

**国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基  
金发起式联接基金  
2020 年第 3 季度报告  
2020 年 9 月 30 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接                                                                                                                                          |
| 基金主代码      | 008281                                                                                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2019 年 11 月 22 日                                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 2,258,871,976.66 份                                                                                                                                             |
| 投资目标       | 通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                       |
| 投资策略       | <p>本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股，其中，投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货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。</p> <p>本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的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><b>2、目标 ETF 投资策略</b></p> <p>本基金投资目标 ETF 的两种方式如下：</p> <p>（1）申购和赎回：以申购/赎回对价进行申购赎回目标 ETF 或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申购赎回目标 ETF。</p> <p>（2）二级市场方式：在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标 ETF。当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整。</p> <p><b>3、股票投资策略</b></p> <p>（1）股票组合构建方法</p> <p>本基金可以直接投资本基金标的指数的成份股及备选成份股，该部分股票资产投资原则上主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：1）标的指数成份股流动性严重不足；2）标的指数的成份股长期停牌；3）其他对本基金管理人跟踪标的指数构成严重制约的情形等。</p> <p>（2）股票组合的调整</p> <p>1）定期调整</p> <p>本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p>2）不定期调整</p> <p>基金经理将跟踪标的指数变动、基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>4、债券投资策略</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，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>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                         |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
|                 | <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的对冲作用，降低股票组合的系统性风险。</p> <p>7、融资与转融通证券出借投资策略</p> <p>本基金在参与融资与转融通证券出借业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模与转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑融资与转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性等特征，谨慎进行投资。</p> |                         |
| 业绩比较基准          | 中华交易服务半导体芯片行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                                            |                         |
| 风险收益特征          | 本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本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。本基金主要通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。                                                                                                                              |                         |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                        |                         |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 A                                                                                                                                                                                                                                                           | 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 008281                                                                                                                                                                                                                                                                            | 008282                  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 686,345,212.70 份                                                                                                                                                                                                                                                                  | 1,572,526,763.96 份      |

### 2.1.1 目标基金基本情况

|      |                              |
|------|------------------------------|
| 基金名称 | 国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金 |
|------|------------------------------|

|              |                 |
|--------------|-----------------|
| 基金主代码        | 512760          |
| 基金运作方式       | 交易型开放式          |
| 基金合同生效日      | 2019 年 5 月 16 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所         |
| 上市日期         | 2019 年 6 月 12 日 |
| 基金管理人名称      | 国泰基金管理有限公司      |
| 基金托管人名称      | 中国银行股份有限公司      |

### 2.1.2 目标基金产品说明

|        |                                                                                    |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                         |
| 投资策略   | 1、股票投资策略;2、债券投资策略;3、资产支持证券投资策略;4、中小企业私募债投资策略;5、权证投资策略;6、股指期货投资策略;7、融资与转融通证券出借投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中华交易服务半导体芯片行业指数收益率                                                                 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。                        |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期                              |                         |
|----------------|----------------------------------|-------------------------|
|                | (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日) |                         |
|                | 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 A          | 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 C |
| 1.本期已实现收益      | 12,043,506.59                    | 23,649,427.36           |
| 2.本期利润         | -32,656,034.07                   | -120,521,506.76         |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0525                          | -0.0881                 |
| 4.期末基金资产净值     | 1,002,876,146.51                 | 2,291,967,840.14        |

|            |        |        |
|------------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.4612 | 1.4575 |
|------------|--------|--------|

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 本报告期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

#### 1、国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差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          | -0.83%     | 2.44%         | -1.94%         | 2.56%                 | 1.11%   | -0.12% |
| 过去六个月          | 28.38%     | 2.40%         | 27.48%         | 2.51%                 | 0.90%   | -0.11% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 46.12%     | 2.47%         | 59.31%         | 2.81%                 | -13.19% | -0.34% |

