

**国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 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：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

依据《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》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金本报告期内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 2016 年 5 月 27 日起至 2016 年 6 月 28 日 17:00 止。本次会议议案于 2016 年 6 月 29 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：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》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，同意对国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型，并修订《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》。为实施本基金转型方案，同意授权基金管理人办理本次转型的具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》的相关内容对《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对本基金实施转型。《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）托管协议》自 2016 年 7 月 1 日起生效，原《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议》将自同日起失效。具体可查阅本基金管理人于 2016 年 6 月 30 日披露的《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》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b>                           | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b>                          | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13 |
| <b>5 托管人报告</b>                          | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 14 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41 |
| 7.6 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      | 41 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 41 |
| 7.8 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贵金属投资明细   | 41 |
| 7.9 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      | 41 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 42 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 42 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 42 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | 43 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 43 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 44        |
| <b>9 开放式基金份额变动 .....</b>                | <b>44</b> |
| <b>10 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 44        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....  | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 46        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....               | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 47        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>49</b> |
| <b>12 备查文件目录 .....</b>                  | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 49        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 50        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 50        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                |                |
|-----------------|---------------------|----------------|----------------|
| 基金名称            | 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     |                |                |
| 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          |                |                |
| 报告期末基金份额总额      | 180,475,094.16 份    |                |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 新汽车                 | 新汽车 A          | 新汽车 B          |
| 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 | 172,273,659.16 份    | 4,100,717.00 份 | 4,100,718.00 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 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</p> |

|               |  |                       |  |
|---------------|--|-----------------------|--|
|               | 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。<br>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。 |                       |  |
| 业绩比较基准        | 国证新能源汽车指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。  |                       |  |
| 风险收益特征        | 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。   |                       |  |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 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。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                       | 基金托管人                |
|-------------|------|-----------------------------|----------------------|
| 名称          |      | 国泰基金管理有限公司                  | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李永梅                         | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 021-31081600转               | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com        | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | (021)31089000, 400-888-8688 | 95566                |
| 传真          |      | 021-31081800                | 010-66594942         |
| 注册地址        |      | 上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼      | 北京西城区复兴门内大街1号        |
| 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  | 北京西城区复兴门内大街1号        |
| 邮政编码        |      | 200082                      | 100818               |
| 法定代表人       |      | 唐建光                         | 田国立                  |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》                                    |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层及基金托管人住所                        |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年1月1日至2016年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,705,980.98              |
| 本期利润          | 9,595,491.99              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1184                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 11.82%                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.42%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 82,792,749.03             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4587                    |
| 期末基金资产净值      | 200,861,494.19            |
| 期末基金份额净值      | 1.1130                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 14.99%                    |

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 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       | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月    | 5.95%    | 1.97%       | 6.45%      | 2.27%         | -0.50%  | -0.30% |
| 过去三个月    | 15.70%   | 1.93%       | 14.91%     | 2.13%         | 0.79%   | -0.20% |
| 过去六个月    | -2.42%   | 2.85%       | -2.29%     | 2.88%         | -0.13%  | -0.03% |
| 自基金转型起至今 | 14.99%   | 2.52%       | 47.17%     | 2.85%         | -32.18% | -0.33% |

#### 3.2.2 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

自基金转型以来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 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，截至 2016 年 6 月 30 日，本基金运作时间未  
满一年。

（2）本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，本基金在 6 个月建仓结束时，基金的投资组合比  
例符合基金合同的有关规定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2016 年 6 月 30 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、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、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、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（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）、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、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、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）（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分级证券投资基金（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，自 2016 年 7 月 1 日起转型为国泰国证新能源汽车指数证券投资基

金（LOF））。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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）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（原国泰中小板 300 成长 ETF）、国泰国证有色金属行业指数分级、国泰纳斯达克 100 指数（QDII）、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰国证房地产行业指数分级的基金经理 | 2016-07-01      | -    | 9 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 月至 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 2016 年 6 月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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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, 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。

##### (一) 本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见, 我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析, 我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下, 且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### (二) 扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

## 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所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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 1、2 月份 A 股市场在人民币贬值以及全球市场下行共振下连续大幅下跌，两度突破 2650 点位，随后市场情绪逐步修复，并在 2800-3100 一带震荡，有色、食品、新能源汽车及电子板块表现较强。新能源汽车板块在经过一季度的杀跌后，二季度表现十分抢眼，具有较高的超额收益。

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。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2016 年上半年净值增长率为-2.42%，同期业绩比较基准收益率为-2.29%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于全球性的货币超发，包括 A 股市场在内的全球市场并不缺乏流动性。利率不断下行下，资本表现了避险以及寻求较高收益标的的双重需求。全球股市出现了情绪修复及存量博弈走势。在近一年内经历了三次股灾后，大金融板块机构持股集中度较高，A 股市场波动性有所收敛，多以震荡为主，日均交易量亦较平稳。结合目前走势及未来预测，对第三季度市场表现较为期待，四季度则相对谨慎，年内整体上以震荡为主。

作为二季度启动并获得大幅超额收益的新能源汽车板块，走势有相对的独立性，目前有一定盘整回调，短期内或仍以震荡为主，等待新能源汽车补贴政策的进一步落地后或有一定表现。

