

# 国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

## 2018 年半年度报告

### 2018 年 6 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

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 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贵金属投资明细.....	43
7.9 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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44

<b>8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	46
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	48
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	49
11.1	备查文件目录.....	49
11.2	存放地点.....	49
11.3	查阅方式.....	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰创业板指数证券投资基金（LOF）
基金简称	国泰创业板指数（LOF）
场内简称	创业板基
基金主代码	160223
交易代码	160223
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 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	134,357,646.36 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，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、成份股权重由于自由流通量发生变化、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。</p> <p>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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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。</p> <p>2、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，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。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>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，坚持价值投资理念，把握市场交易机会。在严格遵</p>

	<p>守法律法规的基础上，通过信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。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、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。</p>
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。

### 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	李永梅	田青
	联系电话	021-31081600转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	010-67595096
传真		021-31081800	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街25 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	北京市西城区闹市口大街1 号 院1 号楼
邮政编码		200082	100033
法定代表人		陈勇胜	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-1,580,437.13
本期利润	-6,607,087.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0667
本期加权平均净值利润率	-8.13%
本期基金份额净值增长率	-6.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-32,288,268.34
期末可供分配基金份额利润	-0.2403
期末基金资产净值	102,069,378.02
期末基金份额净值	0.7597
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-24.03%

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

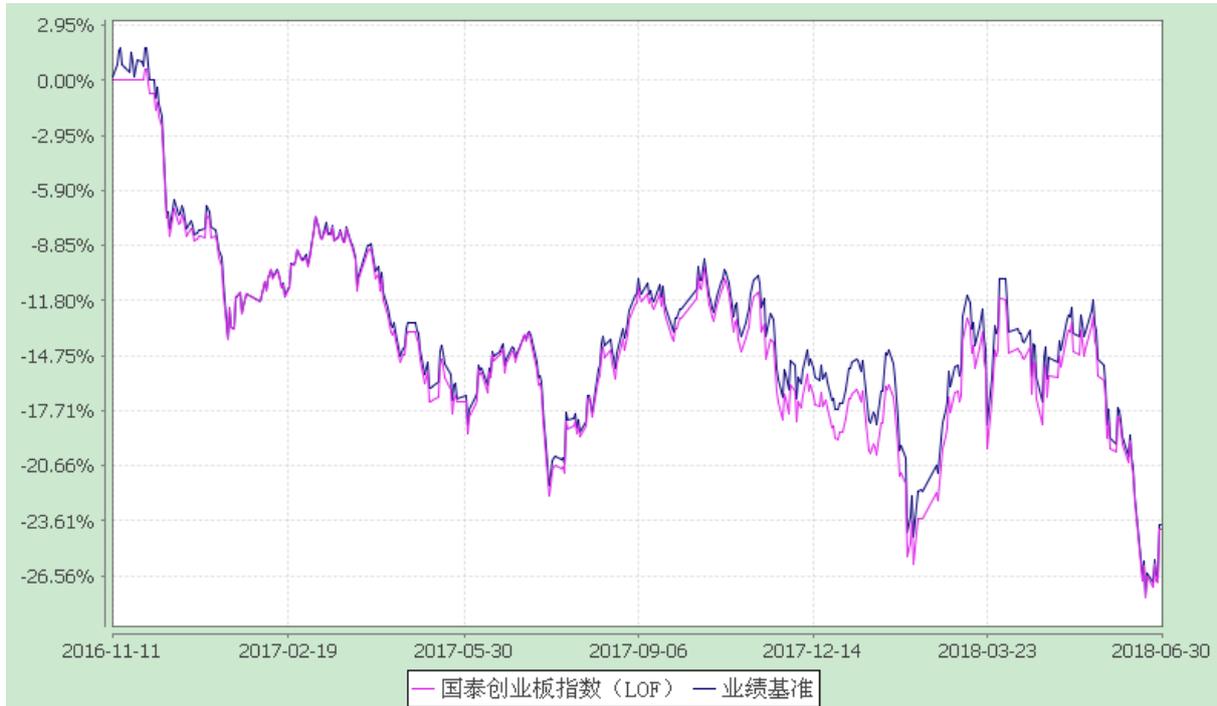
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-7.06%	1.96%	-7.46%	1.97%	0.40%	-0.01%
过去三个月	-13.93%	1.58%	-14.71%	1.55%	0.78%	0.03%
过去六个月	-6.37%	1.69%	-7.84%	1.67%	1.47%	0.02%
过去一年	-11.13%	1.40%	-10.95%	1.39%	-0.18%	0.01%
自基金合同生效起至今	-24.03%	1.24%	-23.80%	1.24%	-0.23%	0.00%

##### 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

国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2016 年 11 月 11 日至 2018 年 6 月 30 日）



注：本基金自 2016 年 11 月 11 日合同生效日起，在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 99 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、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、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、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（原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、国泰丰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、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金。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		
徐成城	本基金的基金经理、国泰国证医药卫生行业指数分级、国泰国证食品饮料行业指数分级、国泰黄金 ETF、国泰黄金 ETF 联	2017-02-03	-	12 年	硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月起任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰黄

	接、国泰中证国有企业改革指数（LOF）、国泰国证房地产行业指数分级、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数分级的基金经理				金交易型开放式证券投资基金和国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2018 年 4 月起兼任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金(LOF)的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）和国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理。
徐皓	本基金的基金经理、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证房地产行业指数分级、国泰纳斯达克 100 指数（QDII）、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰国证有色金属行业指数分级的基金经理、投资总监（量化）	2016-11-11	2018-07-06	11 年	硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师（国家一级）。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010 年 5 月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011 年 6 月至 2014 年 1 月担任上证 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及国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理助理，2012 年 3 月至 2014 年 1 月兼任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、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的基金经理助理。2014 年 1 月至 2015 年 8 月任国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 8 月任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2014 年 6 月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2014 年 11 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金和纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 6 月任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)的基金经

					理，2016 年 7 月起兼任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）的基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 7 月兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 3 月起至 2018 年 4 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

## （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下。

## （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年 A 股市场各板块与行业均不同程度的呈现调整的态势：上证 50 和沪深 300 指数二季度以来分别下跌 13.26% 和 12.64%，中证 500 和创业板分别下跌近 15.90% 和 7.93%，表现较去年同期更弱。造成国内 A 股市场今年以来普遍下跌的主要原因较多：一至二月，由于金融去杠杆的持续、部分资金获利离场、美股下跌以及乐视网复牌连续跌停等诸多因素叠加影响，大盘持续走低，前期调整比较充分的创业板也未能在本次大盘调整中幸免。然而随着短期下跌调整过度，创业板整体估值性价比获得了进一步提升，IPO 数量持续降低也使得上市公司壳价值被凸显。2 月中旬，创业板指数在上述利好的作用下展开强势反攻，20 个交易日内的涨幅近 15%，远超同期沪深 300 指数。四月初美国公布拟对中国 500 亿美元的商品加征关税后，中美双方不断加码反制措施，又再度造成了 A 股市场的动荡。而美国对中兴通讯的制裁事件，更是严重动摇了市场对中国高端制造业产业升级的信心，市场弥漫着贸易摩擦下看淡中国未来经济发展的悲观情绪，以通讯技术为代表的科技制造板块在二季度出现了明显下挫。另一方面，4 月 27 日，央行联合银保监会、证监会、外汇局发布了《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（即“资管新规”），标志着资管行业即将步入统一监管时代，对于国内金融行业的健康有序的发展有着重要意义。但在短期内，资管新规使得合格投资者门槛提高，以多层嵌套方式流入股市的部分理财资金在去通道化背景下，势必将面临清出的压力，这也造成了 A 股短期资金的外流和增量资金的减少，使得 A 股短期面临着较大的压力。作为完全跟踪标的指数的被动型基金，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2018 年上半年的净值增长率为-6.37%，同期业绩比较基准收益率为-7.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，尽管国内 A 股面临的较大的内部流动性和外部经济环境的压力，但从央行定向降准、中美就贸易问题多次磋商以及美国商务部解除对中兴通讯的制裁等事件来看，一些短期因素正在边际改善，市场也逐渐止跌企稳。就创业板来看，经过两年多的调整创业板指数目前的平均估值只有 40 倍左右，接近历史低位，意味着投资创业板已经具备较好的安全边际，投资风险相对较小。从中长期来看，尽管以美国商务部为代表的政治势力试图扼杀中国制造 2025 的计划，但预料我国开展制造强国的战略将不会因此而延缓。十九大报告提出了创新驱动发展的战略，其中提到创新驱动发展战略是一个系统工程，科技成果应同国家需求、人民要求、市场需求相结合，完成从科学研究、实验开发、推广应用的三级跳，才能真正实现创新价值。习近平总书记在 1 月底主持的中央政治局会议时，进一步提出要建设创新引领、协同发展的产业体系。要加快实施创新驱动发展战略，强化现代化经济体系的战略支撑，加强国家创新体系建设，强化战略科技力量，推动科技创新和经济社会发展深度融合，塑造更多依靠创新驱动、更多发挥先发优势的引领型发展。发改委也表示将加快推动新兴产业发展，组织实施一批新兴产业重大工程，加强政府资金与金融资本合作，促进战略性新兴产业集群发展；加快推进互联网、大数据、人工智能与实体经济深度融合，大力发展“新技术、新产业、新业态、新模式”的四新经济形态。中国战略性新兴产业的发展壮大离不开创业板的企业，政策和市场的倾斜将使得创业板未来具有更大的发展潜力，以创业板指数为代表的创业板优质公司将在国家政策和市场资金的培育和支持下，引领创新科技产业方向。投资者或可利用国泰创业板指数（LOF）基金，把握创业板指数阶段性的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	6,197,050.36	3,938,604.75

结算备付金		28,659.49	22,315.19
存出保证金		14,725.69	22,621.93
交易性金融资产	6.4.7.2	96,453,217.08	47,974,632.81
其中：股票投资		96,448,406.28	47,948,732.81
基金投资		-	-
债券投资		4,810.80	25,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,959.22	813.78
应收股利		-	-
应收申购款		384,143.30	1,122,905.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>103,079,755.14</b>	<b>53,081,894.10</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		439,373.04	20.09
应付赎回款		287,031.99	1,459,331.88
应付管理人报酬		39,804.87	21,667.61
应付托管费		11,941.47	6,500.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,382.23	21,709.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	199,843.52	115,497.33
<b>负债合计</b>		<b>1,010,377.12</b>	<b>1,624,726.49</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	134,357,646.36	63,416,508.02
未分配利润	6.4.7.10	-32,288,268.34	-11,959,340.41
<b>所有者权益合计</b>		<b>102,069,378.02</b>	<b>51,457,167.61</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>103,079,755.14</b>	<b>53,081,894.10</b>

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7597 元，基金份额总额 134,357,646.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-6,007,167.45</b>	<b>-616,649.09</b>
1.利息收入		24,525.60	14,588.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,511.92	14,588.97
债券利息收入		13.68	-
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）		-1,109,159.07	-1,794,156.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,497,887.86	-2,029,381.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	364.37	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	388,364.42	235,225.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,026,650.08	1,121,859.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	104,116.10	41,058.35
<b>减：二、费用</b>		<b>599,919.76</b>	<b>479,854.70</b>
1. 管理人报酬		201,139.89	106,054.43
2. 托管费		60,342.03	31,816.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	87,726.87	89,108.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	250,710.97	252,875.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,607,087.21</b>	<b>-1,096,503.79</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,607,087.21</b>	<b>-1,096,503.79</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	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）	63,416,508.02	-11,959,340.41	51,457,167.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,607,087.21	-6,607,087.21
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）	70,941,138.34	-13,721,840.72	57,219,297.62
其中：1.基金申购款	160,331,316.94	-28,943,715.64	131,387,601.30
2.基金赎回款	-89,390,178.60	15,221,874.92	-74,168,303.68
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）	134,357,646.36	-32,288,268.34	102,069,378.02
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	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）	42,872,938.63	-3,595,139.54	39,277,799.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,096,503.79	-1,096,503.79
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）	42,065,262.43	-7,639,939.23	34,425,323.20
其中：1.基金申购款	78,506,135.09	-11,237,306.51	67,268,828.58
2.基金赎回款	-36,440,872.66	3,597,367.28	-32,843,505.38
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）	84,938,201.06	-12,331,582.56	72,606,618.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰创业板指数证券投资基金(LOF)(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[2016]612号《关于准予国泰创业板指数证券投资基金(LOF)注册的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰创业板指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 225,693,668.06 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1300 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰创业板指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 225,752,502.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,834.25 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2016]第 819 号文审核同意，本基金 180,582,575.00 份基金份额于 2016 年 11 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰创业板指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款等固定收益类品种、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 85%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2018 年 8 月 20 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰创业板指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、沪府发[2011]2 号《上海市人民政府关于本市开征

