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清算报告

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
公告日期:2015年11月6日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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(以下简称“本基金”)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[2011]1206号《关于核准国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称“本公司”)向社会公开发行募集,基金合同于2012年3月15日生效。基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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》和《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基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议《关于终止国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。大会投票表决起止时间为自2015年6月29日起至2015年7月28日17:00止,本次会议议案于2015年7月29日表决通过,自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。本公司于2015年7月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了“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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告”。依据生效的基金份额持有人大会决议,本基金从2015年7月30日起进入清算期。

本基金清算期为2015年7月30日到2015年8月26日。由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、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2015年7月30日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	国泰中小板300成长ETF联接
基金主代码	020025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月15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
2015年7月30日基金份额总额	18,225,880.65份

2.2 基金产品说明

本基金的目标ETF	中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。 1.资产配置策略 为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非标的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。 在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2.目标ETF投资策略 (1)投资组合的构建 基金合同生效后,在建仓期内本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,在目标ETF开放申购赎回后将股票组合换购成目标ETF份额,使本基金投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%。 (2)投资组合的投资方式 本基金投资目标ETF的两种方式如下: 1)申购和赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回。 2)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标ETF基金份额,也可以在二级市场上买卖目标ETF基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况,综合考虑流动性、成本、效率等因素,决定目标ETF的投资方式。本基金以申购和赎回为主:当收到净申购时,构建股票组合、申购目标ETF;当收到净赎回时,赎回目标ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股,本基金将选择作为后续实物申购目标ETF的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标ETF基金份额是出于追求基金充分投资、降低跟踪误差的目的,不以套利为目的。 3.成份股、备选成份股投资策略 本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,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,基金管理人将酌配使用其他合理方法进行适当的替代。 4.债券投资策略 债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合,在一定的风险度下能提供最大的预期收益,或者在确定收益率上承担最小的风险。 5.股指期货及其他金融衍生品的投资策略 本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中小板300成长指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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
信息披露负责人	姓名	巴立康	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

3 基金最后运作日财务会计报告(经审计)

3.1 资产负债表
会计主体: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
报告截止日:2015年7月29日(基金最后运作日)
单位:人民币元

项目	本期末 2015年7月29日 (基金最后运作日)	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	4,301,292.01	11,434,405.15
结算备付金	4,171,582.33	545,511.35
存出保证金	40,158.64	27,349.57
交易性金融资产	12,629,304.83	14,747,757.13
其中:股票投资	-	305,090.00
基金投资	12,629,304.83	14,442,667.13
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	565,499.10	-
应收利息	25,723.99	559.51
应收股利	-	-
应收申购款	-	589,010.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	21,733,560.90	27,344,592.80
负债和所有者权益	本期末 2015年7月29日 (基金最后运作日)	上年度末 2014年12月31日
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	-	111,348.67
应付赎回款	1,947,487.19	10,882,570.05
应付管理人报酬	1,828.65	1,348.65
应付托管费	365.75	269.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	95,912.20	45,498.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	128,380.55	102,147.82
负债合计	2,173,974.34	11,143,183.74
所有者权益:	-	-
实收基金	18,248,926.86	15,194,414.88
未分配利润	1,310,659.70	1,006,994.18
所有者权益合计	19,559,586.56	16,201,409.06
负债和所有者权益总计	21,733,560.90	27,344,592.80

注:报告截止日2015年7月29日(基金最后运作日),基金单位份额净值1.072元,基金份额总额18,248,926.86份。

3.2 利润表
会计主体: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
本报告期:2015年1月1日至2015年7月29日(基金最后运作日)
单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月29日(基金最后运作日)止期间	上年度可比期间 2014年度
一、收入	16,365,995.97	1,248,559.70
1.利息收入	41,908.25	19,261.35
其中:存款利息收入	41,908.25	19,261.35
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)	14,529,077.38	3,508,161.75
其中:股票投资收益	-1,069,279.13	-56,116.67
基金投资收益	15,597,876.90	3,564,278.42
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	479.61	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,428,457.31	-2,378,301.92
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	366,553.03	99,438.52
减:二、费用	447,727.29	380,071.23
1. 管理人报酬	21,101.07	11,903.96
2. 托管费	4,220.25	2,380.69
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	284,421.18	152,461.93
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	137,984.79	213,324.65
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	15,918,268.68	868,488.47
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	15,918,268.68	868,488.47