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，具备定投及大波段操作的优势，投资者可积极参与与分享新能源汽车板块的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现过超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形并已向中国证监会报告本基金的解决方案。本基金本报告期内以通讯方式召开了基金份额持有人大会并于 2016 年 6 月 29 日表决通过，同意对本基金实施转型。《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）托管协议》自 2016 年 7 月 1 日起生效，原《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产          | 附注号     | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>  |         | -                      | -                        |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 41,807,612.57          | 3,114,451.90             |
| 结算备付金       |         | 489,411.60             | 434,088.56               |
| 存出保证金       |         | 75,127.16              | 43,535.08                |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 189,835,692.79         | 39,205,781.74            |
| 其中：股票投资     |         | 189,835,692.79         | 39,205,781.74            |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收证券清算款     |         | 12,260,519.74          | -                        |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 6,046.48               | 859.08                   |
| 应收股利        |         | -                      | -                        |
| 应收申购款       |         | 6,230,092.84           | 2,080,878.68             |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| <b>资产总计</b> |         | <b>250,704,503.18</b>  | <b>44,879,595.04</b>     |

| 负债和所有者权益      | 附注号      | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|------------------------|--------------------------|
| <b>负 债：</b>   |          | -                      | -                        |
| 短期借款          |          | -                      | -                        |
| 交易性金融负债       |          | -                      | -                        |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款     |          | -                      | -                        |
| 应付证券清算款       |          | -                      | 363,757.27               |
| 应付赎回款         |          | 48,937,189.46          | 1,996,161.09             |
| 应付管理人报酬       |          | 130,961.60             | 36,077.09                |
| 应付托管费         |          | 26,192.32              | 7,215.44                 |
| 应付销售服务费       |          | -                      | -                        |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 289,645.55             | 75,306.97                |
| 应交税费          |          | -                      | -                        |
| 应付利息          |          | -                      | -                        |
| 应付利润          |          | -                      | -                        |
| 递延所得税负债       |          | -                      | -                        |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 459,020.06             | 277,522.73               |
| 负债合计          |          | 49,843,008.99          | 2,756,040.59             |
| <b>所有者权益：</b> |          | -                      | -                        |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 118,068,745.16         | 24,162,483.67            |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 82,792,749.03          | 17,961,070.78            |
| 所有者权益合计       |          | 200,861,494.19         | 42,123,554.45            |
| 负债和所有者权益总计    |          | 250,704,503.18         | 44,879,595.04            |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之基础份额净值 1.1130 元，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之稳健收益类份额参考净值 1.0358 元，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之积极收益类份额参考净值 1.1902 元，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金份额总额 180,475,094.16 份，其中国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之基础份额 172,273,659.16 份，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 4,100,717.00 份，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之积极收益类份额 4,100,718.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目   | 附注号 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|------|-----|---------------------------------------|
| 一、收入 |     | 10,826,907.26                         |

|                            |          |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|
| 1.利息收入                     |          | 62,020.61           |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 62,020.61           |
| 债券利息收入                     |          | -                   |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -                   |
| 买入返售金融资产收入                 |          | -                   |
| 其他利息收入                     |          | -                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 3,152,180.43        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 2,480,862.18        |
| 基金投资收益                     |          | -                   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | -                   |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                   |
| 贵金属投资收益                    |          | -                   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                   |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 671,318.25          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | 6,889,511.01        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 723,195.21          |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>1,231,415.27</b> |
| 1. 管理人报酬                   |          | 396,939.97          |
| 2. 托管费                     |          | 79,387.99           |
| 3. 销售服务费                   |          | -                   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 480,318.30          |
| 5. 利息支出                    |          | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                   |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 274,769.01          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>9,595,491.99</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>9,595,491.99</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |               |               |
|------------------------|---------------------------------------|---------------|---------------|
|                        | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计       |
| 一、期初所有者权益（基金净值）        | 24,162,483.67                         | 17,961,070.78 | 42,123,554.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利 | -                                     | 9,595,491.99  | 9,595,491.99  |

|  |                 |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|
| 润)                                     |                 |                 |                 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 93,906,261.49   | 55,236,186.26   | 149,142,447.75  |
| 其中: 1.基金申购款                            | 463,321,696.25  | 264,331,081.50  | 727,652,777.75  |
| 2.基金赎回款                                | -369,415,434.76 | -209,094,895.24 | -578,510,330.00 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -               | -               | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 118,068,745.16  | 82,792,749.03   | 200,861,494.19  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 周向勇, 主管会计工作负责人: 李辉, 会计机构负责人: 倪莹

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金是根据原中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“国泰中小板 300 成长 ETF”)基金份额持有人自 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 7 月 28 日期间通过通讯方式决议通过的《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》, 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]563 号《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》核准, 由原国泰中小板 300 成长 ETF 转型而来。原中小板 300 成长 ETF 存续期限至 2015 年 8 月 26 日止。自 2015 年 8 月 27 日起, 原国泰中小板 300 成长 ETF 更名为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”), 《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金合同》失效的同时《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金合同》生效, 本基金存续期限不定。本基金特定申购期自 2015 年 8 月 27 日起至 2015 年 9 月 25 日止, 期间只开放申购, 不开放赎回。原中小板 300 成长 ETF 于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 9,586,533.50 元, 已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值, 2015 年 9 月 29 日折算前本基金的基金份额净值为 1.5284 元, 精确到小数点后 9 位为 1.528420590。本基金管理人按照 1: 1.528420590 的折算比例将 2015 年 9 月 29 日登记在册的本基金份额进行了转型折算。转型折算后当日, 基金份额净值调整为 1.0000 元, 相应地, 转型折算前每 1 份基金份额将折算为 1.528420590 份。本基金的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。

