



（上接B49版）

二、登记机构
名称:国泰基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道120号2层220室
办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉里中心406—19层
法定代表人:董勇
联系人:李怡

传真:(021)33081800
客服电话:400-888-888、(021)31089000
网址:www.guotai.com.cn

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号世纪金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号世纪金融中心19楼
负责人:俞卫锋
联系电话:(021)31358666
传真:(021)31358600

联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛
四、审计本基金的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴1818号展耀大厦20层09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号环球金融中心19楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)22328888
传真:(021)22328800
联系人:魏佳亮
经办注册会计师:李维特、魏佳亮

第四部分 基金的投资

四、基金的投资目标
本基金主要投资于智能汽车主题股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 投资范围

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(含中小板、创业板及其他依法发行、上市的新股),股指期货,股票期权,权证等权益类金融工具,债券(包括国债、中期票据、企业债、公司债、次级债,地方政府债,地方政府债资产支持证券,政府支持债券,金融债,可转换债券(含分离交易可转债),可交换债券,短期融资券,超短期融资券,央行票据),资产支持证券,债券回购,银行存款,货币市场工具等固定收益类金融工具,以及法律法规和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:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,投资于(基金合同)界定的智能汽车主题证券资产占非现金基金资产的比例不低于70%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法进行资产配置,力争实现基金资产的长期增值。基金管理人将根据基金的投资范围和资产配置比例规定,力求实现基金资产的增值。

第八部分 投资策略

本基金在投资运作中,淡化大类资产配置,侧重智能汽车主题下精选个股,以期实现基金资产的增值。

一、股票投资策略
随着技术的快速发展,传统汽车正在加速被智能时代,从需求方面来看,人们对安全、舒适、环保、智能的追求促使汽车向智能汽车转型升级;从供给方面来看,实施智能制造的智能化将使生产效率大幅提升,产品成本水平有望得到显著降低,能源、资源消耗和污染物的排放明显降低,传统汽车的人力成本也将得到降低,从而推动其在未来较长一段时期内,智能汽车将保持快速发展。

(一)智能汽车主题的定义
本基金所指的智能汽车是指具有感知、决策、控制功能,最终可实现无人驾驶的汽车及其相关的制造、服务以及基于智能汽车所构建的智能生态系统的总称,它包括汽车、新能源汽车、车联网、无人驾驶以及智能汽车相关服务等未来行业发展的长期发展方向。智能汽车主题涵盖相关产业链上下游不断更新,基金管理人将持续跟踪科技迭代及商业模式发展,对智能汽车主题所涉及领域进行更新调整。

第九部分 业绩比较基准

中证新能源汽车指数收益率×80%+中证综合指数收益率×20%

如果今后法律法规发生变化,或证券市场有其他代表性更强、更适合科学客观的业绩比较基准适用时,本基金管理人可以在充分听取基金份额持有人意见的基础上,根据审慎原则,经与托管人对原业绩比较基准进行相应调整,调整后的业绩比较基准经托管人确认后,报中国证监会备案,并履行适当程序,并在中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒介上公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 风险收益特征

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

第十一部分 基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事承诺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。
基金管理人及基金资产的托管人根据本基金合同约定,于2018年7月17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,保证基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日,本报告财务数据未经审计。

(一)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	1,041,621,042.68	88.91
	其中:股票	1,041,621,042.68	88.91
2	固定收益投资	11,918,055.49	1.02
	其中:债券	11,918,055.49	1.02
3	贵金属投资	-	-
4	银行存款及现金	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他各项金融资产	109,256,288.70	9.31
7	其他各项资产	1,511,345.08	0.13
8	合计	1,171,307,101.95	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	-	-
B	信息技术	-	-
C	制造业	1,041,442,863.75	92.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,905.85	0.01
E	交通运输业	-	-
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	25,800.94	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.44	0.01
O	农林牧渔、畜牧业和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
合计		1,041,621,042.68	92.84

