国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)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:2016年7月20日
公告日期:2016年7月15日

一、重要声明与提示

《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)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,国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)(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新能源汽车指数证券投资基金(LOF)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。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资人详细查阅刊登在2016年6月30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《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)招募说明书》。

二、基金概况

1、基金名称:国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)

2、基金类型:股票型

3、基金运作方式:契约型开放式

4、基金存续期限:不定期

5、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:

份额简称:新汽车,交易代码:160225

6、基金份额的申购与赎回

投资人可通过场外或场内两种方式申购或赎回基金份额(基金代码:160225)。

办理基金份额场内申购、赎回业务的销售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。办理基金份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外销售机构。

7、基金份额总额:截至2016年7月13日,本基金的份额总额为181,958,899.23份

8、基金份额净值:截至2016年7月13日,本基金的份额净值为1.1410元

9、本次上市交易的份额总额:截至2016年7月13日,本次上市交易的份额总额为11,411,808份

10、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

11、上市交易日期:2016年7月20日

12、基金管理人:国泰基金管理有限公司

13、基金托管人:中国银行股份有限公司

14、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、基金的历史沿革、日常申赎与上市交易

(一)本基金的历史沿革

本基金由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来,国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板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经中国证监会《关于核准中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可[2011]1206号)核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金于2012年1月30日至2012年3月9日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2012年3月15日生效。

自2015年6月29日至2015年7月28日中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《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》。自2015年8月27日起,由《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》生效,原《中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

自2016年5月27日至2016年6月28日国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》,内容包括国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金终止分级份额的运作、调整投资范围及比例、基金费用、收益分配方式、修订基金合同、由指数分级基金变更为上市开放式基金、并更名为"国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)"等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2016年7月1日起,由《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)基金合同》生效,原《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

(二)本基金的日常申购、赎回情况

本基金基金份额的日常申购、赎回业务已于2016年7月5日起开始办理。投资人可详细查阅刊登在2016年7月5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《关于国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)开始办理申购赎回等相关业务的公告》。

(三)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[2016]443号

2、上市交易日期:2016年7月20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:新汽车

5、交易代码:160225

6、本次上市交易份额:11,411,808份(截至2016年7月13日)

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外的基金份额,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后,即可上市流通。本基金的转托管业务已于2016年7月5日起开始办理,具体详见本基金管理人的相关公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数

截至2016年7月13日,本基金的场内新汽车份额持有人户数:905户,平均每户持有的场内基金份额:12,609.73份;本基金的场外基金份额持有人总户数:13,204户,平均每户持有的场外基金份额:12,916.32份。

(二)持有人结构

截至2016年7月13日,场内基金份额持有人结构如下:

机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为186,163份,占本次上市交易基金份额比例为1.63%;个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为11,225,645份,占本次上市交易基金份额比例为98.37%。

(三)场内前十名基金份额持有人的情况:

截至2016年7月13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	王仰东	868,907	7.61%
2	王迎平	501,088	4.39%
3	邹积胜	500,006	4.38%
4	吴恺晶	305,990	2.68%
5	魏贵军	279,563	2.45%
6	傅杰华	239,963	2.10%
7	宋晶萍	239,956	2.10%
8	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	180,048	1.58%
9	徐勇	180,003	1.58%
10	唐锋	179,895	1.58%
合计		3,475,419	30.45%

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:唐建光

总经理:周向勇

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

营业执照统一社会信用代码:91310000631834917Y

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4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、执行委员会会议、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2016年6月30日,公司正式员工246人,其中58%(143人)的员工具有硕士及以上学历。

4、信息披露负责人:李永梅

咨询电话:400-888-8688

5、基金管理业务情况

截至2016年7月13日,本基金管理人共管理62只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长混合型证券投资基金(原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、国泰金鹏蓝筹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)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金(原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、国泰区位优势混合型证券投资基金(原国泰区位优势股票型证券投资基金)、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(原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、国泰价值经典混合型证券投资基金(LOF)(原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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金(原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、国泰成长优选混合型证券投资基金(原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、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(原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年期国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(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金 (由国泰6个月短期理财债券型证券投资基金转型而来)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)(由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来,国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来)。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

徐皓,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8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日至2016年6月30日任国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金(原中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金)的基金经理,2016年7月1日起任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金 (LOF)(原国泰国证新能源汽车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:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

