

**上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金  
2018 年年度报告摘要  
2018 年 12 月 31 日**

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：二〇一九年三月三十日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 3 月 27 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 2018 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         | 国泰上证 180 金融 ETF    |
| 基金主代码        | 510230             |
| 交易代码         | 510230             |
| 基金运作方式       | 交易型开放式             |
| 基金合同生效日      | 2011 年 3 月 31 日    |
| 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         |
| 报告期末基金份额总额   | 1,143,761,607.00 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         | 2011 年 5 月 23 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 0.2%，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。</p> <p>2、债券投资策略</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | 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，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。                      |
| 业绩比较基准 | 上证 180 金融股指数   |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

### 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                   | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李永梅                          | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 021-31081600转                | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | xinxiplu@gtfund.com          | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | (021) 31089000, 400-888-8688 | 95566                |
| 传真          |      | 021-31081800                 | 010-66594942         |

### 2.4 信息披露方式

|                         |   |
|-------------------------|---|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联<br>网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 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<br>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 | 2018 年          | 2017 年         | 2016 年          |
|---------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期已实现收益       | -17,934,310.47  | 410,716,936.87 | 82,279,165.57   |
| 本期利润          | -863,514,162.32 | 727,947,544.07 | -199,076,090.64 |

|                      |                  |                  |                  |
|----------------------|------------------|------------------|------------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | -1.1812          | 1.1387           | -0.3117          |
| 本期基金份额净值增长率          | -17.11%          | 21.89%           | -5.08%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2018 年末</b>   | <b>2017 年末</b>   | <b>2016 年末</b>   |
| 期末可供分配基金份额利润         | 1.1767           | 2.4463           | 1.6599           |
| 期末基金资产净值             | 5,373,081,431.14 | 3,907,590,530.78 | 3,376,710,991.77 |
| 期末基金份额净值             | 4.6977           | 6.3152           | 5.1809           |

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<br>率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -10.14%      | 1.57%               | -9.86%         | 1.57%                 | -0.28% | 0.00%  |
| 过去六个月          | -2.00%       | 1.50%               | -3.44%         | 1.50%                 | 1.44%  | 0.00%  |
| 过去一年           | -17.11%      | 1.38%               | -18.77%        | 1.38%                 | 1.66%  | 0.00%  |
| 过去三年           | -4.09%       | 1.17%               | -10.43%        | 1.17%                 | 6.34%  | 0.00%  |
| 过去五年           | 65.09%       | 1.66%               | 47.77%         | 1.66%                 | 17.32% | 0.00%  |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 48.68%       | 1.61%               | 29.98%         | 1.62%                 | 18.70% | -0.01% |

#### 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

上证 180 金融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  
 (2011 年 3 月 31 日至 2018 年 12 月 31 日)