根据《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金招募说明书》的规定，本基金的基金份额包括国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国泰新汽车份额”)、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“新汽车 A 份额”)及国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“新汽车 B 份额”)。国泰新汽车份额只接受场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。新汽车 A 份额与新汽车 B 份额只可上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资者可选择将其在场内申购的国泰新汽车份额按 1:1 的比例分拆成新汽车 A 份额和新汽车 B 份额，但不得申请将其场外申购的国泰新汽车份额进行分拆。投资者可将其持有的场外国泰新汽车份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成新汽车 A 份额和新汽车 B 份额后上市交易，也可按 1:1 的配比将其持有的新汽车 A 份额和新汽车 B 份额申请合并为场内的国泰新汽车份额。

在本基金新汽车 A 份额和新汽车 B 份额存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对新汽车 A 份额和新汽车 B 份额分别进行净值计算，新汽车 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金扣除掉国泰新汽车份额对应的净资产部分后剩余的净资产将优先确保新汽车 A 份额的本金及新汽车 A 份额的约定收益；新汽车 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金扣除掉国泰新汽车份额对应的净资产部分后剩余的净资产在优先确保所有新汽车 A 份额的本金及约定收益后，将计为新汽车 B 份额的净资产。

基金份额净值按如下原则计算：新汽车 A 份额的基金份额净值，自转型折算与自动分离日次日(含)起至第 1 个基金份额折算基准日(含)期间、或自上一个基金份额折算基准日(定期折算日或不定期折算基准日)次日(含)起至下一个基金份额折算基准日(含)期间，以 1.0000 元为基准，新汽车 A 的约定日单利收益率(约定基准收益率除以 365)累计计算。本基金 1 份新汽车 A 份额与 1 份新汽车 B 份额构成一对份额组合，一对份额组合的基金份额净值之和等于 2 份国泰新汽车份额的基金份额净值。计算出新汽车 A 份额的基金份额净值后，根据上述关系，计算出新汽车 B 份额的基金份额净值。

本基金定期进行份额折算。在每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的 12 月 15 日(如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日)，本基金根据基金合同的规定对新汽车 A 和国泰新汽车份额进行定期份额折算。折算前的新汽车 A 份额持有人，以新汽车 A 份额在基金份额折算基准日的基

金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰新汽车份额的份额分配。折算不改变新汽车 A 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 A 份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰新汽车份额。折算前的国泰新汽车份额的基金份额持有人，以每 2 份国泰新汽车份额，按 1 份新汽车 A 份额的份额分配，获得新增国泰新汽车份额。持有场外国泰新汽车份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国泰新汽车份额的分配；持有场内国泰新汽车份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国泰新汽车份额的分配。折算不改变国泰新汽车份额持有人的资产净值。折算不改变新汽车 B 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 B 份额的基金份额净值及份额数量不变。除以上基金份额定期折算外，本基金还将在国泰新汽车份额的份额净值大于或等于 1.5000 时以及新汽车 B 份额的份额净值小于或等于 0.2500 时进行不定期折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 85%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证投资不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：国证新能源汽车指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2016 年 8 月 24 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取

得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 41,807,612.57          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 41,807,612.57          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 179,384,666.41         | 189,835,692.79 | 10,451,026.38 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | -              | -             |
|               | 银行间市场                  | -              | -             |
|               | 合计                     | -              | -             |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |
| 其他            | -                      | -              | -             |
| 合计            | 179,384,666.41         | 189,835,692.79 | 10,451,026.38 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 5,809.88               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 194.22                 |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | 11.96                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 30.42                  |
| 合计         | 6,046.48               |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 289,645.55             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 289,645.55             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 184,431.00             |
| 指数使用费       | 50,000.00              |
| 预提费用        | 224,589.06             |
| 合计          | 459,020.06             |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 36,931,519.93                         | 24,162,483.67   |
| 本期申购          | 708,178,348.65                        | 463,321,696.25  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -564,634,774.42                       | -369,415,434.76 |
| 本期末           | 180,475,094.16                        | 118,068,745.16  |

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 27,905,691.57   | -9,944,620.79   | 17,961,070.78   |
| 本期利润           | 2,705,980.98    | 6,889,511.01    | 9,595,491.99    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 104,173,212.33  | -48,937,026.07  | 55,236,186.26   |
| 其中：基金申购款       | 511,488,555.84  | -247,157,474.34 | 264,331,081.50  |
| 基金赎回款          | -407,315,343.51 | 198,220,448.27  | -209,094,895.24 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 134,784,884.88  | -51,992,135.85  | 82,792,749.03   |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 1,964.41                              |
| 其他        | 560.86                                |
| 合计        | 62,020.61                             |