3.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体: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
本报告期:2015年1月1日至2015年7月29日(基金最后运作日)
单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月29日(基金最后运作日)止期间		
	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)	15,194,414.88	1,006,994.18	16,201,409.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,918,268.68	15,918,268.68
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)	3,054,511.98	86,015,309.86	89,069,821.84
其中:1.基金申购款	236,118,328.84	152,872,131.36	388,990,460.20
2.基金赎回款	-233,063,816.86	-66,856,821.50	-299,920,638.36
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)	-	-101,629,913.02	-101,629,913.02
五、期末所有者权益(基金净值)	18,248,926.86	1,310,659.70	19,559,586.56
项目	上年度可比期间 2014年度		
	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)	49,734,909.97	1,179,600.97	50,914,510.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	868,488.47	868,488.47
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)	-34,540,495.09	-1,041,095.26	-35,581,590.35
其中:1.基金申购款	58,350,643.29	4,965,479.75	63,316,123.04
2.基金赎回款	-92,891,138.38	-6,006,575.01	-98,897,713.39
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)	15,194,414.88	1,006,994.18	16,201,409.06

4 清算期财务会计报告(经审计)

4.1 资产负债表
会计主体: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
报告截止日:2015年8月26日(基金清算结束日)
单位:人民币元

项目	本期末 2015年8月26日 (基金清算结束日)	本期末 2015年7月29日 (基金最后运作日)
资产:	-	-
银行存款	18,896,934.85	4,301,292.01
结算备付金	102,251.33	4,171,582.33
存出保证金	39,871.12	40,158.64
交易性金融资产	-	12,629,304.83
其中:股票投资		-
基金投资		12,629,304.83
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		565,499.10
应收利息	33,062.98	25,723.99
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计	19,072,120.28	21,733,560.90
负债和所有者权益	本期末 2015年8月26日 (基金清算结束日)	本期末 2015年7月29日 (基金最后运作日)
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		1,947,487.19
应付管理人报酬		1,828.65
应付托管费		365.75
应付销售服务费		-
应付交易费用	-	95,912.20
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	200,215.00	128,380.55
负债合计	200,215.00	2,173,974.34
所有者权益:		-
实收基金	18,225,880.65	18,248,926.86
未分配利润	646,024.63	1,310,659.70
所有者权益合计	18,871,905.28	19,559,586.56
负债和所有者权益总计	19,072,120.28	21,733,560.90

4.2 利润表
会计主体: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
本报告期:2015年7月30日(基金开始清算日)至2015年8月26日(基金结束清算日)
单位:人民币元

项目	本期 2015年7月30日(基金开始清算日)至2015年8月26日(基金结束清算日)止期间
一、资产处置损益	-621,938.24
1.利息收入	7,338.99
其中:存款利息收入	7,338.99
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)	598,906.36
其中:股票投资收益	-44,281.75
基金投资收益	643,188.11
债券投资收益	
资产支持证券投资收益	
贵金属投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,228,214.40
4.其他收入(损失以“-”号填列)	30.81
减:二、清算费用	41,037.50
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	
4. 交易费用	24,494.63
5. 利息支出	
其中:卖出回购金融资产支出	
6. 其他费用	16,542.87
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	-662,975.74

4.3所有者权益(基金净值)变动表
会计主体: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
本报告期:2015年7月30日(基金清算开始日)至2015年8月26日(基金清算结束日)止期间

项目	本期 2015年7月30日(基金清算开始日)至2015年8月26日(基金清算结束日)止期间		
	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)	18,248,926.86	1,310,659.70	19,559,586.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-662,975.74	-662,975.74
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)	-23,046.21	-1,659.33	-24,705.54
其中:1.基金申购款	-	-	-
其中:2.基金赎回款(以“-”号填列)	-23,046.21	-1,659.33	-24,705.54
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)	18,225,880.65	646,024.63	18,871,905.28

5 清盘事项说明

5.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)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[2011]1206号《关于核准国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由基金管理人国泰基金管理有限公司向社会公开发行募集。首次设立募集规模为693,297,939.72份基金份额,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第055号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2012年3月15日生效。本基金为契约型开放式基金,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金是中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是主要采用完全复制法实现对中小板300成长指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将年化跟踪误差控制在4%以内。

本基金的投资范围为目标ETF、标的指数(即中小板300成长指数)成份股和备选成份股,少量投资于非标的指数成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%;现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为中小板300成长指数收益率*95%+银行活期存款税后利率*5%。

国泰基金管理有限公司于2015年6月29日发布以通讯方式召开本基金全份额持有人大会的公告,审议《关于终止国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。大会投票表决起止时间为自2015年6月29日起至2015年7月28日17:00止,本次会议议案于2015年7月29日表决通过,自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。本公司于2015年7月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了“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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告”。依据生效的基金份额持有人大会决议,本基金从2015年7月30日起进入清算期。

本基金清算期为2015年7月30日至2015年8月26日。由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、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2015年7月30日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