#### 2、国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 C：

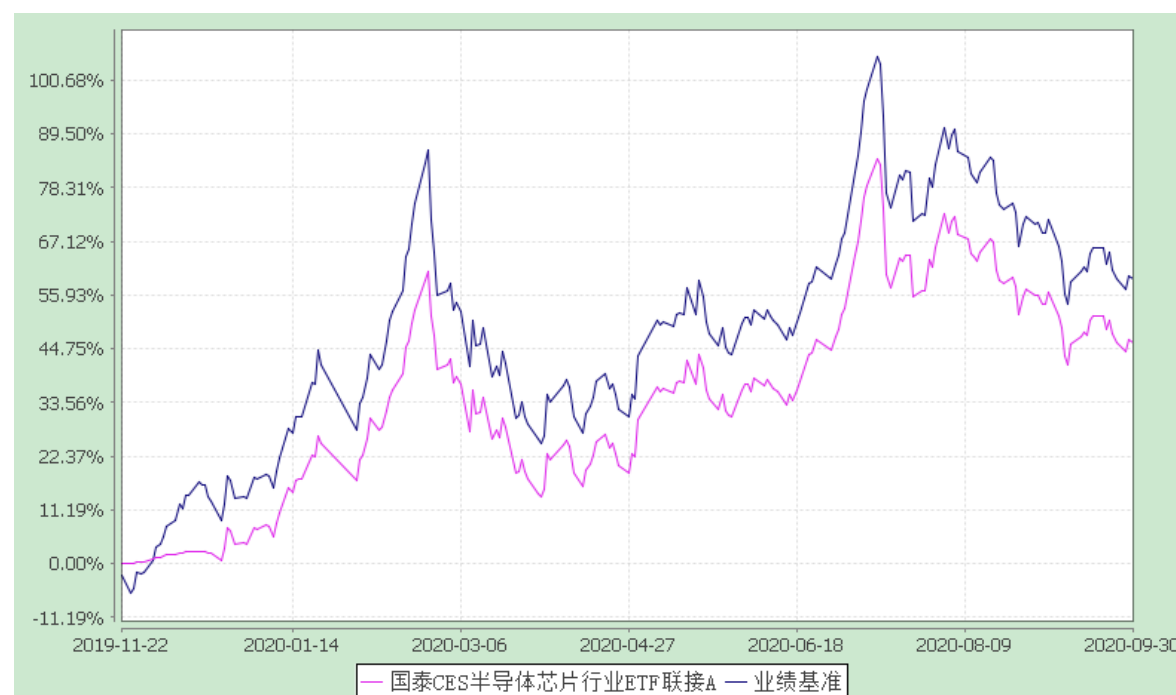
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | -0.90%     | 2.44%         | -1.94%         | 2.56%                 | 1.04%   | -0.12% |
| 过去六个月          | 28.19%     | 2.40%         | 27.48%         | 2.51%                 | 0.71%   | -0.11% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 45.75%     | 2.47%         | 59.31%         | 2.81%                 | -13.56% | -0.34% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金  
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

(2019 年 11 月 22 日至 2020 年 9 月 30 日)

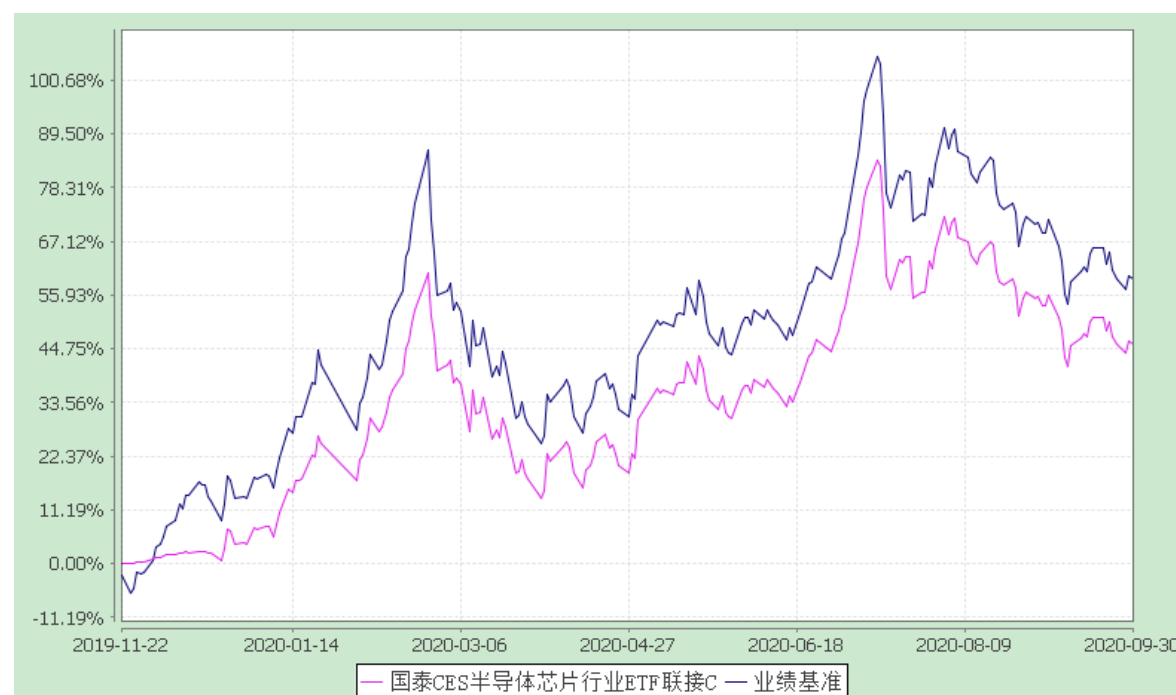
#### 1. 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 A：



注：(1)本基金合同生效日为 2019 年 11 月 22 日，截止到 2020 年 9 月 30 日，本基金成立尚  
未  
满  
一  
年。

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2. 国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接 C:



