

国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)

2017年第四季度报告



注：(1)本基金的合同生效日为2017年1月29日，截至2017年12月31日，本基金运作时间未满一年；
(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金基金经理的日期 离任日期 说明

姓名	职务	任本基金基金经理的日期	离任日期	说明
王军伟	基金经理	2017年1月29日		
王军伟	基金经理	2017年1月29日		
王军伟	基金经理	2017年1月29日		
王军伟	基金经理	2017年1月29日		

4.2 报告期内基金运作指标

报告期 期间净值增长率 期间净值增长率标准差 期间净值增长率相对基准收益率的差额 期间净值增长率相对基准收益率的标准差

过去三个月 -1.35% 0.07% -0.15% 0.06% -0.12%

4.3 公公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《公平交易制度》执行，未发生不公平交易和利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金在2017年第四季度的净值增长率为-8.31%，同期业绩比较基准收益率为-8.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2018年股市将保持谨慎乐观，结构性机会或延续，在热点边际冷却后将逐步扩散到其他领域，全年牛市格局或将延续，年内两个阶段化的机会。

随着军品体制革新的逐步落地，伴随着民资入场战略进一步推进，军费开支有望向回常态化，在政策扶持下军品产业链将进入新一轮发展周期。同时，随着军品采购机制的不断完善，军品采购将更加公开透明，通过公开招标和竞争性谈判，军品采购将更趋理性，从而提升军品采购效率。

4.6 报告期内基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 权益投资 169,961,216.00 100.00

2 固定收益 0.00 0.00

3 货币市场工具 0.00 0.00

4 其他资产 0.00 0.00

5 合计 169,961,216.00 100.00

4.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 采掘、农林、渔业 0.00 0.00

2 制造业 0.00 0.00

3 信息传输、软件和信息技术服务业 0.00 0.00

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 0.00 0.00

5 建筑业 0.00 0.00

6 制造业 0.00 0.00

7 交通运输、仓储和邮政业 0.00 0.00

8 银行业 0.00 0.00

9 房地产业 0.00 0.00

10 化工、石油及制品、塑料、橡胶和有色金属业 0.00 0.00

11 计算机、通信和其他电子设备制造业 0.00 0.00

12 电子元件 0.00 0.00

13 仪器仪表制造业 0.00 0.00

14 通用设备制造业 0.00 0.00

15 专用设备制造业 0.00 0.00

16 交通运输设备制造业 0.00 0.00

17 电气机械、器材及控制设备、仪器及仪表制造业 0.00 0.00

18 通信及广播电视设备制造业 0.00 0.00

19 汽车制造业 0.00 0.00

20 家用电器制造业 0.00 0.00

21 电子元件制造业 0.00 0.00

22 电子通信设备制造业 0.00 0.00

23 电子器件制造业 0.00 0.00

24 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

25 电子计算机及辅助设备制造业 0.00 0.00

26 电子及通信设备制造业 0.00 0.00

27 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

28 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

29 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

30 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

31 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

32 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

33 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

34 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

35 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

36 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

37 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

38 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

39 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

40 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

41 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

42 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

43 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

44 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

45 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

46 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

47 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

48 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

49 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

50 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

51 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

52 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

53 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

54 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

55 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

56 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

57 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

58 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

59 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

60 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

61 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

62 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

63 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

64 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

65 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

66 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

67 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

68 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

69 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

70 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

71 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

72 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

73 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

74 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

75 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

76 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

77 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

78 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

79 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

80 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

81 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

82 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

83 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

84 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

85 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

86 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

87 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

88 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

89 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

90 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

91 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

92 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

93 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

94 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

95 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

96 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

97 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

98 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

99 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

100 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

101 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

102 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

103 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

104 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

105 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

106 电子元件及材料制造业 0.00 0.00

107 电子元件及材料制造业 0