5.2 清算原因

本基金基金份额持有人大会审议通过《关于终止国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。

5.3 清算起始日

根据生效的本基金基金份额持有人大会决议,本基金于2015年7月30日起进入清算期,清算期为2015年7月30日至2015年8月26日。

5.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起,资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致,本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

6 清算情况

自2015年7月30日至2015年8月26日清算期间,基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算,全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

6.1 清算费用

按照《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基金合同》第二十四部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定,清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况,从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

6.2资产处置情况

(1)本基金最后运作日应收利息人民币25,723.99元,该款项由基金管理人国泰基金管理有限公司以自有资金垫付,并已于2015年8月26日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2)本基金最后运作日结算备付金人民币4,171,582.33元,于2015年8月4日结算备付金调整为102,251.33元,该款项由基金管理人国泰基金管理有限公司以自有资金垫付,并已于2015年8月26日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(3)本基金最后运作日存出保证金人民币40,158.64元,于2015年8月4日存出保证金调整为39,871.12元,该款项由基金管理人国泰基金管理有限公司以自有资金垫付,并已于2015年8月26日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(4)本基金最后运作日应收证券清算款人民币565,499.10元,已于2015年8月26日前变现结束,资金已划入托管账户。

(5)本基金最后运作日持有交易性金融资产人民币12,629,304.83元,此交易性金融资产已于2015年8月26日前变现结束,资金已划入托管账户。

6.3负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付赎回款人民币1,947,487.19元,该款项已于2015年8月3日支付完毕。
(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,828.65元,该款项已于2015年8月5日支付。
(3)本基金最后运作日应付托管费人民币365.75元,该款项已于2015年8月5日支付。
(4)本基金最后运作日应付交易费用人民币95,912.20元,该款项已于2015年8月21日支付。
(5)本基金最后运作日其他负债人民币128,380.55元,该款项已于2015年8月26日前支付完毕。

6.4 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	本期 2015年7月30日(基金开始清算日)至2015年8月26日(基金结束清算日)止期间
一、资产处置损益	-621,938.24
1.利息收入	7,338.99
其中:存款利息收入	7,338.99
2.投资收益(损失以“-”填列)	598,906.36
其中:股票投资收益	-44,281.75
基金投资收益	643,188.11
债券投资收益	
资产支持证券投资收益	
贵金属投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,228,214.40
4.其他收入(损失以“-”号填列)	30.81
二、清算费用	41,037.50
1. 交易费用	24,494.63
2. 其他费用	16,542.87
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	-662,975.74

6.5资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

资产处置及负债清偿后,于2015年8月26日本基金剩余财产为人民币18,871,905.28元,根据本基金的基金合同约定,依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2015年7月30日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有,以上利息均按实际适用的利率计算。由基金管理人以自有资金垫付并已于2015 年 8月 26 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账起孳生的利息归管理人所有。

截至2015年8月26日止,经基金管理人以及基金托管人确认,本基金托管账户银行存款余额共人民币18,896,934.85元,其中人民币200,000.00元系基金管理人代垫的应收银行存款、结算备付金、存出保证金、结算备付金及存出保证金利息。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核,在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《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2015年1月1日至2015年7月29日(基金最后运作日)止期间的特殊目的财务报表及审计报告》
2、《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2015年7月30日 (基金清算开始日)至2015年8月26日(基金清算结束日)止期间特殊目的财务报表及审计报告》
3、通力律师事务所关于《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清算报告》的法律意见

7.2 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16-19层。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

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财产清算小组

二〇一五年九月二日

国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金开放定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2015年11月6日

1.公告基本信息

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
基金主代码	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
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《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招募说明书》
定期定额投资起始日	2015年11月9日

2. 定期定额投资业务的办理时间

投资人在开放日办理基金份额的定期定额投资业务,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停相关业务时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的定期定额投资业务。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出定期定额投资业务且注册登记机构确认接受的,其基金份额定期定额投资价格为下一开放日基金份额定期定额投资的价格。

3. 定期定额投资业务

“定期定额投资计划”是指投资者通过本公司指定的销售机构申请,约定每期扣款时间、扣款金额、扣款方式,由指定销售机构于每期约定扣款日,在投资者指定银行账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。定期定额申购费率与普通申购费率相同。销售机构将按照与投资者申请时所约定的每期固定扣款日、扣款金额扣款,若遇非基金交易日时,扣款是否顺延以销售机构的具体规定为准。

具体办理程序请遵循各销售机构的有关规定,具体扣款方式也以各销售机构的相关业务规则为准。

各销售机构每期扣款最低金额:

本公司的基金电子交易平台定投的每期扣款最低金额为100元。

中国银行股份有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、嘉实财富管理有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司、一路财富(北京)信息科技有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司适用于最低扣款额100元。