地方教育附加的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	6,197,050.36
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,197,050.36

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	104,745,424.59	96,448,406.28	-8,297,018.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,810.80	810.80
	银行间市场	-	-
	合计	4,810.80	810.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	104,749,424.59	96,453,217.08	-8,296,207.51

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,931.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	12.90
应收债券利息	3.38
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.70
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.60
合计	1,959.22

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	32,382.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,382.23

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,079.62
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	148,763.90
合计	199,843.52

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,416,508.02	63,416,508.02
本期申购	160,331,316.94	160,331,316.94
本期赎回（以“-”号填列）	-89,390,178.60	-89,390,178.60
本期末	134,357,646.36	134,357,646.36

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,445,666.61	-4,513,673.80	-11,959,340.41
本期利润	-1,580,437.13	-5,026,650.08	-6,607,087.21
本期基金份额交易产生的变动数	-9,423,788.39	-4,298,052.33	-13,721,840.72
其中：基金申购款	-21,614,996.39	-7,328,719.25	-28,943,715.64
基金赎回款	12,191,208.00	3,030,666.92	15,221,874.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,449,892.13	-13,838,376.21	-32,288,268.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	23,190.30
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	855.34
其他	466.28
合计	24,511.92

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	12,425,265.93
减：卖出股票成本总额	13,923,153.79
买卖股票差价收入	-1,497,887.86

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,276.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,900.00
减：应收利息总额	12.53
买卖债券差价收入	364.37

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	388,364.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	388,364.42

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-5,026,650.08
——股票投资	-5,027,460.88
——债券投资	810.80
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-5,026,650.08

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	104,116.05
转换费收入	0.05
合计	104,116.10

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	87,726.87
银行间市场交易费用	-
合计	87,726.87

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	89,258.34
上市费	29,752.78
银行汇划费用	1,947.07
指数使用费	100,000.00
合计	250,710.97

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	201,139.89	106,054.43
其中：支付销售机构的客户维护费	61,995.75	15,378.25

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,342.03	31,816.36

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,197,050.36	23,190.30	4,314,474.26	13,371.92

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有认购新发/增发证券等流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项	23.28	2018-07-10	18.38	81,916.00	2,697,222.90	1,907,004.48	-
300090	盛运环保	2018-06-04	重大事项	8.32	2018-07-02	7.49	35,602.00	354,610.35	296,208.64	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项	10.80	2018-08-07	9.63	38,544.00	486,722.94	416,275.20	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项	15.37	2018-07-31	16.50	41,981.00	587,757.63	645,247.97	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项	5.37	-	-	110,436.00	848,617.32	593,041.32	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项	19.99	2018-07-02	11.97	34,583.00	899,312.88	691,314.17	-
300317	珈伟股份	2018-02-05	重大事项	11.90	2018-07-03	10.69	16,071.00	251,133.77	191,244.90	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项	8.37	-	-	74,467.00	834,371.03	623,288.79	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整，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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，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。同时，本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损

失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2017 年 12 月 31 日：本基金持有信用类债券 0.05%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,197,050.36	-	-	-	6,197,050.36
结算备付金	28,659.49	-	-	-	28,659.49
存出保证金	14,725.69	-	-	-	14,725.69
交易性金融资产	-	-	4,810.80	96,448,406.28	96,453,217.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,959.22	1,959.22
应收申购款	11,158.38	-	-	372,984.92	384,143.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	6,251,593.92	-	4,810.80	96,823,350.42	103,079,755.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	439,373.04	439,373.04
应付赎回款	-	-	-	287,031.99	287,031.99
应付管理人报酬	-	-	-	39,804.87	39,804.87
应付托管费	-	-	-	11,941.47	11,941.47
应付交易费用	-	-	-	32,382.23	32,382.23
其他负债	-	-	-	199,843.52	199,843.52
负债总计	-	-	-	1,010,377.12	1,010,377.12
利率敏感度缺口	6,251,593.92	-	4,810.80	95,812,973.30	102,069,378.02
上年度末 2017年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	3,938,604.75	-	-	-	3,938,604.75
结算备付金	22,315.19	-	-	-	22,315.19
存出保证金	22,621.93	-	-	-	22,621.93
交易性金融资产	-	-	25,900.00	47,948,732.81	47,974,632.81
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	813.78	813.78
应收申购款	18,066.14	-	-	1,104,839.50	1,122,905.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	4,001,608.01	-	25,900.00	49,054,386.09	53,081,894.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	20.09	20.09
应付赎回款	-	-	-	1,459,331.88	1,459,331.88
应付管理人报酬	-	-	-	21,667.61	21,667.61
应付托管费	-	-	-	6,500.28	6,500.28
应付交易费用	-	-	-	21,709.30	21,709.30
其他负债	-	-	-	115,497.33	115,497.33
负债总计	-	-	-	1,624,726.49	1,624,726.49
利率敏感度缺口	4,001,608.01	-	25,900.00	47,429,659.60	51,457,167.61