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|    |                                       |

|            |                |
|------------|----------------|
| 卖出股票成交总额   | 115,280,776.22 |
| 减：卖出股票成本总额 | 112,799,914.04 |
| 买卖股票差价收入   | 2,480,862.18   |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 671,318.25                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 671,318.25                 |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 6,889,511.01               |
| ——股票投资     | 6,889,511.01               |
| ——债券投资     | -                          |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——基金投资     | -                          |
| ——贵金属投资    | -                          |
| ——其他       | -                          |
| 2.衍生工具     | -                          |
| ——权证投资     | -                          |
| 3.其他       | -                          |
| 合计         | 6,889,511.01               |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 723,195.21                 |
| 合计      | 723,195.21                 |

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的

25%归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 480,318.30                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 480,318.30                 |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 30,000.00                  |
| 信息披露费    | 74,589.06                  |
| 银行汇划费用   | 8,179.95                   |
| 指数使用费    | 100,000.00                 |
| 持有人大会律师费 | 50,000.00                  |
| 持有人大会公证费 | 12,000.00                  |
| 合计       | 274,769.01                 |

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内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 2016 年 5 月 27 日起至 2016 年 6 月 28 日 17:00 止。本次会议议案于 2016 年 6 月 29 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：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》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，同意对国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型，并修订《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》。为实施本基金转型方案，同意授权基金管理人办理本次转型的具

体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》的相关内容对《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对本基金实施转型。《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）托管协议》自 2016 年 7 月 1 日起生效，原《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 国泰基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 396,939.97                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 101,080.90                 |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% ÷ 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                |                      |
|----------------|----------------------|
|                | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 79,387.99            |

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 41,807,612.57              | 59,495.34 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 600773 | 西藏城投 | 2016-06-30 | 重大事项 | 15.67  | -          | -      | 152,358.00   | 2,354,937.16 | 2,387,449.86 | -  |
| 002249 | 大洋电机 | 2016-06-16 | 重大事项 | 11.97  | 2016-07-28 | 10.77  | 104,718.00   | 1,044,244.04 | 1,253,474.46 | -  |

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金采取基金份额分级的结构设计，不同基金份额具有不同的风险收益特征。国泰新汽车份额为普通股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其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 的风险与预期收益较低；新汽车 B 份额采用杠杆式结构，风险和预期收益有所放大，高于普通的股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，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%。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。同时，本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2015 年 12 月 31 日：同）

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持的证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末<br>2016 年 6 月 30<br>日   | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|-----------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                          |               |       |       |                |                |
| 银行存款                        | 41,807,612.57 | -     | -     | -              | 41,807,612.57  |
| 结算备付金                       | 489,411.60    | -     | -     | -              | 489,411.60     |
| 存出保证金                       | 75,127.16     | -     | -     | -              | 75,127.16      |
| 交易性金融资产                     | -             | -     | -     | 189,835,692.79 | 189,835,692.79 |
| 应收证券清算款                     | -             | -     | -     | 12,260,519.74  | 12,260,519.74  |
| 应收利息                        | -             | -     | -     | 6,046.48       | 6,046.48       |
| 应收申购款                       | 4,066.00      | -     | -     | 6,226,026.84   | 6,230,092.84   |
| 资产总计                        | 42,376,217.33 | -     | -     | 208,328,285.85 | 250,704,503.18 |
| 负债                          |               |       |       |                |                |
| 应付赎回款                       | -             | -     | -     | 48,937,189.46  | 48,937,189.46  |
| 应付管理人报酬                     | -             | -     | -     | 130,961.60     | 130,961.60     |
| 应付托管费                       | -             | -     | -     | 26,192.32      | 26,192.32      |
| 应付交易费用                      | -             | -     | -     | 289,645.55     | 289,645.55     |
| 其他负债                        | -             | -     | -     | 459,020.06     | 459,020.06     |
| 负债总计                        | -             | -     | -     | 49,843,008.99  | 49,843,008.99  |
| 利率敏感度缺口                     | 42,376,217.33 | -     | -     | 158,485,276.86 | 200,861,494.19 |
| 上年度末<br>2015 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                          |               |       |       |                |                |
| 银行存款                        | 3,114,451.90  | -     | -     | -              | 3,114,451.90   |
| 结算备付金                       | 434,088.56    | -     | -     | -              | 434,088.56     |
| 存出保证金                       | 43,535.08     | -     | -     | -              | 43,535.08      |
| 交易性金融资产                     | -             | -     | -     | 39,205,781.74  | 39,205,781.74  |
| 应收利息                        | -             | -     | -     | 859.08         | 859.08         |
| 应收申购款                       | 11,000.83     | -     | -     | 2,069,877.85   | 2,080,878.68   |
| 资产总计                        | 3,603,076.37  | -     | -     | 41,276,518.67  | 44,879,595.04  |

| 负债      |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付证券清算款 | -            | - | - | 363,757.27    | 363,757.27    |
| 应付赎回款   | -            | - | - | 1,996,161.09  | 1,996,161.09  |
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 36,077.09     | 36,077.09     |
| 应付托管费   | -            | - | - | 7,215.44      | 7,215.44      |
| 应付交易费用  | -            | - | - | 75,306.97     | 75,306.97     |
| 其他负债    | -            | - | - | 277,522.73    | 277,522.73    |
| 负债总计    | -            | - | - | 2,756,040.59  | 2,756,040.59  |
| 利率敏感度缺口 | 3,603,076.37 | - | - | 38,520,478.08 | 42,123,554.45 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：未持有），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪新能源汽车指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数

