至2014年10月29日，本基金的份额总额为458,948,608.81份；其中，国泰食品份额为172,174,328.81份；食品A份额为143,387,140.00份；食品B份额为143,387,140.00份。
13、基金份额净值
截至2014年10月29日，国泰食品份额的基金份额净值为1.0001元，食品A份额的基金份额净值为1.0013元，食品B份额的基金份额净值为0.9989元。
14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码
份额简称：食品A，交易代码：150198
份额简称：食品B，交易代码：150199
15、本次上市交易份额
食品A：143,387,140.00份
食品B：143,387,140.00份
16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
17、上市交易日期：2014年11月5日
18、基金管理人：国泰基金管理有限公司
19、基金托管人：中国农业银行股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

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、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可[2014]307号
2、基金合同生效日：2014年10月23日
3、基金运作方式：契约型开放式
4、基金合同期限：不定期
5、发售日期：2014年9月15日至2014年10月17日
6、发售价格：1.00元人民币
7、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售
8、发售机构
（1）场内发售机构
本基金场内销售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位，具体名单以深圳证券交易所网站披露为准。
（2）场外发售机构
1）直销机构：国泰基金管理有限公司。
2）代销机构：中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、信达证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司。
9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
10、认购资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为458,905,616.15元人民币，折合基金份额458,905,616.15份；认购资金在募集期间产生的银行利息共计44,315.66元人民币，折合基金份额44,315.66份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。上述资金总额已于2014年10月22日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11、基金备案情况
本基金于2014年10月23日验资完毕，2014年10月23日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2014年10月23日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日：2014年10月23日。
13、基金合同生效日的基金份额总额：458,949,931.81份
（二）本基金上市交易的主要内容
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[2014]399号
2、上市交易日期：2014年11月5日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资人在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、上市交易份额简称：食品A、食品B
5、交易代码：食品A为150198、食品B为150199
6、本次上市交易份额：食品A为143,387,140.00份；食品B为143,387,140.00份。
7、基金资产净值的披露：每个工作日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的次日公布该日的国泰食品份额、食品A份额与食品B份额的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。
8、未上市交易份额的流通规定：
未上市交易的托管在场内的国泰食品份额，基金份额持有人可选择将国泰食品份额分拆为食品A份额和食品B份额后，即可上市流通。
未上市交易的托管在场外的国泰食品份额，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后，选择将国泰食品份额分拆为食品A份额和食品B份额后，即可上市流通。
（三）国泰食品份额的日常申购、赎回情况
国泰食品份额的日常申购、赎回业务将于2014年11月5日起开始办理。投资人可详细查阅刊登在2014年10月31日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》。
（四）份额配对转换业务及跨系统转托管业务安排
本基金将于2014年11月4日起开始办理份额配对转换业务及跨系统转托管业务，投资人可详细查阅刊登在2014年10月31日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《关于开通国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金份额配对转换业务公告》及《关于开通国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金系统内转托管和跨系统转托管业务的公告》。
中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理资格的证券公司名单进行更新，投资人可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站（www.chinaclear.cn）查询最新名单，本公司对该名单及其更新不再另行公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

截至2014年10月29日的基金份额持有情况：
国泰食品份额持有人户数：1,839户，平均每户持有基金份额：93,623.89份；食品A份额持有人户数：2,274户，平均每户持有的场内基金份额：63,055份；食品B份额持有人户数：2,274户，平均每户持有的场内基金份额：63,055份。
机构投资者持有的本次上市交易的食品A与食品B的基金份额分别为26,841,966份和26,841,966份，分别占本次食品A与食品B上市交易基金份额比例为18.72%和18.72%；个人投资者持有的本次上市交易的食品A与食品B的基金份额分别为116,545,174份和116,545,174份，分别占本次食品A与食品B上市交易基金份额比例为81.28%和81.28%。
本次上市交易的食品A与食品B份额前十名持有人情况：

截止日期：2014年10月29日

序号	持有人名称（全称）	持有食品A份额	占食品A份额比（%）	持有食品B份额	占食品B份额比（%）
1	新华信托股份有限公司	5,000,300	3.49	5,000,300	3.49
2	中银国际证券—兴业银行—中银国际证券中国红—黄山8号集合资产管理计划	5,000,291	3.49	5,000,291	3.49
3	中银国际期货有限责任公司	5,000,291	3.49	5,000,291	3.49
4	天风证券股份有限公司	5,000,291	3.49	5,000,291	3.49
5	兴业证券股份有限公司	3,000,174	2.09	3,000,174	2.09
6	上海国际信托有限公司—E-1305	3,000,058	2.09	3,000,058	2.09
7	陆汉超	999,558	0.70	999,558	0.70
8	叶松坚	992,114	0.69	992,114	0.69
9	王炜	750,044	0.52	750,044	0.52
10	赵桂华	650,012	0.45	650,012	0.45
合计		29,393,133	20.50	29,393,133	20.50

