

## 信息披露

## disclosure

## 2018年第三季度报告

## 2018年第三季度报告

以当前的新。分板块来看,三季度金融和周期板块表现抢眼,股市累计上涨39.96% 地位位首,非金融类“深股通”行业业绩紧随其后,累计涨幅分别为45.8%、23.9%、2.14%。家电、纺织和医药行业三季度表现不佳,均下滑10%以上的跌幅。政策方面,国内金融领域的“去杠杆”从去年下半年已经开始,今年上半年已全面完成。三季度开始,国内信用政策和财政政策都已出现转变,中美贸易摩擦带来的负面影响也基本被市场预期消化,证券市场迎来明显的企稳回升。在沪深基金资产持续北上和监管层外溢等综合因素影响下,三季度A股市场行情好于预期,板块的轮动较为收敛,此前估值调整较大的金融、周期和军工等板块率先开始反弹,作为完全跟踪标的的被动型基金,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。

4.2 报告期内基金的投资表现

本基金在2018年第三季度的净值增长率为-5.65%,同期业绩比较基准收益率为-6.59%。

4.3 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
当前,随着国内信用政策和财政政策的转向和市场流动性的缓解,一些短期因素正在边际改善,市场也逐步重拾信心。中长期来看,随着供给侧改革初见成效,一线、二线城市的房价将有所控制,三四线城市会继续去库存,房地产行业环境整体平稳,板块底部支撑明显具有较稳定的安全边际,超预期的业绩有望实现。国内房地产行业指数包含了沪深两市一、二线90家主要上市公司,能够较好把握房地产行业的整体表现。投资者可利用国泰中证房地产行业指数分级基金,将房地产行业阶段性的投资机会。投资者可关注国泰中证房地产行业指数分级基金(160218)的投资价值。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
4.6 报告期内基金持有资产或基金资产净值变动说明  
无。

## § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	691,739,476.63	93.10
2	固定收益投资	4,611,660.00	0.00
3	金融衍生品	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	货币资金	22,799,522.37	3.06
6	其他资产	-	-
合计		739,150,659.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	131,218.24	0.02
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
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	131,218.24	0.02

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,794,470.36	0.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
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	591,697,236.84	93.52

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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	3,750,115	91,127,794.00	14.41
2	600048	保利地产	6,548,075	79,090,072.76	12.63
3	001979	招商积余	1,937,741	36,216,379.29	5.70
4	600940	华夏幸福	1,315,396	33,318,980.68	5.27
5	000640	中天金融	4,393,014	26,270,232.72	4.15
6	600006	绿地控股	3,210,632	20,548,044.00	3.25
7	600803	金地集团	2,186,839	19,943,965.51	3.15
8	601156	新凯股份	759,346	19,397,272.74	3.14
9	002146	荣盛发展	1,389,168	15,375,544.68	2.34
10	600325	赛迪股份	1,854,131	13,963,082.24	2.08

5.3.1 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

5.3.2 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债券投资明细

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,611.66	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	4,611.66	0.00
合计		4,611.66	0.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123306	东财转债	40	4,611.66	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.6 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贵金属投资明细

5.6 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权证投资明细

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.4 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.9.5 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.6 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.9.7 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权证投资明细

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.11 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权证投资明细

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的贵金属投资明细

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资明细

5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资明细

5.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权证投资

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:二〇一八年十月二十五日

3.1 重要提示

3.2 基金概况

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.4 管理人报告

3.5 投资组合报告

3.6 风险揭示

3.7 基金费用

3.8 收益分配

3.9 基金资产净值及基金份额净值

3.10 基金管理人承诺

3.11 基金托管人承诺

3.12 销售机构

3.13 基金管理人联系方式

3.14 基金管理人网站

3.15 基金管理人客服热线

3.16 基金管理人网站

3.17 基金管理人网站

3.18 基金管理人网站

3.19 基金管理人网站

3.20 基金管理人网站

3.21 基金管理人网站

3.22 基金管理人网站

3.23 基金管理人网站

3.24 基金管理人网站

3.25 基金管理人网站

3.26 基金管理人网站

3.27 基金管理人网站

3.28 基金管理人网站

3.29 基金管理人网站

3.30 基金管理人网站

3.31 基金管理人网站

3.32 基金管理人网站

3.33 基金管理人网站

3.34 基金管理人网站

3.35 基金管理人网站

3.36 基金管理人网站

3.37 基金管理人网站

3.38 基金管理人网站

3.39 基金管理人网站

3.40 基金管理人网站

3.41 基金管理人网站

3.42 基金管理人网站

3.43 基金管理人网站

3.44 基金管理人网站

3.45 基金管理人网站

3.46 基金管理人网站

3.47 基金管理人网站

3.48 基金管理人网站

3.49 基金管理人网站

3.50 基金管理人网站

3.51 基金管理人网站

3.52 基金管理人网站

3.53 基金管理人网站

3.54 基金管理人网站

3.55 基金管理人网站

3.56 基金管理人网站

3.57 基金管理人网站

3.58 基金管理人网站

3.59 基金管理人网站

3.60 基金管理人网站

3.61 基金管理人网站

3.62 基金管理人网站

3.63 基金管理人网站

3.64 基金管理人网站

3.65 基金管理人网站

3.66 基金管理人网站

3.67 基金管理人网站

3.68 基金管理人网站

3.69 基金管理人网站

3.70 基金管理人网站

3.71 基金管理人网站

3.72 基金管理人网站

3.73 基金管理人网站

3.74 基金管理人网站

3.75 基金管理人网站

3.76 基金管理人网站

3.77 基金管理人网站

3.78 基金管理人网站

3.79 基金管理人网站

3.80 基金管理人网站

3.81 基金管理人网站

3.82 基金管理人网站

3.83 基金管理人网站

3.84 基金管理人网站

3.85 基金管理人网站

3.86 基金管理人网站

3.87 基金管理人网站

3.88 基金管理人网站

3.89 基金管理人网站

3.90 基金管理人网站

3.91 基金管理人网站

3.92 基金管理人网站