成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 189,835,692.<br>79     | 94.51                | 39,205,781.74            | 93.07                |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 其他            | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 合计            | 189,835,692.<br>79     | 94.51                | 39,205,781.74            | 93.07                |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 186,194,768.47 元，属于第二层次的余额为 3,640,924.32 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 36,457,648.74 元，第二层次 2,748,133.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 189,835,692.79 | 75.72         |
|    | 其中：股票             | 189,835,692.79 | 75.72         |
| 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      | 42,297,024.17  | 16.87         |
| 7  | 其他各项资产            | 18,571,786.22  | 7.41          |
| 8  | 合计                | 250,704,503.18 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | 3,945,064.80   | 1.96          |
| C  | 制造业              | 162,147,812.46 | 80.73         |
| 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          | 2,253,727.35   | 1.12  |
| 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 | 9,211,439.29   | 4.59  |
| J | 金融业             | -              | -     |
| K | 房地产业            | 2,387,449.86   | 1.19  |
| 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              | 7,292,373.00   | 3.63  |
|   | 合计              | 187,237,866.76 | 93.22 |

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值         | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|------------------|--------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -                |
| B  | 采矿业              | -            | -                |
| C  | 制造业              | 2,597,826.03 | 1.29             |
| 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            | 2,597,826.03 | 1.29 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 002466 | 天齐锂业 | 237,476 | 10,137,850.44 | 5.05         |
| 2  | 000839 | 中信国安 | 432,259 | 9,211,439.29  | 4.59         |
| 3  | 600066 | 宇通客车 | 448,304 | 8,876,419.20  | 4.42         |
| 4  | 002594 | 比亚迪  | 139,426 | 8,506,380.26  | 4.23         |
| 5  | 002407 | 多氟多  | 176,724 | 7,526,675.16  | 3.75         |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 376,275 | 7,299,735.00  | 3.63         |
| 7  | 000009 | 中国宝安 | 532,290 | 7,292,373.00  | 3.63         |
| 8  | 000559 | 万向钱潮 | 450,905 | 7,034,118.00  | 3.50         |
| 9  | 002460 | 赣锋锂业 | 191,524 | 6,406,477.80  | 3.19         |
| 10 | 002176 | 江特电机 | 403,915 | 6,220,291.00  | 3.10         |
| 11 | 600549 | 厦门钨业 | 187,996 | 5,585,361.16  | 2.78         |
| 12 | 000970 | 中科三环 | 363,990 | 5,281,494.90  | 2.63         |
| 13 | 600699 | 均胜电子 | 126,883 | 4,859,618.90  | 2.42         |
| 14 | 002179 | 中航光电 | 111,477 | 4,829,183.64  | 2.40         |
| 15 | 300014 | 亿纬锂能 | 109,957 | 4,749,042.83  | 2.36         |
| 16 | 002070 | 众和股份 | 183,364 | 4,629,941.00  | 2.31         |
| 17 | 002108 | 沧州明珠 | 161,738 | 4,189,014.20  | 2.09         |
| 18 | 600478 | 科力远  | 329,485 | 3,976,883.95  | 1.98         |
| 19 | 000762 | 西藏矿业 | 159,590 | 3,945,064.80  | 1.96         |
| 20 | 600418 | 江淮汽车 | 308,319 | 3,909,484.92  | 1.95         |
| 21 | 600884 | 杉杉股份 | 208,807 | 3,593,568.47  | 1.79         |
| 22 | 002276 | 万马股份 | 179,497 | 3,555,835.57  | 1.77         |
| 23 | 600366 | 宁波韵升 | 144,666 | 3,453,177.42  | 1.72         |
| 24 | 300207 | 欣旺达  | 123,291 | 3,164,879.97  | 1.58         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 25 | 002709 | 天赐材料 | 44,201  | 3,091,417.94 | 1.54 |
| 26 | 300073 | 当升科技 | 45,837  | 3,068,328.78 | 1.53 |
| 27 | 000973 | 佛塑科技 | 278,827 | 2,910,953.88 | 1.45 |
| 28 | 600006 | 东风汽车 | 316,509 | 2,807,434.83 | 1.40 |
| 29 | 600580 | 卧龙电气 | 241,361 | 2,705,656.81 | 1.35 |
| 30 | 002056 | 横店东磁 | 158,884 | 2,701,028.00 | 1.34 |
| 31 | 002664 | 信质电机 | 71,570  | 2,434,811.40 | 1.21 |
| 32 | 600773 | 西藏城投 | 152,358 | 2,387,449.86 | 1.19 |
| 33 | 002091 | 江苏国泰 | 142,191 | 2,253,727.35 | 1.12 |
| 34 | 002358 | 森源电气 | 134,706 | 2,078,513.58 | 1.03 |
| 35 | 300037 | 新宙邦  | 31,422  | 2,048,400.18 | 1.02 |
| 36 | 600563 | 法拉电子 | 43,977  | 2,001,833.04 | 1.00 |
| 37 | 002411 | 必康股份 | 103,717 | 1,851,348.45 | 0.92 |
| 38 | 601777 | 力帆股份 | 156,325 | 1,839,945.25 | 0.92 |
| 39 | 600096 | 云天化  | 192,796 | 1,793,002.80 | 0.89 |
| 40 | 000049 | 德赛电池 | 42,706  | 1,791,089.64 | 0.89 |
| 41 | 000868 | 安凯客车 | 207,431 | 1,578,549.91 | 0.79 |
| 42 | 300224 | 正海磁材 | 69,357  | 1,572,323.19 | 0.78 |
| 43 | 600135 | 乐凯胶片 | 90,557  | 1,541,280.14 | 0.77 |
| 44 | 002139 | 拓邦股份 | 104,189 | 1,506,572.94 | 0.75 |
| 45 | 603799 | 华友钴业 | 39,294  | 1,461,736.80 | 0.73 |
| 46 | 600680 | 上海普天 | 30,103  | 1,297,740.33 | 0.65 |
| 47 | 002249 | 大洋电机 | 104,718 | 1,253,474.46 | 0.62 |
| 48 | 002227 | 奥特迅  | 31,424  | 1,026,936.32 | 0.51 |