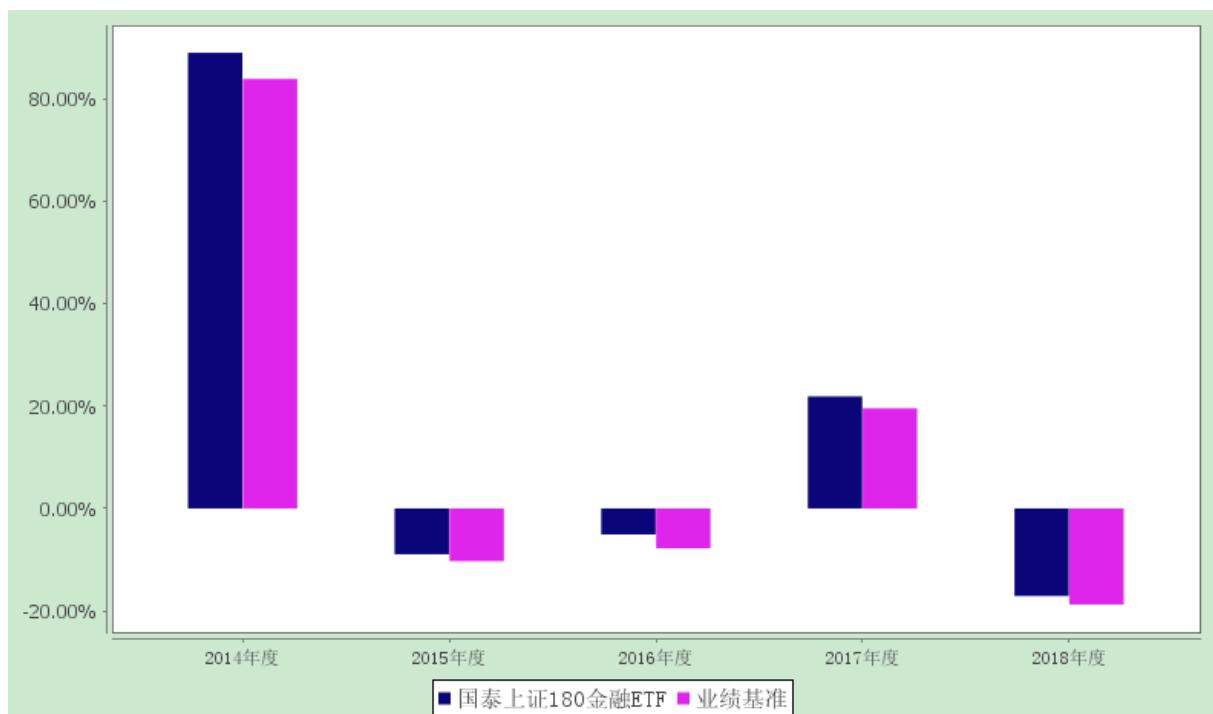


注：本基金的合同生效日为 2011 年 3 月 31 日。本基金在三个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 过去五年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

上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|-------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2018 年 | 5.500       | 635,668,883.85 | -         | 635,668,883.85 | -  |
| 2017 年 | -           | -              | -         | -              | -  |
| 2016 年 | -           | -              | -         | -              | -  |
| 合计     | 5.500       | 635,668,883.85 | -         | 635,668,883.85 | -  |

## §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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 98 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、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（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、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、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、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、国泰鑫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、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、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、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、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、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、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、国泰可转债债

券型证券投资基金、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、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，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）。另外，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，基金管理人获得企业年金基金管理人资格。2008 年 2 月 14 日，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 联接、国泰深证 TMT50 指数分级、国泰沪深 300 指数、国泰黄金 ETF 联接、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰策 | 2014-01-13      | -    | 18 年   | 硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理。 |

|  |   |  |  |   |
|--|---|--|--|---|
|  | 略价值灵活配置混合、国泰量化策略收益混合、国泰国证航天军工指数(LOF)、国泰中证申万证券行业指数(LOF)、国泰宁益定期开放灵活配置混合、国泰量化成长优选混合、国泰量化价值精选混合、国泰结构转型灵活配置混合的基金经理、投资总监(量化)、金融工程总监 |  |  | 理, 2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理, 2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理, 2016 年 4 月起兼任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, 2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)的基金经理, 2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)的基金经理, 2017 年 5 月起兼任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)的基金经理, 2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 8 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金和国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 8 月起兼任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 12 月起兼任国泰量化策略收益混合型证券投资基金(由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。 |
|--|---|--|--|---|

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遵规守信情况的说明

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，基金管理团队保持独立运作，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

(一) 公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

(二) 公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

(三) 公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

(四) 公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

(五) 公司严格执行不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

(六) 公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

(七) 公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期

检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

#### 4.3.2 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≥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。

#### 4.3.3 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 A 股市场受国内外双重压力呈现逐级走弱态势，创出近十年的最差表现。国内来看，受资管新规出台、金融去杠杆影响，叠加经济预期趋弱、市场信用风险频发，整体融资环境恶化，导致市场避险情绪持续上升；国际环境方面，受中美贸易战持续升级的打压，尤其是中兴通讯事件、华为高管被捕导致的相关板块的下挫加剧了市场的悲观情绪，市场连创新低，并击穿 2638 点的前期低点，创出了 2449 点的新低。