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

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人:王永民

传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

3、证券投资基金托管情况

截至2016年3月31日,中国银行已托管446只证券投资基金,其中境内基金416只,QDII基金30只,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。

4、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 "SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2015年,中国银行同时获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

5、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

(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

执行事务合伙人:李丹

联系电话:(021)23238888

经办注册会计师:汪棣、单峰

联系人:单峰

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

(一)基金募集期间费用

中小板300成长交易型开放式指数证券投资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。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金自基金合同生效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

国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)2016年7月13日资产负债表(未经审计)如下:

国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)

2016年7月13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2016年7月13日
资产:	
银行存款	18,309,986.22
结算备付金	1,244,084.91
存出保证金	133,842.07
交易性金融资产	186,951,525.90
其中:股票投资	186,951,525.90
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	7,796,077.93
应收利息	12,619.51
应收股利	-
应收申购款	12,853,568.72
其他资产	-
资产总计	227,301,705.26
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	18,996,272.38
应付管理人报酬	35,277.61
应付托管费	14,111.04
应付销售服务费	-
应付交易费用	325,818.57
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	233,449.47
其他负债	78,657.25
负债合计	19,683,586.32
所有者权益:	
实收基金	119,039,212.95
未分配利润	88,578,905.99
所有者权益合计	207,618,118.94
负债和所有者权益总计	227,301,705.26

注:报告截止日2016年7月13日,新汽车份额净值:1.1410元,新汽车份额总额:181,958,899.23份。

八、基金投资组合

截至2016年7月13日,国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)的投资组合如下:

(一)报告期末基金资产组合情况

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	186,951,525.90	82.25
	其中:股票	186,951,525.90	82.25
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	19,554,071.13	8.60
6	其他各项资产	20,796,108.23	9.15
7	合计	227,301,705.26	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

2、报告期末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	3,687,487.40	1.78
C	制造业	163,770,971.96	78.88
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	2,138,798.50	1.03
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	8,084,399.20	3.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,387,449.86	1.15
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	6,882,418.98	3.31
	合计	186,951,525.90	90.05

(三)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

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	452,406	9,753,873.36	4.70
2	002466	天齐锂业	212,973	9,441,093.09	4.55
3	000839	中信国安	370,844	8,084,399.20	3.89
4	002594	比亚迪	131,624	8,019,850.32	3.86
5	002407	多氟多	172,167	7,224,127.32	3.48
6	000009	中国宝安	485,361	6,882,418.98	3.31
7	300124	汇川技术	345,871	6,692,603.85	3.22
8	000559	万向钱潮	421,205	6,671,887.20	3.21
9	002460	赣锋锂业	169,747	6,099,009.71	2.94
10	002176	江特电机	345,596	5,318,722.44	2.56

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

(五) 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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

(六) 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

(八)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

(九)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	133,842.07
2	应收证券清算款	7,796,077.93
3	应收股利	-
4	应收利息	12,619.51
5	应收申购款	12,853,568.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,796,108.23

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

九、重大事件揭示

国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)基金合同已于2016年7月1日正式生效, 具体详见基金管理人于2016年6月30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)上刊登的《国泰国证新能源汽车指数分级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》和《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)基金合同》。

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)中国证监会关于核准中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复文件

(二)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文件

(三) 中国证监会关于准予国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金变更注册的批复文件

(四) 经中国证监会备案的国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件

(五)《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

(六)《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)招募说明书》;

(七)《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)托管协议》;

(八)法律意见书;

(九)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(十)基金托管人业务资格批件、营业执照;

(十一)中国证监会要求的其他文件。

国泰基金管理有限公司
2016年7月15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)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;

(2)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(3)销售基金份额;

(4)按照规定召集基金份额持有人大会;

(5)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

(6)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(7)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(8)担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(9)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(10)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(11)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(12)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;

(13)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(14)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(15)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则;

(16)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1) 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、谨慎勤勉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)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产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;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)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;

(12)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,不向他人泄露;

(13)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;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)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;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上,法律法规另有规定的从其规定;

(17)确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)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;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(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合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)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;

(24)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(25)建立并保存基金份额持有人名册;

(26)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户,为基金办理证券交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

4、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,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)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,确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

(5)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;

(6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(7)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予以保密,不得向他人泄露;

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,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;