### 7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300001 | 特锐德  | 62,395 | 1,353,347.55 | 0.67         |
| 2  | 300134 | 大富科技 | 41,538 | 1,244,478.48 | 0.62         |

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 002466 | 天齐锂业 | 15,250,990.78 | 36.21          |
| 2  | 000839 | 中信国安 | 14,523,355.31 | 34.48          |
| 3  | 002594 | 比亚迪  | 13,031,915.29 | 30.94          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 4  | 600066 | 宇通客车 | 12,982,880.63 | 30.82 |
| 5  | 000559 | 万向钱潮 | 10,782,724.07 | 25.60 |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 10,698,262.79 | 25.40 |
| 7  | 000009 | 中国宝安 | 10,293,731.46 | 24.44 |
| 8  | 002407 | 多氟多  | 9,654,074.73  | 22.92 |
| 9  | 002460 | 赣锋锂业 | 8,582,487.33  | 20.37 |
| 10 | 002176 | 江特电机 | 8,391,067.40  | 19.92 |
| 11 | 000970 | 中科三环 | 7,399,073.00  | 17.57 |
| 12 | 600699 | 均胜电子 | 6,651,528.15  | 15.79 |
| 13 | 600549 | 厦门钨业 | 6,144,983.43  | 14.59 |
| 14 | 002179 | 中航光电 | 5,964,160.19  | 14.16 |
| 15 | 002276 | 万马股份 | 5,739,948.00  | 13.63 |
| 16 | 300014 | 亿纬锂能 | 5,573,133.50  | 13.23 |
| 17 | 002070 | 众和股份 | 5,546,071.00  | 13.17 |
| 18 | 000762 | 西藏矿业 | 5,526,248.23  | 13.12 |
| 19 | 600418 | 江淮汽车 | 5,299,506.50  | 12.58 |
| 20 | 600478 | 科力远  | 5,107,845.75  | 12.13 |
| 21 | 002108 | 沧州明珠 | 4,968,045.00  | 11.79 |
| 22 | 600884 | 杉杉股份 | 4,826,571.00  | 11.46 |
| 23 | 600366 | 宁波韵升 | 4,529,931.65  | 10.75 |
| 24 | 300207 | 欣旺达  | 4,385,664.53  | 10.41 |
| 25 | 600580 | 卧龙电气 | 3,673,962.54  | 8.72  |
| 26 | 002056 | 横店东磁 | 3,545,656.76  | 8.42  |
| 27 | 000973 | 佛塑科技 | 3,366,028.00  | 7.99  |
| 28 | 300073 | 当升科技 | 3,170,780.00  | 7.53  |
| 29 | 002709 | 天赐材料 | 3,114,764.79  | 7.39  |
| 30 | 002091 | 江苏国泰 | 2,843,646.50  | 6.75  |
| 31 | 600773 | 西藏城投 | 2,836,470.00  | 6.73  |
| 32 | 002358 | 森源电气 | 2,835,127.35  | 6.73  |
| 33 | 002664 | 信质电机 | 2,834,926.20  | 6.73  |
| 34 | 600006 | 东风汽车 | 2,715,646.00  | 6.45  |
| 35 | 600096 | 云天化  | 2,544,506.56  | 6.04  |
| 36 | 601777 | 力帆股份 | 2,402,877.00  | 5.70  |
| 37 | 002411 | 必康股份 | 2,389,657.07  | 5.67  |
| 38 | 600563 | 法拉电子 | 2,385,304.50  | 5.66  |
| 39 | 300037 | 新宙邦  | 2,291,606.30  | 5.44  |
| 40 | 000049 | 德赛电池 | 2,245,730.06  | 5.33  |
| 41 | 000868 | 安凯客车 | 2,063,912.50  | 4.90  |
| 42 | 600135 | 乐凯胶片 | 1,994,205.00  | 4.73  |
| 43 | 002139 | 拓邦股份 | 1,890,974.14  | 4.49  |
| 44 | 300224 | 正海磁材 | 1,743,522.24  | 4.14  |
| 45 | 600680 | 上海普天 | 1,727,175.50  | 4.10  |
| 46 | 002484 | 江海股份 | 1,630,785.90  | 3.87  |
| 47 | 300001 | 特锐德  | 1,528,171.22  | 3.63  |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 48 | 002249 | 大洋电机  | 1,484,360.00 | 3.52 |
| 49 | 603799 | 华友钴业  | 1,476,659.32 | 3.51 |
| 50 | 300134 | 大富科技  | 1,382,920.24 | 3.28 |
| 51 | 600367 | 红星发展  | 1,289,186.00 | 3.06 |
| 52 | 002227 | 奥 特 迅 | 1,277,552.67 | 3.03 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 002466 | 天齐锂业 | 7,097,932.21 | 16.85           |
| 2  | 000839 | 中信国安 | 6,982,305.85 | 16.58           |
| 3  | 002594 | 比亚迪  | 6,406,068.20 | 15.21           |
| 4  | 600066 | 宇通客车 | 6,033,054.39 | 14.32           |
| 5  | 000559 | 万向钱潮 | 4,950,809.48 | 11.75           |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 4,865,291.21 | 11.55           |
| 7  | 000009 | 中国宝安 | 4,571,655.26 | 10.85           |
| 8  | 002407 | 多氟多  | 4,281,779.43 | 10.16           |
| 9  | 002460 | 赣锋锂业 | 4,047,175.83 | 9.61            |
| 10 | 000970 | 中科三环 | 3,456,673.48 | 8.21            |
| 11 | 002276 | 万马股份 | 2,929,876.19 | 6.96            |
| 12 | 002176 | 江特电机 | 2,898,612.25 | 6.88            |
| 13 | 002179 | 中航光电 | 2,569,634.56 | 6.10            |