受基金发行升温影响，一月份市场延续去年的惯性，以漂亮 50 为首的蓝筹白马股表现强劲，上

证指数创出了历史罕见的 11 连阳。1 月底受部分绩差公司大幅预亏、叠加金融去杠杆以及美股大幅下挫影响，A 股短期大幅下挫。随着两会临近，政策加大新旧动能的转换，做大做强新兴产业集群的决心，包括富士康 IPO 的快速过会、A 股独角兽的回归，市场风险偏好持续提升，以创业板为首的新经济持续走强。而随着中美贸易纠纷升级、金融去杠杆的持续影响，信用风险持续上升，以东方园林发债遇阻以及中兴通讯事件导致的相关个股股价下跌进而引发投资者对股票质押爆仓风险的担忧，加剧了市场的悲观情绪，市场连创新低，逼近前期 2638 点的低点附近。三季度中美贸易摩擦持续升级，双方开启互征关税等对 A 股市场形成持续冲击；另一方面在 A 股正式纳入 MSCI 以及富时罗素指数宣布将 A 股纳入指数体系，经历了持续下挫的 A 股的相对估值更加合理，北上资金持续加大流入，A 股市场呈现震荡走势，屡次逼近前期低点 2638 点。四季度受中美贸易摩擦持续升级、国内经济下行压力加大、股票质押爆仓风险频出等利空因素持续打压，A 股市场以 10 月 8 日大跌 3.72% 开盘，持续下跌，后在高层稳定民企的讲话以及一系列化解股权质押风险的政策支持下，市场迎来了一波小幅反弹。随后在华为高管被捕的影响下市场风险偏好降低。此外，医药带量采购对医药板块形成持续打压。多重因素影响 A 股重回跌势。全年上证综指下跌 24.6%，沪深 300 下跌 25.3%，中证 500 下跌 33.3%，中证 1000 下跌 36.9%，风格上小盘股受股票质押爆仓风险持续打压跌幅更大，行业上受中美贸易战以及中兴华为事件影响更深的电子、强周期的有色、受明星逃税波及的传媒位居跌幅前三，分别下跌 42.37%、41.04%、39.58%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2018 年的净值增长率为 -17.11%，同期业绩比较基准收益率为 -18.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们认为经济面临较大下滑压力、中美贸易谈判这两大因素将是影响 A 股全年的主线。在经济面临较大下滑压力的情况下，稳增长、稳就业政策出台的时机和力度将相当程度上影响 A 股走势，我们预计 A 股或仍将以震荡为主。行业板块上，以基本面持续改善的军工、2019 年将迎来牌照发放的 5G 以及安全自主可控等领域或将迎来较好的投资机会。就一季度而言，包括地方债提前发行、增值税减税出台、中美贸易 90 天谈判成果等因素都将影响市场走势。

上证 180 金融指数由上证 180 指数中银行、保险、证券、信托等行业构成，基于长期投资、价值投资的理念，投资者或可利用国泰上证 180 金融 ETF 基金这一资产配置工具，把握中国金融行业长期投资机会。

#### 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

本基金已于 2018 年实施利润分配 635,668,883.85 元。截止本报告期末，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21016 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产       | 本期末              | 上年度末             |
|----------|------------------|------------------|
|          | 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 12 月 31 日 |
| 资产：      | -                | -                |
| 银行存款     | 13,982,373.83    | 548,381.31       |
| 结算备付金    | 1,266,592.66     | 2,756,667.45     |
| 存出保证金    | 67,930.06        | 65,955.78        |
| 交易性金融资产  | 5,368,115,880.14 | 3,907,715,532.62 |
| 其中：股票投资  | 5,368,115,880.14 | 3,907,715,532.62 |
| 基金投资     | -                | -                |
| 债券投资     | -                | -                |
| 资产支持证券投资 | -                | -                |
| 贵金属投资    | -                | -                |
| 衍生金融资产   | -                | -                |
| 买入返售金融资产 | -                | -                |
| 应收证券清算款  | -                | 1,404.68         |
| 应收利息     | 20,369.39        | 1,620.10         |
| 应收股利     | -                | -                |
| 应收申购款    | -                | -                |

|                   |                                 |                                  |
|-------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 递延所得税资产           | -                               | -                                |
| 其他资产              | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>       | <b>5,383,453,146.08</b>         | <b>3,911,089,561.94</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| 负债:               | -                               | -                                |
| 短期借款              | -                               | -                                |
| 交易性金融负债           | -                               | -                                |
| 衍生金融负债            | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款         | -                               | -                                |
| 应付证券清算款           | 5,404,311.45                    | 31,974.51                        |
| 应付赎回款             | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬           | 2,592,049.24                    | 1,686,058.91                     |
| 应付托管费             | 518,409.86                      | 337,211.79                       |
| 应付销售服务费           | -                               | -                                |
| 应付交易费用            | 830,367.59                      | 1,144,521.90                     |
| 应交税费              | -                               | -                                |
| 应付利息              | -                               | -                                |
| 应付利润              | -                               | -                                |
| 递延所得税负债           | -                               | -                                |
| 其他负债              | 1,026,576.80                    | 299,264.05                       |
| <b>负债合计</b>       | <b>10,371,714.94</b>            | <b>3,499,031.16</b>              |
| <b>所有者权益:</b>     | <b>-</b>                        | <b>-</b>                         |
| 实收基金              | 4,027,205,413.93                | 2,178,670,868.86                 |
| 未分配利润             | 1,345,876,017.21                | 1,728,919,661.92                 |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>5,373,081,431.14</b>         | <b>3,907,590,530.78</b>          |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>5,383,453,146.08</b>         | <b>3,911,089,561.94</b>          |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.6977 元，基金份额总额 1,143,761,607.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|-----------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                       | 2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年<br>12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>           | <b>-828,821,058.40</b>              | <b>759,187,058.15</b>               |
| 1.利息收入                | 77,843.34                           | 61,283.92                           |
| 其中：存款利息收入             | 77,843.34                           | 59,469.23                           |
| 债券利息收入                | -                                   | 1,814.69                            |
| 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）      | 16,199,475.90                       | 441,991,250.22                      |
| 其中：股票投资收益             | -94,544,900.90                      | 346,706,813.82                      |
| 基金投资收益                | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                | -                                   | 1,383,997.71                        |
| 资产支持证券投资收益            | -                                   | -                                   |
| 贵金属投资收益               | -                                   | -                                   |
| 衍生工具收益                | -                                   | -                                   |
| 股利收益                  | 110,744,376.80                      | 93,900,438.69                       |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -845,579,851.85                     | 317,230,607.20                      |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                   | -                                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 481,474.21                          | -96,083.19                          |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>34,693,103.92</b>                | <b>31,239,514.08</b>                |
| 1. 管理人报酬              | 21,026,787.33                       | 18,434,215.68                       |
| 2. 托管费                | 4,205,357.55                        | 3,686,843.12                        |

|                            |                        |                       |
|----------------------------|------------------------|-----------------------|
| 3. 销售服务费                   | -                      | -                     |
| 4. 交易费用                    | 7,291,187.13           | 7,739,043.39          |
| 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                    | 2,169,771.91           | 1,379,411.89          |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> | <b>-863,514,162.32</b> | <b>727,947,544.07</b> |
| 减：所得税费用                    | -                      | -                     |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   | <b>-863,514,162.32</b> | <b>727,947,544.07</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                    | 本期                               |                  |                  |
|---------------------------------------|----------------------------------|------------------|------------------|
|                                       | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)                       | 2,178,670,868.86                 | 1,728,919,661.92 | 3,907,590,530.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)              | -                                | -863,514,162.32  | -863,514,162.32  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列) | 1,848,534,545.07                 | 1,116,139,401.46 | 2,964,673,946.53 |
| 其中：1.基金申购款                            | 2,286,901,308.60                 | 1,371,623,450.34 | 3,658,524,758.94 |
| 2.基金赎回款                               | -438,366,763.53                  | -255,484,048.88  | -693,850,812.41  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基                  | -                                | -635,668,883.85  | -635,668,883.85  |

| 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)                        | 4,027,205,413.93                 | 1,345,876,017.21 | 5,373,081,431.14 |
| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                  |                  |
|  | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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)                        | 2,294,864,468.86                 | 1,081,846,522.91 | 3,376,710,991.77 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                | 727,947,544.07   | 727,947,544.07   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -116,193,600.00                  | -80,874,405.06   | -197,068,005.06  |
| 其中：1.基金申购款                             | 140,840,727.35                   | 92,268,082.84    | 233,108,810.19   |
| 2.基金赎回款                                | -257,034,327.35                  | -173,142,487.90  | -430,176,815.25  |
| 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)                        | 2,178,670,868.86                 | 1,728,919,661.92 | 3,907,590,530.78 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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：倪蓥，会计机构负责人：吴洪涛

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“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[2011]239 号《关于核准上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 566,033,941.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 31 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 566,044,541.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,600.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司确定 2011 年 5 月 6 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 金融股指数收盘值为 3,336.396 点,本基金的基金资产净值为 536,366,537.07 元,折算前基金份额总额为 566,044,541.00 份,折算前基金份额净值为 0.948 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.28400990,折算后基金份额总额为 160,761,607.00 份,折算后基金份额净值为 3.336 元。本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2011 年 5 月 9 日完成了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 95 号文审核同意,本基金于 2011 年 5 月 23 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 180 金融股指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化;主要投资范围为标的指数的成份股、备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;本基金可少量投资于非标的指数成分股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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%。本基金的业绩比较基准为上证 180 金融股指数。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国泰上证 180 金融 ETF 联接基金”)。国泰上证 180 金融 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资

于本基金。

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 2019 年 3 月 27 日批准报出。

#### **7.4.2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《证券投资基金管理信息披露 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》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **7.4.3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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4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。

#### **7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1会计政策变更的说明**

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2会计估计变更的说明**

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3差错更正的说明**

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

| 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     |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)                                  | 基金托管人            |
| 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(“国泰上证 180 金融 ETF 联接”) | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |
| 中国电力财务有限公司  | 基金管理人的股东         |
| 意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)              | 基金管理人的股东         |
| 国泰元鑫资产管理有限公司  | 基金管理人的控股子公司      |
| 中国建银投资有限责任公司  | 基金管理人的控股股东       |
| 国泰全球投资管理有限公司  | 基金管理人的控股子公司      |

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 21,026,787.33                   | 18,434,215.68                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                                    |

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。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,205,357.55                    | 3,686,843.12                         |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称              | 本期末 2018 年 12 月 31 日 |                  | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |                  |
|--------------------|----------------------|------------------|-----------------------|------------------|
|                    | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 国泰上证 180 金融 ETF 联接 | 311,062,743.00       | 27.20%           | 87,740,643.00         | 14.18%           |

#### 7.4.8.5 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                    |           | 上年度可比期间               |           |
|-------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
|       | 2018年1月1日至2018年12月31日 |           | 2017年1月1日至2017年12月31日 |           |
|       | 期末余额                  | 当期利息收入    | 期末余额                  | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 13,982,373.83         | 43,038.44 | 548,381.31            | 21,681.52 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有在承销期参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 40,709,152 股，估值总额为人民币 146,960,038.72 元，占基金资产净值的比例为 2.74%。

(于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 24,861,752 股，估值总额为人民币 98,701,155.44 元，占基金资产净值的比例为 2.53%。)

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |           |              |              |    |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股)  | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 601860              | 紫金银行 | 2018-12-20 | 2019-01-03 | 网下中签   | 3.14  | 3.14   | 15,970.00 | 50,145.80    | 50,145.80    | -  |
| 603156              | 养元饮品 | 2018-02-02 | 2019-02-12 | 网下中签   | 78.73 | 41.58  | 37,717.00 | 2,969,459.41 | 1,568,272.86 | -  |
| 603156              | 养元饮品 | 2018-05-08 | 2019-02-12 | 送股     | -     | 41.58  | 15,087.00 | -            | 627,317.46   | -  |

注：基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 7.4.9.2 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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|---------------|----------------|----------------|----|
| 600030 | 中信证券 | 2018-12-25 | 重大事项 | 16.01  | 2019-01-10 | 17.15  | 15,014,702.00 | 256,948,185.18 | 240,385,379.02 | -  |

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 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的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 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。

##### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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 12 月 31 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 5,125,484,765.00 元，属于第二层次的余额为 242,631,115.14 元，无第三层次的余额(第一层次的余额为 3,907,678,636.17 元，属于第二层次的余额为 36,896.45 元，无第三层次的余额)。

###### (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，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

无。

###### (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 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)基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 3,658,524,758.94 元，其中包括以股票支付的申购款 3,629,942,196.21 元和以现金支付的申购款 28,582,562.73 元。

### (3)除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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              | 5,368,115,880.14 | 99.72        |
|    | 其中：股票             | 5,368,115,880.14 | 99.72        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -                | -            |
|    | 其中：债券             | -                | -            |
|    | 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      | 15,248,966.49    | 0.28         |
| 8  | 其他各项资产            | 88,299.45        | 0.00         |
| 9  | 合计                | 5,383,453,146.08 | 100.00       |

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | -                | -            |
| 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              | 5,365,763,420.31 | 99.86        |
| 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               | 5,365,763,420.31 | 99.86        |

### 8.2.2 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              | 2,302,314.03 | 0.04          |
| 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              | 50,145.80    | 0.00          |
| 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               | 2,352,459.83 | 0.04          |