(三)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	002050	三花智控	5,570,888	104,796,660.33	9.34
2	002466	天齐锂业	2,028,893	101,612,803.87	9.57
3	600885	宏发股份	3,338,843	99,908,126.56	8.90
4	601799	华孚实业	1,656,816	99,226,710.24	8.84
5	601799	华孚实业	950,793	119,475,293.71	8.15
6	300124	汇川技术	2,756,997	88,770,504.54	7.91
7	300568	雁鼎股份	1,845,756	50,030,086.96	4.50
8	300377	新宙斯	2,588,432	68,342,141.48	6.18
9	600666	宇通客车	3,400,012	65,262,208.28	5.82
10	002790	天材科技	1,688,833	65,087,623.82	5.80

(四)报告期末按品种分类的股票投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,503,510.00	0.40
4	企业债券	4,503,510.00	0.40
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债(含分离交易可转债)	7,417,505.49	0.66
8	银行存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,918,055.49	1.06

(五)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	115589	浦发转债	52,560	5,044,708.80	0.43
2	010802	国债1802	44,340	4,509,151.00	0.40
3	123009	景顺转债	18,327	2,372,726.69	0.21

(六)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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

(七)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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末持有金融衍生品。

(八)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。

基金本报告期末未持有权益

(九)报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
本基金本报告期末未持有股指期货。
2.本基金股指期货投资的投资策略
本基金本报告期末未持有股指期货。若本基金投资股指期货,将根据中国证监会的相关规定,以套期保值为目的,有选择性地投资于股指期货,套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的品种,并选择股指期货的定价模型对其合理的估值水平。
本基金管理人将充分考量股指期货的流动性、波动性及风险特征,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。
法律法规对于基金股指期货投资的投资范围有规定的,本基金将按照法律法规的规定执行。
(十)报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
(十一)投资组合报告附注
1.本基金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前一年受到公开谴责、处罚的情况。
2.本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。
3.其他资产构成
序号

基金本报告期末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	002050	三花智控	5,570,888	104,796,660.33	9.34
2	002466	天齐锂业	2,028,893	101,612,803.87	9.57
3	600885	宏发股份	3,338,843	99,908,126.56	8.90
4	601799	华孚实业	1,656,816	99,226,710.24	8.84
5	601799	华孚实业	950,793	119,475,293.71	8.15
6	300124	汇川技术	2,756,997	88,770,504.54	7.91
7	300568	雁鼎股份	1,845,756	50,030,086.96	4.50
8	300377	新宙斯	2,588,432	68,342,141.48	6.18
9	600666	宇通客车	3,400,012	65,262,208.28	5.82
10	002790	天材科技	1,688,833	65,087,623.82	5.80

(四)报告期末按品种分类的股票投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,503,510.00	0.40
4	企业债券	4,503,510.00	0.40
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债(含分离交易可转债)	7,417,505.49	0.66
8	银行存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,918,055.49	1.06

(五)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	115589	浦发转债	52,560	5,044,708.80	0.43
2	010802	国债1802	44,340	4,509,151.00	0.40
3	123009	景顺转债	18,327	2,372,726.69	0.21

(六)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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

(七)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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末持有金融衍生品。

(八)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。

基金本报告期末未持有权益

(九)报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
本基金本报告期末未持有股指期货。
2.本基金股指期货投资的投资策略
本基金本报告期末未持有股指期货。若本基金投资股指期货,将根据中国证监会的相关规定,以套期保值为目的,有选择性地投资于股指期货,套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的品种,并选择股指期货的定价模型对其合理的估值水平。
本基金管理人将充分考量股指期货的流动性、波动性及风险特征,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。
法律法规对于基金股指期货投资的投资范围有规定的,本基金将按照法律法规的规定执行。
(十)报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
(十一)投资组合报告附注
1.本基金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前一年受到公开谴责、处罚的情况。
2.本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。
3.其他资产构成
序号

基金本报告期末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	002050	三花智控	5,570,888	104,796,660.33	9.34
2	002466	天齐锂业	2,028,893	101,612,803.87	9.57
3	600885	宏发股份	3,338,843	99,908,126.56	8.90
4	601799	华孚实业	1,656,816	99,226,710.24	8.84
5	601799	华孚实业	950,793	119,475,293.71	8.15
6	300124	汇川技术	2,756,997	88,770,504.54	7.91
7	300568	雁鼎股份	1,845,756	50,030,086.96	4.50
8	300377	新宙斯	2,588,432	68,342,141.48	6.18
9	600666	宇通客车	3,400,012	65,262,208.28	5.82
10	002790	天材科技	1,688,833	65,087,623.82	5.80

(四)报告期末按品种分类的股票投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,503,510.00	0.40
4	企业债券	4,503,510.00	0.40
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债(含分离交易可转债)	7,417,505.49	0.66
8	银行存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,918,055.49	1.06

(五)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	115589	浦发转债	52,560	5,044,708.80	0.43
2	010802	国债1802	44,340	4,509,151.00	0.40
3	123009	景顺转债	18,327	2,372,726.69	0.21

(六)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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

(七)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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末持有金融衍生品。

(八)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。

基金本报告期末未持有权益

(九)报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
本基金本报告期末未持有股指期货。
2.本基金股指期货投资的投资策略
本基金本报告期末未持有股指期货。若本基金投资股指期货,将根据中国证监会的相关规定,以套期保值为目的,有选择性地投资于股指期货,套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的品种,并选择股指期货的定价模型对其合理的估值水平。
本基金管理人将充分考量股指期货的流动性、波动性及风险特征,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。
法律法规对于基金股指期货投资的投资范围有规定的,本基金将按照法律法规的规定执行。
(十)报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
(十一)投资组合报告附注
1.本基金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前一年受到公开谴责、处罚的情况。
2.本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。
3.其他资产构成
序号

基金本报告期末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	002050	三花智控	5,570,888	104,796,660.33	9.34
2	002466	天齐锂业	2,028,893	101,612,803.87	9.57
3	600885	宏发股份	3,338,843	99,908,126.56	8.90
4	601799	华孚实业	1,656,816	99,226,710.24	8.84
5	601799	华孚实业	950,793	119,475,293.71	8.15
6	300124	汇川技术	2,756,997	88,770,504.54	7.91
7	300568	雁鼎股份	1,845,756	50,030,086.96	4.50
8	300377	新宙斯	2,588,432	68,342,141.48	6.18
9	600666	宇通客车	3,400,012	65,262,208.28	5.82
10	002790	天材科技	1,688,833	65,087,623.82	5.80

(四)报告期末按品种分类的股票投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,503,510.00	0.40
4	企业债券	4,503,510.00	0.40
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债(含分离交易可转债)	7,417,505.49	0.66
8	银行存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,918,055.49	1.06

(五)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	115589	浦发转债	52,560	5,044,708.80	0.43
2	010802	国债1802	44,340	4,509,151.00	0.40
3	123009	景顺转债	18,327	2,372,726.69	0.21

(六)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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

(七)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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末持有金融衍生品。

(八)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。

基金本报告期末未持有权益

(九)报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
本基金本报告期末未持有股指期货。
2.本基金股指期货投资的投资策略
本基金本报告期末未持有股指期货。若本基金投资股指期货,将根据中国证监会的相关规定,以套期保值为目的,有选择性地投资于股指期货,套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的品种,并选择股指期货的定价模型对其合理的估值水平。
本基金管理人将充分考量股指期货的流动性、波动性及风险特征,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。
法律法规对于基金股指期货投资的投资范围有规定的,本基金将按照法律法规的规定执行。
(十)报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
(十一)投资组合报告附注
1.本基金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前一年受到公开谴责、处罚的情况。
2.本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。
3.其他资产构成
序号

基金本报告期末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

<