

信息披露 Disclosure

国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日 基金管理人:国泰基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

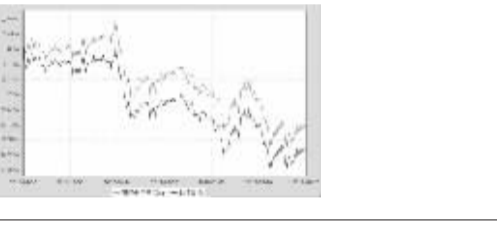
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产本金不受损失...

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Lists various funds like 国泰中证军工ETF, 国泰中证全指证券公司ETF, etc.

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 主要财务指标 2018年7月1日至2018年9月30日

Table with 7 columns: 项目 (Item), 本报告期末 (End of Report), 本报告期初 (Start of Report), 比上年末增减(%) (Change vs. Last Year), 本报告期末 (End of Report), 本报告期初 (Start of Report), 比上年末增减(%) (Change vs. Last Year).

3.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金合同生效日为2016年7月26日,在六个月内建仓期间,各资产资产配置比例符合合同约定。

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离职日期 (End Date), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Remarks).

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公告决定生效之日,前任基金经理,任职日期为基金合同生效日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 (四)基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》等法律法规的规定...

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同、招募说明书等相关规定...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现 本基金在报告期内秉承“稳健、均衡、长期”的投资理念...

截止期末MSCI,沪深300指数涨幅为-1.6%,跑赢了沪深300指数的涨幅为-1.6%,沪深300指数涨幅为-1.6%...

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

注:上述股票投资包括可转换公司债券公允价值。 5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合 代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

5.3 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股票投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

本基金管理人充分考量股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎开展投资,以规避持仓中的特定风险。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

5.1.1 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会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。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日 基金管理人:国泰基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

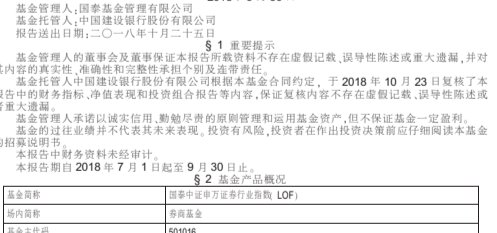
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金资产本金不受损失...

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Lists various funds like 国泰中证全指证券公司ETF, 国泰中证军工ETF, etc.

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 主要财务指标 2018年7月1日至2018年9月30日

Table with 7 columns: 项目 (Item), 本报告期末 (End of Report), 本报告期初 (Start of Report), 比上年末增减(%) (Change vs. Last Year), 本报告期末 (End of Report), 本报告期初 (Start of Report), 比上年末增减(%) (Change vs. Last Year).

3.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金合同生效日为2016年7月26日,本基金在六个月内建仓期间,各资产资产配置比例符合合同约定。

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离职日期 (End Date), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Remarks).

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 (四)基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》等法律法规的规定...

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同、招募说明书等相关规定...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现 本基金在报告期内秉承“稳健、均衡、长期”的投资理念...

截止期末MSCI,沪深300指数涨幅为-1.6%,跑赢了沪深300指数的涨幅为-1.6%,沪深300指数涨幅为-1.6%...

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

注:上述股票投资包括可转换公司债券公允价值。 5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合 代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

5.3 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股票投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

本基金管理人充分考量股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎开展投资,以规避持仓中的特定风险。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

5.1.1 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会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。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

2018年9月30日 基金管理人:国泰基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

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,也不保证基金资产本金不受损失...

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Lists various funds like 国泰中证全指证券公司ETF, 国泰中证军工ETF, etc.

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 主要财务指标 2018年7月1日至2018年9月30日

Table with 7 columns: 项目 (Item), 本报告期末 (End of Report), 本报告期初 (Start of Report), 比上年末增减(%) (Change vs. Last Year), 本报告期末 (End of Report), 本报告期初 (Start of Report), 比上年末增减(%) (Change vs. Last Year).

3.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金合同生效日为2017年4月27日,本基金在六个月内建仓期间,各资产资产配置比例符合合同约定。

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离职日期 (End Date), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Remarks).

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 (四)基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》等法律法规的规定...

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规及基金合同、招募说明书等相关规定...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现 本基金在报告期内秉承“稳健、均衡、长期”的投资理念...

截止期末MSCI,沪深300指数涨幅为-1.6%,跑赢了沪深300指数的涨幅为-1.6%,沪深300指数涨幅为-1.6%...

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

注:上述股票投资包括可转换公司债券公允价值。 5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合 代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 代码 (Code), 行业名称 (Industry Name), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

5.3 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股票投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).

本基金管理人充分考量股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎开展投资,以规避持仓中的特定风险。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount).

5.1.1 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会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。

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets).