

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  
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	国泰上证 180 金融 ETF 联接
基金主代码	020021
交易代码	020021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 31 日
报告期末基金份额总额	756,245,604.14 份
投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、资产配置策略 为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非标的指数成份股、新

	<p>股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</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 0.3%，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>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>(1) 投资组合的构建</p> <p>基金合同生效后，在建仓期内本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，在目标 ETF 开放申购赎回后将股票组合换购成目标 ETF 份额，使本基金投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。</p> <p>(2) 投资组合的投资方式</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：目标 ETF 开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。</p> <p>2) 二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。本基金在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、降低跟踪误差的目的。在目标 ETF 暂停申购赎回、本基金投资目标 ETF 受到最小申购赎回单位限制的情况下，本基金可在二级市场买卖目标 ETF。本基金在二级市场的 ETF 份额投资将不以套利为目的。</p> <p>本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物</p>
--	--

形式申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标 ETF 的投资方式。通常情况下，本基金以申购和赎回为主：当收到净申购时，本基金构建股票组合、申购目标 ETF；当收到净赎回时，本基金赎回目标 ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续实物申购目标 ETF 的基础证券或者择机在二级市场卖出。

### 3、成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

### 4、债券投资策略

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。

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合，在一定的风险度

	下能提供最大的预期收益，或者在确定收益率上承担最小的风险。
业绩比较基准	上证 180 金融股指数收益率×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。
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

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
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最小化。
投资策略	1、股票投资策略 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。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。2、债券投资策略 基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,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。

### § 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)
1. 本期已实现收益	8,964,509.24
2. 本期利润	86,433,951.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1097
4. 期末基金资产净值	910,209,870.56
5. 期末基金份额净值	1.2036

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

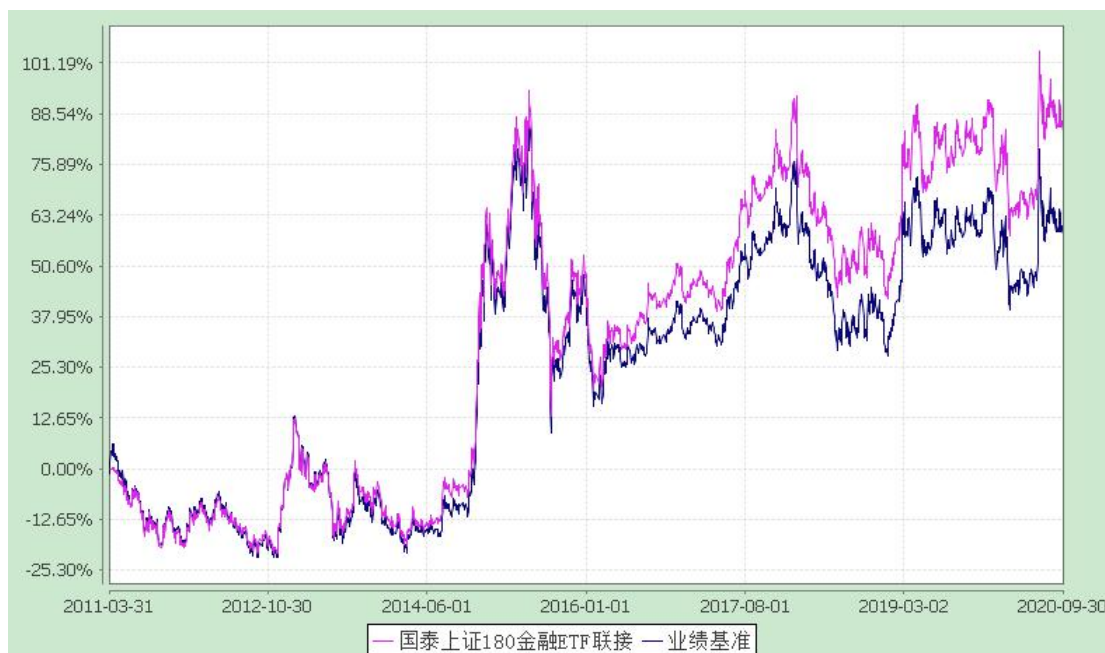
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.05%	1.88%	6.95%	1.93%	2.10%	-0.05%
过去六个月	13.09%	1.47%	10.13%	1.51%	2.96%	-0.04%
过去一年	3.54%	1.41%	0.60%	1.44%	2.94%	-0.03%
过去三年	10.12%	1.33%	3.07%	1.34%	7.05%	-0.01%
过去五年	44.04%	1.24%	28.31%	1.26%	15.73%	-0.02%
自基金合同生效起至今	84.45%	1.48%	58.55%	1.52%	25.90%	-0.04%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 3 月 31 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：本基金合同生效日为2011年3月31日，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		
艾小军	本基金的基金经理、国泰黄金ETF、国泰上证180金融ETF、国泰深证	2014-01-13	-	19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



	<p>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、国泰国证航天军工指数 (LOF)、国泰中证申万证券行业指数 (LOF)、国泰量化成长优选混合、国泰策略价值灵活配</p>			<p>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，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</p>
--	--	--	--	---

	<p>置混合、芯片 ETF、上证 5 年期国债 ETF、上证 10 年期国债 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监</p>			<p>混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 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 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任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 月至 2019 年 4 月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 月至 2019 年 3 月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，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）的基金经理，2019 年 5 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（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）的基金经理，2019 年 7 月起兼任上证 5 年期国债交易型开放式指</p>
--	--	--	--	---