(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上,法律法规另有规定的从其规定;

(12)建立并保存基金份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(14) 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款项;

(15)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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)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;

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行业监督管理机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《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管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(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)依法申请赎回或转让其持有的基金份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;

(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

(4)缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(5)在其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;

(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

1、召开事由

(1)当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会(法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的除外):

1)终止《基金合同》;

2)更换基金管理人;

3)更换基金托管人;

4)转换基金运作方式;

5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;

6)变更基金类别;

7)本基金与其他基金的合并;

8)变更基金投资目标、范围或策略;

9)变更基金份额持有人大会程序;

10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

12)终止基金份额上市,但因本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;

13)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

14)法律法规、《基金合同》或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。

(2)在不违背法律法规和《基金合同》的约定,以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改,不需召开基金份额持有人大会:

1)法律法规要求增加的基金费用的收取;

2)在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式;

3)因相应的法律法规、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

4)增加或减少份额类别,或调整基金份额分类办法及规则;

5)调整基金收益的分配原则和支付方式;

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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;

7)按照基金合同的约定,变更本基金的标的指数,调整业绩比较基准;

8)在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下基金推出新业务或服务;

9)基金管理人、注册登记机构、销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则;

10)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

(1)除法律法规规定或《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)基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

(3)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,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

(4)代表基金份额10%以上(含10%)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,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,代表基金份额10%以上(含10%)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日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

(5)代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项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(含10%)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。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)基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1)召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在指定媒介公告。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应至少载明以下内容:

(下转B84版)

国泰基金管理有限公司关于国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金、网下股票发售代理机构的公告

由国泰基金管理有限公司申请,国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金";场内简称:军工ETF;基金代码:512660;认购代码:512663)自2016年7月15日起增加国信证券股份有限公司在本基金募集期内担任网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构。

投资者可以通过以下途径咨询有关事宜:

1、国信证券股份有限公司

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

2、国泰基金管理有限公司

客服电话:400-888-8688

网址:www.gtfund.com

风险提示:本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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
二零一六年七月十五日

国泰基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统通联支付网络服务股份有限公司直连渠道(招商银行、交通银行)申购(含定投)费率优惠的公告

为更好地服务于投资者,国泰基金管理有限公司(以下简称"本公司")与通联支付网络服务股份有限公司(以下简称"通联支付")协商一致,本公司决定自2016年7月18日起将网上直销交易系统通联支付渠道交通银行借记卡和招商银行借记卡申购、定期定额投资费率优惠折扣调整为4折。

一、费率优惠调整内容

调整后,自2016年7月18日起,投资者使用通联支付渠道交通银行借记卡和招商银行借记卡通过网上直销交易系统(包括本公司官网、官方微信平台及官方手机APP等渠道)申购或定期定额投资本公司旗下基金的,费率享受4折优惠,折扣后费率不低于0.6%。原费率低于或等于0.6%或为固定费用的,则按原费率执行,不再享有费率折扣。

二、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

1、通联支付网络服务股份有限公司

网站:http://www.allinpay.com

客户服务电话:95156;400-66-95156

2、国泰基金管理有限公司

网站:www.gtfund.com

客户服务电话:400-888-8688(免长途通话费用);021-31089000

三、重要提示

本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资基金时应认真阅读相关基金的《基金合同》、《招募说明书》等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
二〇一六年七月十五日

国泰基金管理有限公司关于国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金、网下股票发售代理机构的公告

由国泰基金管理有限公司申请,国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金";场内简称:证券ETF;基金代码:512880;认购代码:512883) 自2016年7月15日起增加国信证券股份有限公司在本基金募集期内担任网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构。

投资者可以通过以下途径咨询有关事宜:

1、国信证券股份有限公司

客服电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

2、国泰基金管理有限公司

客服电话:400-888-8688

网址:www.gtfund.com

风险提示:本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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
二零一六年七月十五日

国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会[2008]38 号公告)以及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)的原则和有关要求,国泰基金管理有限公司(以下简称"本公司")与托管银行商定,决定对本公司旗下基金持有的 "云南旅游"(证券代码:002059)股票进行估值调整,自2016年7月13日起按指数收益法进行估值。

待该股票的交易体现出活跃市场交易特征后,将恢复为采用当日收盘价格进行估值,届时将不再另行公告。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
2016年7月15日