天相投资顾问有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、江海证券有限公司、华宝证券有限责任公司适用于最低扣款额300元。

国信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中泰证券股份有限公司适用于最低扣款额500元。

4. 其他需要提示的事项

(1)国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金为契约型开放式证券投资基金,基金管理人为国泰基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

(2)国泰国证新能源汽车指数分级证券投资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的基础份额(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的稳健收益类份额(简称“新汽车A份额”)和国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的积极收益类份额(简称“新汽车B份额”)。

(3)本公告仅对本基金国泰新汽车份额的开放定期定额投资业务事项予以说明。投资人欲了解本基金详细情况,请认真阅读2015年8月25日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金招募说明书》,亦可登录本公司网站(www.gtfund.com)进行查询。

(4)投资人如有任何问题,可拨打本公司客户服务电话(400-888-8688)、基金托管人中国银行客服电话(95566)以及各销售机构客户服务电话。

(5)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。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
二〇一五年十一月六日

证券代码:002399 证券简称:海普瑞 公告编号:2015-100

深圳市海普瑞药业股份有限公司关于控股股东增持公司股份计划完成的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市海普瑞药业股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年11月5日接到公司控股股东深圳市乐仁科技有限公司(以下简称“深圳乐仁”)通知,深圳乐仁增持本公司股份计划已完成,现将有关情况公告如下:

一、增持人
公司控股股东深圳市乐仁科技有限公司
二、首次披露增持计划的时间
2015年7月10日,公司在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网www.cninfo.com.cn披露了《关于控股股东增持公司股份计划的公告》。
三、增持计划的具体内容
深圳乐仁基于对中国经济和中国资本市场形势的认识,对公司未来持续稳定发展充满信心及公司股票价值的合理判断,计划于公司股票复牌后3个月内,通过深圳证券交易所交易系统允许的方式以自有资金2000万元人民币增持公司股份,并承诺在增持实施期间、法定期限内及增持计划完成后六个月内不减持所持有的公司股份。
四、增持计划的实施情况
2015年10月8日至2015年11月5日,深圳乐仁通过深圳证券交易所交易系统以集中竞价方式累计增持公司股份706,587股,增持金额为19,996,490.55元(不含交易费用),增持比例为0.0883%。截至2015年11月5日深圳证券交易所收市时,本次增持计划已经实施完毕。
本次增持计划实施前,深圳乐仁持有公司的股份数量是295,562,100股,占公司总股本的36.9360%。
本次增持计划实施后,深圳乐仁持有公司的股份数量为296,268,687股,占公司总股本的37.0243%
五、增持承诺的履行情况
公司控股股东深圳乐仁严格履行增持承诺,在增持期间及法定期限内未减持其所持有的公司股份。深圳乐仁承诺在本次增持完成后的六个月内不减持所持公司股份
六、增持行为的合规性
本次增持符合《公司法》、《证券法》、《上市公司收购管理办法》及《关于上市公司大股东及董事、监事、高级管理人员增持本公司股票相关事项的通知》(证监发[2015]51号)等法律法规的规定,满足《上市公司收购管理办法》规定的免于提出豁免发出要约申请的条件。
本次增持公司股份完成后,不会导致公司股权分布不具备上市条件,不会导致公司控股股东、实际控制人发生变化。
七、律师专项核查意见
北京市中伦(深圳)律师事务所就深圳乐仁增持公司股份的相关事宜,实施了专项核查并出具了专项核查意见。认为:
1. 增持人是依法设立且有效存续的企业法人,具有法律、法规和规范性文件规定的担任上市公司股东的资格,不存在《上市公司收购管理办法》第六条规定的不得收购上市公司股份的情况,具备实施本次增持的主体资格;
2. 截至本法律意见书出具日,增持人通过深圳证券交所系统竞价交易方式增持公司股份,增持人本次增持符合《证券法》、《上市公司收购管理办法》等法律、法规和规范性文件的规定;
3. 增持人自2010年5月6日起持有公司股份超过公司已发行股份的30%,且在此之后持股比例未发生过变化,本次增持股份未超过公司已发行股份的2%,本次增持满足《上市公司收购管理办法》规定的免于向中国证监会提交豁免申请的条件。
特此公告。

深圳市海普瑞药业股份有限公司董事会
二〇一五年十一月六日

证券代码:600643 证券简称:爱建集团 公告编号:临2015-062

上海爱建集团股份有限公司重大资产重组进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

根据上级工作安排,因对上海爱建集团股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)筹划重大事项,经公司申请,本公司股票已于2015年6月30日起停牌。自2015年8月25日起进入重大资产重组停牌程序,预计停牌不超过一个月。2015年