注：(1)本基金合同生效日为 2019 年 11 月 22 日，截止到 2020 年 9 月 30 日，本基金成立尚  
未  
满  
一  
年。

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                                                                          | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                             | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 梁杏 | 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、国泰量化收益灵活配置混合、国泰中证生物医药 ETF、国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证煤炭 ETF、国 | 2019-11-22  | -    | 13 年   | 学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 月起任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 月至 2019 年 4 月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 7 月起兼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，2019 年 4 月起兼任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年起 11 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）的基金经理，2020 年 1 月起兼任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰上 |

|  |                                                                                                               |  |  |  |                                                                                      |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 泰中证<br>钢铁<br>ETF 联<br>接、国<br>泰中证<br>钢铁<br>ETF、国<br>泰上证<br>综合<br>ETF 的<br>基金经<br>理、量<br>化投资<br>(事业)<br>部<br>总监 |  |  |  | 证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资(事业)部副总监, 2018 年 7 月起任量化投资(事业)部总监。 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------|

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 公平交易专项说明

##### 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, 严格控制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，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。

#### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 7 月初沪深 300 指数在证券板块的带动下迅速上涨，从 7 月中旬开始进入震荡整固期，整个三季度指数上涨 10.17%。中华半导体芯片指数下跌 2.16%，国泰 CES 半导体芯片 ETF 联接基金的 A 类和 C 类分别下跌 0.83%和 0.90%，较好地实现了对指数的跟踪。

整个三季度，证券板块成为首当其冲的急先锋之后，科技和消费板块都处于估值较高的位置，虽然二季报和中报业绩也相对不错，但是进入估值消化期之后，持续震荡，并未承担起行情接力的作用。另外，三季度国际关系一度较为紧张，华为受到了较多的外部限制，虽然国内出台了产业扶持政策，但依然对市场情绪的提振有较大影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰半导体 ETF 联接 A 类在 2020 年第三季度的净值增长率为-0.83%，同期业绩比较基准收益率为-1.94%。

国泰半导体 ETF 联接 C 类在 2020 年第三季度的净值增长率为-0.90%，同期业绩比较基准收益率为-1.94%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

芯片行业的未来格局和发展我们在中报中有详细阐述，本次季报补充一些短期展望。我们认为当前需求明确和国产替代持续推进的格局下，芯片行业的投资机会需要关注三点，业绩超预期、新的支持政策出台、厂商重大技术突破。随着 10 月中旬中芯 N+1 制程流片成功，芯片行业的投资热情也有望被再次点燃。另外，按照我们的预判，今年年底至明年或将持续迎来 5G 换机潮，对芯片的需求支持明显。此前行业已经震荡调整近三个月，回撤幅度超过 25%。中华半导体芯片行业指数估值也已经回到年初的水平，预计三季报将延续高增长，有望进一步消化估值，建议关注芯片 ETF（512760）和芯片 ETF 联接基金（008281/008282）的投资机会。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | 2,968,403,200.00 | 88.84        |
| 3  | 固定收益投资            | 16,378,605.00    | 0.49         |
|    | 其中：债券             | 16,378,605.00    | 0.49         |
|    | 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      | 328,107,817.31   | 9.82         |
| 8  | 其他各项资产            | 28,493,629.13    | 0.85         |
| 9  | 合计                | 3,341,383,251.44 | 100.00       |

### 5.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称                         | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------------|------|--------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型  | 交易型开放式 | 国泰基金管理有限公司 | 2,968,403,200.00 | 90.09        |

### 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 16,378,605.00 | 0.50         |
| 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） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 16,378,605.00 | 0.50         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019627 | 20 国债 01 | 163,950 | 16,378,605.00 | 0.50         |

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

### 5.8 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。

## 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 297,488.45    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 296,487.76    |
| 5  | 应收申购款   | 26,506,009.18 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | 1,393,643.74  |
| 9  | 合计      | 28,493,629.13 |

### 5.12.4 报告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。

### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 国泰CES半导体芯片行业ETF联接A | 国泰CES半导体芯片行业ETF联接C |
|--------------|--------------------|--------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 563,534,350.41     | 1,063,154,090.17   |
| 报告期基金总申购份额   | 691,180,462.23     | 2,296,740,288.35   |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 568,369,599.94     | 1,787,367,614.56   |
| 报告期基金拆分变动份额  | -                  | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额 | 686,345,212.70     | 1,572,526,763.96   |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.44          |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目        | 持有份额<br>总数    | 持有份额占<br>基金总份额<br>比例 | 发起份额<br>总数    | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 | 发起份额承诺<br>持有期限 |
|-----------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 0.44%                | 10,000,000.00 | 0.44%                | 3年             |

|             |                   |       |                   |       |   |
|-------------|-------------------|-------|-------------------|-------|---|
| 基金管理人高级管理人员 | -                 | -     | -                 | -     | - |
| 基金经理等人员     | -                 | -     | -                 | -     | - |
| 基金管理人股东     | -                 | -     | -                 | -     | - |
| 其他          | -                 | -     | -                 | -     | - |
| 合计          | 10,000,00<br>0.00 | 0.44% | 10,000,00<br>0.00 | 0.44% | - |

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复
- 2、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同
- 3、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议
- 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

### 9.2 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。

本基金托管人住所。

### 9.3 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  
二〇二〇年十月二十八日