### 8.3 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

#### 8.3.1 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前十名股票投资明细

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  | 601318 | 中国平安 | 13,722,007 | 769,804,592.70 | 14.33 |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 19,896,904 | 501,401,980.80 | 9.33  |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 24,055,116 | 359,383,433.04 | 6.69  |
| 4  | 601328 | 交通银行 | 53,062,172 | 307,229,975.88 | 5.72  |
| 5  | 600016 | 民生银行 | 48,026,987 | 275,194,635.51 | 5.12  |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 74,100,498 | 266,761,792.80 | 4.96  |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 15,014,702 | 240,385,379.02 | 4.47  |
| 8  | 600000 | 浦发银行 | 22,641,322 | 221,884,955.60 | 4.13  |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 41,650,950 | 220,333,525.50 | 4.10  |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 6,174,869  | 175,551,525.67 | 3.27  |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.3.2 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前五名股票投资明细

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  | 603156 | 养元饮品 | 52,804 | 2,195,590.32 | 0.04         |
| 2  | 603185 | 上机数控 | 1,345  | 66,039.50    | 0.00         |
| 3  | 601860 | 紫金银行 | 15,970 | 50,145.80    | 0.00         |
| 4  | 603629 | 利通电子 | 1,051  | 40,684.21    | 0.00         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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  | 601318 | 中国平安 | 331,155,330.89 | 8.47            |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 206,171,672.17 | 5.28            |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 141,414,753.77 | 3.62            |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 123,889,864.51 | 3.17            |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 113,803,805.14 | 2.91            |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 100,791,478.10 | 2.58            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7  | 601288 | 农业银行 | 99,119,867.21 | 2.54 |
| 8  | 601229 | 上海银行 | 88,749,930.04 | 2.27 |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 87,707,008.63 | 2.24 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 87,205,781.15 | 2.23 |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 81,829,032.93 | 2.09 |
| 12 | 601211 | 国泰君安 | 70,981,301.66 | 1.82 |
| 13 | 601169 | 北京银行 | 63,351,911.40 | 1.62 |
| 14 | 601988 | 中国银行 | 56,071,213.00 | 1.43 |
| 15 | 600837 | 海通证券 | 55,486,978.41 | 1.42 |
| 16 | 601939 | 建设银行 | 42,698,754.20 | 1.09 |
| 17 | 601818 | 光大银行 | 42,546,247.76 | 1.09 |
| 18 | 600999 | 招商证券 | 41,883,167.19 | 1.07 |
| 19 | 601688 | 华泰证券 | 38,396,785.06 | 0.98 |
| 20 | 601009 | 南京银行 | 38,178,763.05 | 0.98 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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  | 601318 | 中国平安 | 470,008,300.87 | 12.03           |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 269,676,131.98 | 6.90            |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 202,484,928.31 | 5.18            |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 185,129,100.15 | 4.74            |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 149,433,266.43 | 3.82            |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 130,111,299.47 | 3.33            |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 123,974,230.33 | 3.17            |
| 8  | 600000 | 浦发银行 | 114,380,393.65 | 2.93            |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 114,206,703.07 | 2.92            |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 99,181,939.07  | 2.54            |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 81,489,845.53  | 2.09            |
| 12 | 600837 | 海通证券 | 74,843,617.30  | 1.92            |
| 13 | 601988 | 中国银行 | 72,155,460.00  | 1.85            |
| 14 | 601211 | 国泰君安 | 60,365,242.20  | 1.54            |
| 15 | 601939 | 建设银行 | 57,801,419.04  | 1.48            |
| 16 | 601818 | 光大银行 | 55,774,338.11  | 1.43            |
| 17 | 601688 | 华泰证券 | 48,802,820.65  | 1.25            |
| 18 | 600015 | 华夏银行 | 45,877,548.11  | 1.17            |
| 19 | 601229 | 上海银行 | 42,167,833.15  | 1.08            |
| 20 | 600919 | 江苏银行 | 41,158,502.79  | 1.05            |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 2,394,295,609.95 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 2,929,666,150.89 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。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。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“招商银行”、“兴业银行”、“交通银行”、“民生银行”、“浦发银行”违规外）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。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字〔2018〕1 号，招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户、为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保、未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目、高管人员在获得任职资格核准前履职、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务、未严格审查贸易背景真实性开立信用证、违规签订保本合同销售同业非保本理财产品、非真实转让信贷资产、违规向典当行发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等共计十四项违规事实。中国银监会决定对其罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕1 号，兴业银行存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等共计十二项违规事实。中国银保监会决定对其罚款 5870 万元。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕12 号，交通银行存在（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本

行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 690 万元。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字（2018）13 号，交通银行存在并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 50 万元。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字（2018）8 号，民生银行存在（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 3160 万元。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字（2018）8 号，民生银行存在贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 200 万元。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字（2018）4 号，浦发银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求、提供不实说明材料、不配合调查取证、以贷转存，虚增存贷款、票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严、国内信用证业务贸易背景审查不严、贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款、违规通过同业投资转存款方式，虚增存款、票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理、对代理收付资金的信托计划提供保本承诺、以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产、投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大、修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符、为非保本理财产品出具保本承诺函、向关系人发放信用贷款、向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符、收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。等共计十九项违规事实。中国银监会决定对其罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。

根据 2018 年 1 月 20 日浦发银行发布的公告，公司成都分行收到中国银监会四川监管局行政处罚书，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46175 万元，并对相关管理人员进行处罚。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司的投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

#### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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   | 67,930.06 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 20,369.39 |
| 5  | 应收申购款   | -         |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 88,299.45 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 600030 | 中信证券 | 240,385,379.02 | 4.47         | 重大事项     |

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1  | 603156 | 养元饮品 | 2,195,590.32 | 0.04         | 新股锁定     |
| 2  | 601860 | 紫金银行 | 50,145.80    | 0.00         | 网下新股     |

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 |
| 2,327    | 491,517.67 | 1,123,531,882.00 | 98.23% | 20,229,725.00 | 1.77%  |

### 9.2 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  | 中央汇金投资有限责任公司                             | 512,712,100.00 | 44.83%   |
| 2  | 中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红                   | 171,938,279.00 | 15.03%   |
| 3  | 百年人寿保险股份有限公司一分红保险产品                      | 40,141,100.00  | 3.51%    |
| 4  | 中国平安人寿保险股份有限公司一万能一个险万能                   | 36,643,500.00  | 3.20%    |
| 5  | 中国平安人寿保险股份有限公司一自有资金                      | 36,643,500.00  | 3.20%    |
| 6  | 方正证券股份有限公司                               | 8,618,853.00   | 0.75%    |
| 7  | 广发证券股份有限公司                               | 4,469,007.00   | 0.39%    |
| 8  | 李亚宁                                      | 3,110,000.00   | 0.27%    |
| 9  | 杨国良                                      | 766,600.00     | 0.07%    |
| 10 | 中信建投证券有限责任公司                             | 602,600.00     | 0.05%    |
| -  | 中国银行股份有限公司一国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 311,062,743.00 | 27.20%   |

### 9.3 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 | 0.00      | 0.00%    |

### 9.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2011 年 3 月 31 日)基金份额总额 | 566,044,541.00   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 618,761,607.00   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 649,500,000.00   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 124,500,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 1,143,761,607.00 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2018 年 7 月 28 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理任职公告》，经本基金管理人第七届董事会第十六次会议审议通过，聘任封雪梅女士担任公司副总经理；

2018 年 12 月 13 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第十九次会议审议通过，陈星德先生不再担任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

## 11.5 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，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 108,000 元。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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<br>单元<br>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<br>票成交总<br>额的比例 | 佣金           | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 |    |
| 中金证券  | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 银河证券  | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 中投证券  | 2              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 长江证券  | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 瑞银证券  | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 中信建投  | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 东方证券  | 2              | 4,850,484,709.10 | 91.19%               | 3,547,158.07 | 91.19%             | -  |
| 新时代证券 | 1              | 300,679,088.03   | 5.65%                | 219,884.53   | 5.65%              | -  |
| 信达证券  | 1              | 167,717,897.97   | 3.15%                | 122,650.80   | 3.15%              | -  |

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。

### 11.7.2 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 |
| 中金证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中投证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 瑞银证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 新时代证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 信达证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                       | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                |                |                | 报告期末持有基金情况     |        |
|-----------------------------|----------------|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|--------|
|                             | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构                          | 1              | 2018年1月1日至2018年12月31日  | 512,712,100.00 | -              | -              | 512,712,100.00 | 44.83% |
| 国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接 | 1              | 2018年11月8日至2018年12月31日 | 87,740,643.00  | 396,500,000.00 | 173,177,900.00 | 311,062,743.00 | 27.20% |

|   |  |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|--|
| 基金  |  |  |  |  |  |  |  |
| 产品特有风险  |  |  |  |  |  |  |  |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |  |  |  |  |  |  |  |