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为:0.00%(2017 年 12 月 31 日:0.05%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	96,448,406.28	94.49	47,948,732.81	93.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	96,448,406.28	94.49	47,948,732.81	93.18

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板指数外其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	创业板指数上升 5%	增加约 490	增加约 245
	创业板指数下降 5%	减少约 490	减少约 245

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 91,089,591.61 元，属于第二层次的余额为 5,363,625.47 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 44,626,505.01 元，属于第二层次的余额为 3,056,433.98 元，属于第三层次的余额为 291,693.82 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具余额(2017 年 12 月 31 日：291,693.82 元)。本基金本期无净转入第三层次的金額(2017 年度：834,423.37 元)，无计入损益的第三层次金融工具公允价值变动(2017 年度：-942,951.46 元涉及乐视网)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	96,448,406.28	93.57
	其中：股票	96,448,406.28	93.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,810.80	0.00
	其中：债券	4,810.80	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,225,709.85	6.04
8	其他各项资产	400,828.21	0.39
9	合计	103,079,755.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,584,750.70	6.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	48,707,177.49	47.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,319,439.12	1.29

F	批发和零售业	580,482.00	0.57
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	22,802,139.16	22.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	750,513.30	0.74
M	科学研究和技术服务业	542,077.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	3,615,615.39	3.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,344,226.59	5.24
R	文化、体育和娱乐业	6,102,740.93	5.98
S	综合	-	-
	合计	96,349,161.68	94.40

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	99,244.60	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
	合计	99,244.60	0.10

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	299,035	6,584,750.70	6.45
2	300059	东方财富	376,520	4,962,533.60	4.86
3	300003	乐普医疗	103,474	3,795,426.32	3.72
4	300124	汇川技术	106,842	3,506,554.44	3.44
5	300015	爱尔眼科	94,699	3,057,830.71	3.00
6	300408	三环集团	125,356	2,945,866.00	2.89
7	300136	信维通信	94,366	2,899,867.18	2.84
8	300142	沃森生物	140,697	2,811,126.06	2.75
9	300024	机器人	143,498	2,496,865.20	2.45
10	300122	智飞生物	51,390	2,350,578.60	2.30
11	300070	碧水源	158,927	2,213,853.11	2.17
12	300296	利亚德	148,665	1,914,805.20	1.88
13	300072	三聚环保	81,916	1,907,004.48	1.87
14	300017	网宿科技	159,765	1,711,083.15	1.68
15	300347	泰格医药	27,499	1,701,363.13	1.67
16	300144	宋城演艺	71,468	1,679,498.00	1.65
17	300168	万达信息	75,755	1,545,402.00	1.51
18	300088	长信科技	248,600	1,441,880.00	1.41
19	300253	卫宁健康	106,883	1,324,280.37	1.30
20	300166	东方国信	80,589	1,187,075.97	1.16
21	300009	安科生物	61,026	1,125,319.44	1.10
22	300315	掌趣科技	261,870	1,094,616.60	1.07
23	300170	汉得信息	65,776	1,068,202.24	1.05

24	300308	中际旭创	17,600	1,056,704.00	1.04
25	300182	捷成股份	139,304	1,055,924.32	1.03
26	300027	华谊兄弟	168,650	1,038,884.00	1.02
27	300450	先导智能	33,469	1,012,102.56	0.99
28	300251	光线传媒	97,801	995,614.18	0.98
29	300433	蓝思科技	46,687	979,493.26	0.96
30	300418	昆仑万维	47,562	897,970.56	0.88
31	300274	阳光电源	96,636	866,824.92	0.85
32	300014	亿纬锂能	48,509	853,758.40	0.84
33	300271	华宇软件	48,031	849,188.08	0.83
34	300383	光环新网	60,894	816,588.54	0.80
35	300316	晶盛机电	59,843	795,313.47	0.78
36	300287	飞利信	106,419	765,152.61	0.75
37	300073	当升科技	22,189	755,757.34	0.74
38	300058	蓝色光标	131,669	750,513.30	0.74
39	300133	华策影视	69,611	741,357.15	0.73
40	300055	万邦达	63,220	726,397.80	0.71
41	300355	蒙草生态	118,211	710,448.11	0.70
42	300113	顺网科技	40,702	708,621.82	0.69
43	300115	长盈精密	54,581	707,915.57	0.69
44	300266	兴源环境	34,583	691,314.17	0.68
45	300203	聚光科技	26,887	688,307.20	0.67
46	300199	翰宇药业	46,068	657,851.04	0.64
47	300033	同花顺	16,893	656,630.91	0.64
48	300146	汤臣倍健	41,981	645,247.97	0.63
49	300026	红日药业	176,206	643,151.90	0.63
50	300367	东方网力	50,986	637,325.00	0.62
51	300077	国民技术	56,836	632,016.32	0.62
52	300324	旋极信息	74,467	623,288.79	0.61
53	300207	欣旺达	65,845	593,263.45	0.58
54	300197	铁汉生态	110,436	593,041.32	0.58
55	300098	高新兴	73,322	585,109.56	0.57
56	300244	迪安诊断	30,775	585,032.75	0.57
57	300413	快乐购	15,300	580,482.00	0.57
58	300558	贝达药业	10,400	578,968.00	0.57
59	300377	赢时胜	42,183	573,266.97	0.56
60	300463	迈克生物	22,601	563,442.93	0.55
61	300496	中科创达	18,891	556,717.77	0.55
62	300180	华峰超纤	50,422	546,070.26	0.53
63	300145	中金环境	68,220	534,162.60	0.52
64	300002	神州泰岳	127,679	532,421.43	0.52
65	300459	金科文化	53,800	519,708.00	0.51
66	300068	南都电源	41,644	498,895.12	0.49
67	300212	易华录	21,041	497,619.65	0.49

68	300053	欧比特	42,600	494,160.00	0.48
69	300078	思创医惠	51,453	487,774.44	0.48
70	300257	开山股份	31,890	487,598.10	0.48
71	300222	科大智能	25,493	472,640.22	0.46
72	300020	银江股份	48,418	460,455.18	0.45
73	300001	特锐德	37,956	431,180.16	0.42
74	300159	新研股份	60,329	427,129.32	0.42
75	300118	东方日升	38,544	416,275.20	0.41
76	300323	华灿光电	31,503	407,018.76	0.40
77	300294	博雅生物	12,944	401,134.56	0.39
78	300085	银之杰	29,162	378,522.76	0.37
79	300083	劲胜智能	72,986	351,792.52	0.34
80	300431	暴风集团	22,525	341,929.50	0.33
81	300284	苏交科	41,500	329,095.00	0.32
82	300364	中文在线	45,982	323,713.28	0.32
83	300010	立思辰	25,525	312,426.00	0.31
84	300409	道氏技术	7,700	308,847.00	0.30
85	300090	盛运环保	35,602	296,208.64	0.29
86	300310	宜通世纪	46,145	294,405.10	0.29
87	300618	寒锐钴业	2,240	287,481.60	0.28
88	300699	光威复材	6,200	280,240.00	0.27
89	300148	天舟文化	59,500	267,750.00	0.26
90	300628	亿联网络	3,900	257,049.00	0.25
91	300458	全志科技	13,215	236,812.80	0.23
92	300676	华大基因	2,200	212,982.00	0.21
93	300474	景嘉微	4,300	199,864.00	0.20
94	300317	珈伟股份	16,071	191,244.90	0.19
95	300679	电连技术	3,260	122,608.60	0.12
96	300134	大富科技	10,896	97,410.24	0.10
97	300116	坚瑞沃能	33,020	91,135.20	0.09
98	300038	梅泰诺	5,500	58,630.00	0.06

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300747	锐科激光	1,235	99,244.60	0.10