					数证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。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

三季度在创业板注册制改革以及科创板推出一周年、科创板 50 指数正式推出等资本市场改革持续推进的背景下，市场风险偏好大幅提升，二季度末至 7 月中旬 A 股市场持续上扬，并创出年内新高。之后受新冠肺炎疫情持续蔓延，美国大选以及美国对华为的极限打压进而引起对 5G 建设低于预期的担忧等影响，包括 5G、消费电子等在内的半导体、通信板块持续回调，A 股市场在 3200 至 3400 区间震荡。受地缘政治影响，军队实战化训练加强，叠加补涨因素，军工行业表现突出。在海南离岛免税政策刺激下，免税主题持续走强。全季度来看，上证指数上涨 7.82%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 上涨 9.87%，沪深 300 指数上涨 10.17%，成长性中小盘股表征指数如中证 500 上涨 5.59%，板块上科技股占比较多的中小板指上涨 8.19%，创业板指上涨 5.6%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的休闲服务、军工、电气设备，涨幅分别为 32.97%、30.11%和 26.01%，表现落后的为通信、商业贸易、计算机，分别下跌了 8.10%、3.42%和 3.23%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2020 年第三季度的净值增长率为 9.05%，同期业绩比较基准收益率为 6.95%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度随着美国大选逐步明朗，大选期间的短期冲击将逐步消除，前期受到美国极限打压调整较多的半导体、通信等板块情绪有望修复；国内方面，十四五规划推进将对相关板块带来主题性的投资机会。随着秋冬季到来，新冠疫情二次冲击带来的政策对冲对整体市场流动性形成较为宽松的环境。受新冠疫情影响，得益于国内严格的防控措施，国内经济在全球经济体的吸引力更加凸显，有望带动外资加大 A 股资产的配置力度。

在中美科技竞争长期化的背景下，包括自主可控、国产替代有望带来包括半导体芯片、通信、计算机等行业的营收持续改善，相关领域公司的竞争力有望大幅提升。中长期我们仍然看好受益于中国经济结构转型的消费龙头，受益医疗支出加大所带动的生物医药医疗，5G 等新基建领域的半导体、通信、计算机以及军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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	11,386,181.01	1.25
	其中：股票	11,386,181.01	1.25
2	基金投资	845,568,543.20	92.79
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	53,935,622.45	5.92
8	其他各项资产	397,975.63	0.04
9	合计	911,288,322.29	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	上证 180 金融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	845,568,543.20	92.90

### 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	91,815.82	0.01
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	16,793.79	0.00
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	197,180.00	0.02
J	金融业	11,080,391.40	1.22
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	11,386,181.01	1.25

#### 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601318	中国平安	20,000	1,525,200.00	0.17
2	600036	招商银行	31,000	1,116,000.00	0.12
3	600030	中信证券	25,000	750,750.00	0.08
4	601166	兴业银行	37,000	596,810.00	0.07
5	601398	工商银行	104,000	511,680.00	0.06
6	600837	海通证券	29,000	410,350.00	0.05
7	601328	交通银行	82,000	372,280.00	0.04
8	601688	华泰证券	17,000	349,010.00	0.04
9	600016	民生银行	63,000	333,900.00	0.04
10	600000	浦发银行	35,000	328,650.00	0.04

#### 5.5 报告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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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（除“工商银行”、“华泰证券”、“交通银行”、“民生银行”、“兴业银行”、“招商银行”、“中信证券”公告自身或其分支机构违规外）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。

工商银行宁德、呼和浩特明泽等下属分行、支行由于迟报案件信息和违规允许保险公司人员驻点销售保险产品等原因分别受到当地银保监局罚款等监管处罚。

华泰证券公司本身、深圳红荔路证券营业部由于未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易和未审慎核查交易异常预警的关联客户，未及时上报重大异常行为等原因分别受到中国人民银行和当地证监局罚款、出具警示函等监管处罚。

交通银行漳州、长春亚泰等下属分行、支行由于单位银行结算账户撤销超期报备和办理无真实贸易背景票据业务等原因分别受到中国人民银行当地支行和当地银保监局警告、罚款等监管处罚。

民生银行济南、宁波等下属分行、支行由于票据业务内控管理不到位和保理业务办理不规范等原因分别受到当地银保监局罚款等监管处罚。



兴业银行宁波、烟台等下属分行、支行由于开发贷款管理不审慎、个人授信管理不到位和票据业务贸易背景审查不尽职、贷款业务检查不尽职等原因分别受到当地银保监局罚款等监管处罚。

招商银行金华、长春等下属分行、支行由于以信贷资金用作银行承兑汇票保证金，虚增存款和贷款贷后管理不到位、未有效监控贷款资金使用情况等原因分别受到当地银保监局罚款等监管处罚。

中信证券广州番禺万达广场证券营业部、北京紫竹院路证券营业部由于未及时披露公司重大事项，分别受到证监会广东、北京监管局责令改正等监管措施。

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。

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	128,099.73
2	应收证券清算款	10,992.02
3	应收股利	-
4	应收利息	4,845.48
5	应收申购款	254,038.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	397,975.63

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	870,663,581.49
报告期基金总申购份额	221,002,534.80
减：报告期基金总赎回份额	335,420,512.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	756,245,604.14

## § 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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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	2020年07月01日至2020年09月30日	200,852,408.32	-	-	200,852,408.32	26.56%
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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、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基金合同
- 2、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托管协议
- 3、关于核准国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的批复
- 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