| 14 | 000762 | 西藏矿业 | 2,557,434.95 | 6.07            |
| 15 | 600549 | 厦门钨业 | 2,533,781.79 | 6.02            |
| 16 | 600418 | 江淮汽车 | 2,521,205.11 | 5.99            |
| 17 | 600699 | 均胜电子 | 2,483,141.90 | 5.89            |
| 18 | 600884 | 杉杉股份 | 2,361,718.85 | 5.61            |
| 19 | 600478 | 科力远  | 2,352,964.38 | 5.59            |
| 20 | 300207 | 欣旺达  | 2,203,464.59 | 5.23            |
| 21 | 002484 | 江海股份 | 2,197,193.87 | 5.22            |
| 22 | 600366 | 宁波韵升 | 2,152,786.04 | 5.11            |
| 23 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,083,051.75 | 4.95            |
| 24 | 002056 | 横店东磁 | 2,054,125.92 | 4.88            |
| 25 | 002108 | 沧州明珠 | 2,039,903.65 | 4.84            |
| 26 | 600367 | 红星发展 | 1,665,896.64 | 3.95            |
| 27 | 600580 | 卧龙电气 | 1,572,687.70 | 3.73            |
| 28 | 000973 | 佛塑科技 | 1,405,138.99 | 3.34            |
| 29 | 300073 | 当升科技 | 1,286,455.42 | 3.05            |
| 30 | 002070 | 众和股份 | 1,263,988.12 | 3.00            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 31 | 002709 | 天赐材料 | 1,260,924.21 | 2.99 |
| 32 | 002358 | 森源电气 | 1,253,624.02 | 2.98 |
| 33 | 002664 | 信质电机 | 1,209,497.34 | 2.87 |
| 34 | 600096 | 云天化  | 1,174,096.83 | 2.79 |
| 35 | 601777 | 力帆股份 | 1,062,786.27 | 2.52 |
| 36 | 600563 | 法拉电子 | 1,026,015.14 | 2.44 |
| 37 | 002411 | 必康股份 | 990,186.59   | 2.35 |
| 38 | 002091 | 江苏国泰 | 960,883.37   | 2.28 |
| 39 | 000049 | 德赛电池 | 959,723.81   | 2.28 |
| 40 | 300037 | 新宙邦  | 942,304.08   | 2.24 |
| 41 | 600006 | 东风汽车 | 926,038.66   | 2.20 |
| 42 | 600135 | 乐凯胶片 | 914,393.48   | 2.17 |
| 43 | 000868 | 安凯客车 | 902,479.03   | 2.14 |
| 44 | 002249 | 大洋电机 | 858,421.33   | 2.04 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 256,540,314.08 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 115,280,776.22 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 75,127.16     |
| 2  | 应收证券清算款 | 12,260,519.74 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 6,046.48      |
| 5  | 应收申购款   | 6,230,092.84  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 18,571,786.22 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别  | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |        |                |         |
|-------|----------|-----------|-------|--------|----------------|---------|
|       |          |           | 机构投资者 |        | 个人投资者          |         |
|       |          |           | 持有份额  | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例  |
| 新汽车   | 11,803   | 14,595.75 | -     | -      | 172,273,659.16 | 100.00% |
| 新汽车 A | 686      | 5,977.72  | -     | -      | 4,100,717.00   | 100.00% |
| 新汽车 B | 709      | 5,783.81  | 3.00  | 0.00%  | 4,100,715.00   | 100.00% |
| 合计    | 13,198   | 13,674.43 | 3.00  | 0.00%  | 180,475,091.16 | 100.00% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别  | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 新汽车   | 627.26    | 0.00%    |
|                  | 新汽车 A | 0.00      | 0.00%    |
|                  | 新汽车 B | 0.00      | 0.00%    |
|                  | 合计    | 627.26    | 0.00%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别  | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 新汽车   | 0                 |
|                                | 新汽车 A | 0                 |
|                                | 新汽车 B | 0                 |
|                                | 合计    | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 新汽车   | 0                 |
|                                | 新汽车 A | 0                 |
|                                | 新汽车 B | 0                 |
|                                | 合计    | 0                 |