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	6,448,506.23	12.53
2	300059	东方财富	3,211,741.60	6.24
3	300136	信维通信	2,277,616.00	4.43
4	300003	乐普医疗	2,239,509.50	4.35
5	300124	汇川技术	2,123,692.00	4.13
6	300142	沃森生物	2,008,117.00	3.90
7	300408	三环集团	1,922,569.66	3.74
8	300024	机器人	1,862,291.85	3.62
9	300015	爱尔眼科	1,806,649.02	3.51
10	300070	碧水源	1,667,552.00	3.24
11	300072	三聚环保	1,637,084.00	3.18
12	300296	利亚德	1,356,109.00	2.64
13	300308	中际旭创	1,301,353.00	2.53
14	300122	智飞生物	1,260,544.00	2.45
15	300017	网宿科技	1,235,966.11	2.40
16	300088	长信科技	1,167,624.00	2.27
17	300315	掌趣科技	1,008,852.00	1.96
18	300027	华谊兄弟	982,392.00	1.91
19	300274	阳光电源	939,234.20	1.83
20	300144	宋城演艺	921,792.00	1.79

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	2,914,967.00	5.66
2	300156	神雾环保	555,118.94	1.08
3	300352	北信源	429,450.65	0.83
4	300297	蓝盾股份	418,042.76	0.81
5	300291	华录百纳	336,849.08	0.65
6	300104	乐视网	323,772.68	0.63
7	300075	数字政通	314,016.00	0.61
8	300059	东方财富	312,462.00	0.61
9	300273	和佳股份	297,673.20	0.58
10	300037	新宙邦	280,056.44	0.54
11	300043	星辉娱乐	243,415.70	0.47
12	300124	汇川技术	223,067.00	0.43
13	300136	信维通信	203,070.00	0.39

14	300072	三聚环保	190,939.00	0.37
15	300454	深信服	189,874.96	0.37
16	300003	乐普医疗	179,036.00	0.35
17	300070	碧水源	178,931.00	0.35
18	300216	千山药机	173,276.89	0.34
19	300408	三环集团	169,794.00	0.33
20	300142	沃森生物	162,099.00	0.32

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	67,450,288.14
卖出股票的收入（成交）总额	12,425,265.93

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,810.80	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,810.80	0.00

**7.6 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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	40	4,810.80	0.00

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门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。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,725.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,959.22
5	应收申购款	384,143.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	400,828.21

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	4,810.80	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
6,863	19,577.10	-	-	134,357,646.36	100.00%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈君	1,500,393.00	6.37%
2	黄彩凤	1,028,587.00	4.37%
3	朱五妹	800,209.00	3.40%
4	冯鹰	757,208.00	3.21%
5	王倩云	750,196.00	3.18%
6	林志太	594,970.00	2.53%
7	陈跃梅	500,077.00	2.12%
8	邓敏妍	500,038.00	2.12%
9	杨玉忠	496,206.00	2.11%
10	贾三英	445,207.00	1.89%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	7,777.60	0.01%
------------------	----------	-------

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2016年11月11日）基金份额总额	225,752,502.31
本报告期期初基金份额总额	63,416,508.02
本报告期基金总申购份额	160,331,316.94
减：本报告期基金总赎回份额	89,390,178.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	134,357,646.36

**10 重大事件揭示**

**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内，本基金投资策略无改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	18,109,701.09	22.74%	13,243.81	19.41%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	2,894,296.73	3.63%	380.02	0.56%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	6,075,649.45	7.63%	5,658.42	8.29%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	8,335,249.12	10.47%	7,762.63	11.38%	-
中信证券	1	24,103,981.61	30.26%	22,448.14	32.90%	-
国盛证券	1	20,126,668.35	25.27%	18,744.15	27.47%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租

用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	22,276.90	100.00%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司关于国泰元鑫资产管理有限公司股权结构等事项变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018-01-11
2	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-02-08
3	关于国泰基金管理有限公司旗下证券投资基金	《中国证券报》、《上海证	2018-03-23

	金修改基金合同和托管协议的公告	券报》、《证券时报》、《证券日报》	
4	国泰基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金赎回费的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018-03-23
5	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018-03-28
6	国泰基金管理有限公司住所变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018-03-28
7	国泰基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司销售旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018-06-15
8	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018-06-21

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰创业板指数证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 11.2 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 层-19 层。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

### 11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十四日