国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 2017年年度报告摘要

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
报告送出日期:二〇一八年三月二十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	国泰证券ETF
基金主代码	512880
交易代码	512880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016年7月26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
报告期末基金份额总额	730,291,482.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年8月8日

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的最小化。
投资策略	1.股票投资策略 本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数成分股权或及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成分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,成份股权重由于日由离通盘发生变化,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。 2.债券投资策略 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、央行票据和金融债等固定收益类品种,其目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 3.资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素,按照价值投资理念,根据市场交易机会,在严格遵守法律法规的基础上,通过运用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。 4.权证投资策略 本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型求来其合理估值水平,并根据期间上股权权证之间的不同组合来获取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的风险特性,流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率
风险收益特征	本基金属于权益类证券基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高收益的基金。 本基金为指数型基金,主要采用完全复制策略,跟踪中证全指证券公司指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永辉	田青
	联系电话	021-31081600转	010-67596096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000,400-888-8888	010-67596096
传真		021-31081800	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017年	2016年7月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
本期已实现收益	-5,566,463.69	22,603,022.13
本期利润	-49,975,233.82	12,128,082.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1664	0.0561
本期基金份额净值增长率	-7.43%	3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0466	0.0300
期末基金资产净值	696,347,612.39	146,564,124.47
期末基金份额净值	0.9536	1.0300

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
过去三个月	-14.16%	1.06%	-14.63%	1.06%	0.47%	0.00%
过去六个月	-5.80%	1.27%	-8.06%	1.28%	2.26%	-0.01%
过去一年	-7.43%	1.06%	-12.35%	1.07%	4.92%	-0.01%
基金成立日至今	-4.65%	1.03%	-15.64%	1.12%	10.99%	-0.03%

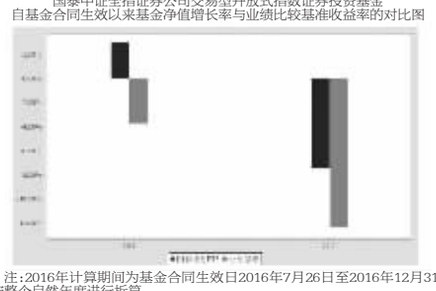
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年7月26日至2017年12月31日)

注:本基金的合同生效日为2016年7月26日。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:2016年计算期间为基金合同生效日2016年7月26日至2016年12月31日,未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效以来未进行利润分配。

§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2017年12月31日,本基金管理人共管理105只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长灵活配置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、国泰价值经典灵活配置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、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金(由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来,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、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)(由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来,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)、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金(LOF)、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)、国泰中证国有企改革指数证券投资基金(LOF)、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿信平衡混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金(QDII)、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰安心回报混合型证券投资基金、国泰民润纯债债券型证券投资基金、国泰润享纯债债券型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金。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,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		
艾小军	本基金的基金经理,国泰黄金ETF、国泰上证180金融ETF、国泰上证180金融ETF联接、国泰沪深300指数、国泰黄金ETF联接、国泰国证TMT50指数分级、国泰中证军工ETF、国泰策略价值灵活配置混合、国泰策略收益灵活配置混合、国泰国证航天军工指数(LOF)、国泰中证申万证券行业指数(LOF)、国泰融信灵活配置混合、国泰生益灵活配置混合、国泰成长优选混合、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰安益灵活配置混合、国泰普益灵活配置混合、国泰鑫益灵活配置混合、国泰信益灵活配置混合、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合、国泰普益灵活配置混合、国泰鑫益灵活配置混合、国泰利是宝货币市场基金、国泰民惠收益定期开放债券、国泰嘉益灵活配置混合、国泰众益灵活配置混合、国泰润泰纯债债券、国泰融信灵活配置混合、国泰景气行业灵活配置混合、国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)、国泰策略价值灵活配置混合、国泰保本混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰量化收益灵活配置混合、国泰睿信平衡混合、国泰大农业股票、国泰智能装备股票、国泰融安多策略灵活配置混合、国泰润鑫纯债债券、国泰稳益定期开放灵活配置混合、国泰宁益定期开放灵活配置混合、国泰智能汽车股票、国泰瞬利交易型货币市场基金、上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安增益定期开放灵活配置混合、国泰中国企业信用精选债券、国泰民安增益定期开放灵活配置混合、国泰中国企业信用精选债券、国泰安心回报混合、国泰润享纯债债券、国泰可转债