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、基本信息
名称：国泰基金管理有限公司
设立日期：1998年3月5日
住所：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼
办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层
法定代表人：陈勇胜
总经理：金旭
注册资本：壹亿壹千万元人民币
设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]5号
工商登记注册的法人营业执照文号：310000000060090
经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务
联系人：何晔
联系电话：021-31089000，400-888-8688
股东及出资比例

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%

2、内部组织结构及职能
公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事3名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；
在组织结构方面，公司设立的分管领导议事会议、总经理办公会议、投资决策委员会、风险控制委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；
公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；
公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。
3、人员情况
截至2014年9月30日，公司正式员工250人，其中56%（141人）的员工具有硕士以上学历。
4、信息披露负责人：林海中
咨询电话：400-888-8688
5、基金管理业务情况
截至2014年9月30日，本基金管理人共管理47只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金麒麟等价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、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、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰6个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证5年期债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金。另外，本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。
6、本基金基金经理
贾成东，硕士研究生，2008年2月加入国泰基金管理有限公司，历任量化、宏观、策略、煤炭及银行研究员，2012年2月起任研究部总监助理，2013年11月起担任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2014年6月起兼任国泰保本混合型证券投资基金和国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的基金经理。
（二）基金托管人
1、基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：蒋超良
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-68121510
传真：010-68121816
联系人：李芳菲
中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广，服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营，可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。
中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”，2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。
中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。
2、主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。
3、基金托管业务经营情况
截止2014年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共213只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双益债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、富实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、吴吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深300指数型证券投资基金、前海开源沪深300指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

（三）基金验资机构
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：（021）23238888
经办注册会计师：汪棣、魏佳亮
联系人：魏佳亮

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要请见附件。

七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金2014年10月29日资产负债表（未经审计）如下：
国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金
2014年10月29日资产负债表
（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	本期末2014年10月29日
资产：	
?银行存款	458,949,549.64
?结算备付金	–
?存出保证金	–
?交易性金融资产	–
?其中：股票投资	–
????? 基金投资	–
????? 债券投资	–
????? 资产支持证券投资	–
?衍生金融资产	–
?买入返售金融资产	–
?应收证券清算款	–
?应收利息	172,231.98
?应收股利	–
?应收申购款	–
?其他资产	–
?资产总计	459,121,781.62
负债与持有人权益	–
负债：	–
?短期借款	–
?交易性金融负债	–
?衍生金融负债	–
?卖出回购金融资产款	–
?应付证券清算款	–
?应付赎回款	–
?应付管理人报酬	75,444.75
?应付托管费	15,088.95
?应付销售服务费	–
?应付交易费用	–
?应交税费	–
?应付利息	–
?应付利润	–
预提费用	14,999.95
?其他负债	1,508.89
?负债合计	107,042.54
所有者权益：	–
?实收基金	458,949,931.81
?未分配利润	64,807.27
?所有者权益合计	459,014,739.08
负债和所有者权益总计	459,121,781.62

注：报告截止日2014年10月29日，国泰食品份额净值1.0001元，食品A份额净值：1.0013元，食品B份额净值：0.9989元；基金份额总额458,948,608.81份，其中国泰食品份额总额：172,174,328.81份，食品A份额总额：143,387,140.00份，食品B份额总额：143,387,140.00份。

八、基金投资组合

截至2014年10月29日，国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的投资组合如下：
1、基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	458,949,549.64	99.96
6	其他各项资产	172,231.98	0.04
7	合计	459,121,781.62	100.00

2、按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资。
3、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
本基金本报告期末未持有股票投资。
4、按券种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。
5、按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：
本基金本报告期末未持有债券投资。
6、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细：
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、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）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	172,231.98
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	172,231.98

（4）截至2014年10月29日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
（5）截至2014年10月29日，本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金合同已于2014年10月23日正式生效，基金管理人于2014年10月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站（www.gtfund.com）上刊登《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金合同生效公告》。本基金将自2014年11月4日起开始办理国泰食品份额的跨系统转托管业务及基金份额配对转换业务，基金管理人于2014年10月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站（www.gtfund.com）上刊登《关于开通国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金系统内转托管和跨系统转托管业务的公告》及《关于开通国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金份额配对转换业务公告》。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：
（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、深圳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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：
（一）严格遵守《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》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
（二）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》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《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》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；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，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅。
（一）中国证监会核准国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金募集的文件；
（二）《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金合同》；
（三）《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金招募说明书》；
（四）《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金托管协议》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

国泰基金管理有限公司
2014年10月31日

附件 基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务
1、基金管理人的权利
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同