### 9 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         |
|--------------------------------|----------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2015 年 8 月 27 日）基金份额总额 | 5,132,924.00   | -             | -             |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 22,843,472.93  | 7,044,023.00  | 7,044,024.00  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 708,178,348.65 | -             | -             |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 564,634,774.42 | -             | -             |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | 5,886,612.00   | -2,943,306.00 | -2,943,306.00 |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 172,273,659.16 | 4,100,717.00  | 4,100,718.00  |

### 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本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 2016 年 5 月 27 日起至 2016 年 6 月 28 日 17:00 止。参加本次基金份额持有人大会投票表决的本基金基金份额持有人及代理人所持本基金的基础份额（以下简称“国泰新汽车份额”）共计 158,315,593.00 份、本基金的稳健收益类份额（以下简称“新汽车 A 份额”）共计 9,750,018.00 份、本基金的积极收益类份额（以下简称“新汽车 B 份额”）共计 9,750,000.00 份，分别占权益登记日国泰新汽车份额总份额 248,348,561.23 份、新汽车 A 份额总份额 14,452,273.00 份、新汽车 B 份额总份额 14,452,274.00 份的 63.75%、67.46%、67.46%，达到法定开会条件，符合《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》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定。

本次大会审议了《关于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》（以下简称“本次会议议案”），并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案进行表决，表决结果为：158,315,593.00 份国泰新汽车份额同意，0 份国泰新汽车份额反对，0 份国泰新汽车份额弃权；9,750,018.00 份新汽车 A 份额同意，0 份新汽车 A 份额反对，0 份新汽车 A 份额弃权；9,750,000.00 份新汽车 B 份额同意，0 份新汽车 B 份额反对，0 份新汽车 B 份额弃权。同意本次会议议案的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额分别占参加本次会议表决的持有人及代理人所持国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自类别内的表决权的 100%、100%、100%，均达三分之二以上，符合《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》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金转型有关事项的议案获得通过。

决议内容如下：“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》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，同意对国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型，并修订《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》。为实施本基金转型方案，同意授权基金管理人办理本次转型的具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》的相关内容对《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对本基金实施转型”。

本基金正式实施转型日为 2016 年 7 月 1 日。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，聘任李永梅女士担任公司督察长；

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理，且不再代为履行督察长职务；

2016 年 6 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过，张峰先生不再担任本基金管理人总经理，由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务；

2016 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理，公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务；

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中金公司 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 申万宏源 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信建投 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 万联证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 1      | 272,371,440.42 | 73.25%       | 253,661.42 | 76.39%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 53,989,966.82  | 14.52%       | 39,483.36  | 11.89%     | -  |
| 安信证券 | 1      | 28,336,306.09  | 7.62%        | 26,389.74  | 7.95%      | -  |
| 国金证券 | 1      | 17,123,376.97  | 4.61%        | 12,522.50  | 3.77%      | -  |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中金公司 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 万联证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 安信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                        | 法定披露日期     |
|----|--|-------------------------------|------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司关于指数熔断当日调整旗下部分基金开放时间及申购、赎回等业务安排的临时公告 | 公司官网                          | 2016-01-04 |
| 2  | 国泰基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告        | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-01-06 |
| 3  | 国泰基金管理有限公司关于指数熔断当日调整旗下部分基金开放时间及申购、赎回等业务安排的临时公告 | 公司官网                          | 2016-01-07 |
| 4  | 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                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-01-09 |

|    |   |                               |            |
|----|---|-------------------------------|------------|
| 5  | 国泰基金管理有限公司督察长任职公告   | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-03-26 |
| 6  | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-03-26 |
| 7  | 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-04-19 |
| 8  | 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金调整大额申购及定期定额投资业务金额限制的公告                       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-05-12 |
| 9  | 国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金恢复大额申购及定期定额投资业务的公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-05-24 |
| 10 | 关于以通讯方式召开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的公告                        | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-05-27 |
| 11 | 关于以通讯方式召开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的第一次提示性公告                  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-05-30 |
| 12 | 关于以通讯方式召开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的第二次提示性公告                  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-05-31 |
| 13 | 关于国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型期间的流动性风险提示公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-06-08 |
| 14 | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-06-08 |
| 15 | 关于国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型期间的流动性风险提示公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-06-17 |
| 16 | 国泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告                                       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-06-18 |
| 17 | 关于国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型期间的流动性风险提示公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-06-24 |
| 18 | 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                        | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-06-30 |
| 19 | 国泰基金管理有限公司关于国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型期间暂停申购、赎回等相关业务并终止办理配对转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-06-30 |
| 20 | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-07-12 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

依据《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》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金本报告期内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 2016 年 5 月 27 日起至 2016 年 6 月 28 日 17:00 止。本次会议议案于 2016 年 6 月 29 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：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》和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，同意对国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金实施转型，并修订《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》。为实施本基金转型方案，同意授权基金管理人办理本次转型的具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》的相关内容对《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对本基金实施转型。《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）托管协议》自 2016 年 7 月 1 日起生效，原《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议》将自同一起失效。具体可查阅本基金管理人于 2016 年 6 月 30 日披露的《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》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 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

## 12.2 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。

## 12.3 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  
二〇一六年八月二十六日