

# 国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起 式联接基金

## 2020 年第 2 季度报告

### 2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年七月二十一日

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 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 4 月 3 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰中证新能源汽车 ETF 联接                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 009067                                                                                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2020 年 4 月 3 日                                                                                                                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 60,624,450.53 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、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>略，即按照标的指数的成份股构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>本基金将综合考虑科创板整体和个股流动性、科创板股票交易制度特点、市场风险偏好等因素适度投资于科创板股票。</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</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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><b>6、股指期货投资策略</b></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><b>7、融资与转融通证券出借投资策略</b></p> <p>本基金在参与融资业务时，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。本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。</p> <p>为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证新能源汽车指数收益率*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，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  | 上海浦东发展银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰中证新能源汽车 ETF 联接 A | 国泰中证新能源汽车 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 009067             | 009068             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 23,345,416.95 份    | 37,279,033.58 份    |

### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159806                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2020 年 3 月 10 日         |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                 |
| 上市日期         | 2020 年 3 月 20 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      | 上海浦东发展银行股份有限公司          |

### 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、股指期货投资策略；5、融资与转融通证券出借投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证新能源汽车指数收益率                                                |
| 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。                |

## §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<br>(2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）-2020 年 6 月 |
|--------|--------------------------------------------|

|                | 30 日)                 |                       |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 国泰中证新能源汽车<br>ETF 联接 A | 国泰中证新能源汽车<br>ETF 联接 C |
| 1.本期已实现收益      | 215,124.46            | 239,264.00            |
| 2.本期利润         | 3,329,001.08          | 3,678,063.02          |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2298                | 0.3104                |
| 4.期末基金资产净值     | 28,086,384.79         | 44,824,509.75         |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2031                | 1.2024                |

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、国泰中证新能源汽车 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    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 20.31%     | 1.21%         | 22.81%         | 1.81%                 | -2.50% | -0.60% |

##### 2、国泰中证新能源汽车 ETF 联接 C：

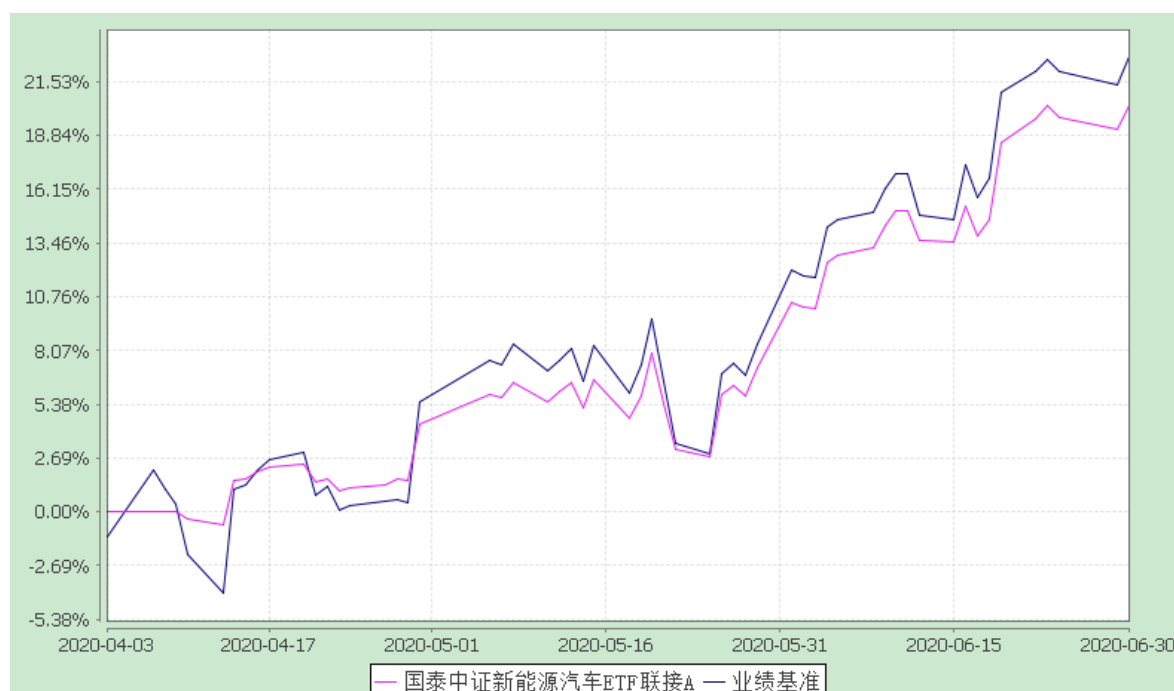
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 20.24%     | 1.21%         | 22.81%         | 1.81%                 | -2.57% | -0.60% |

#### 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

国泰中证新能源汽车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

(2020 年 4 月 3 日至 2020 年 6 月 30 日)

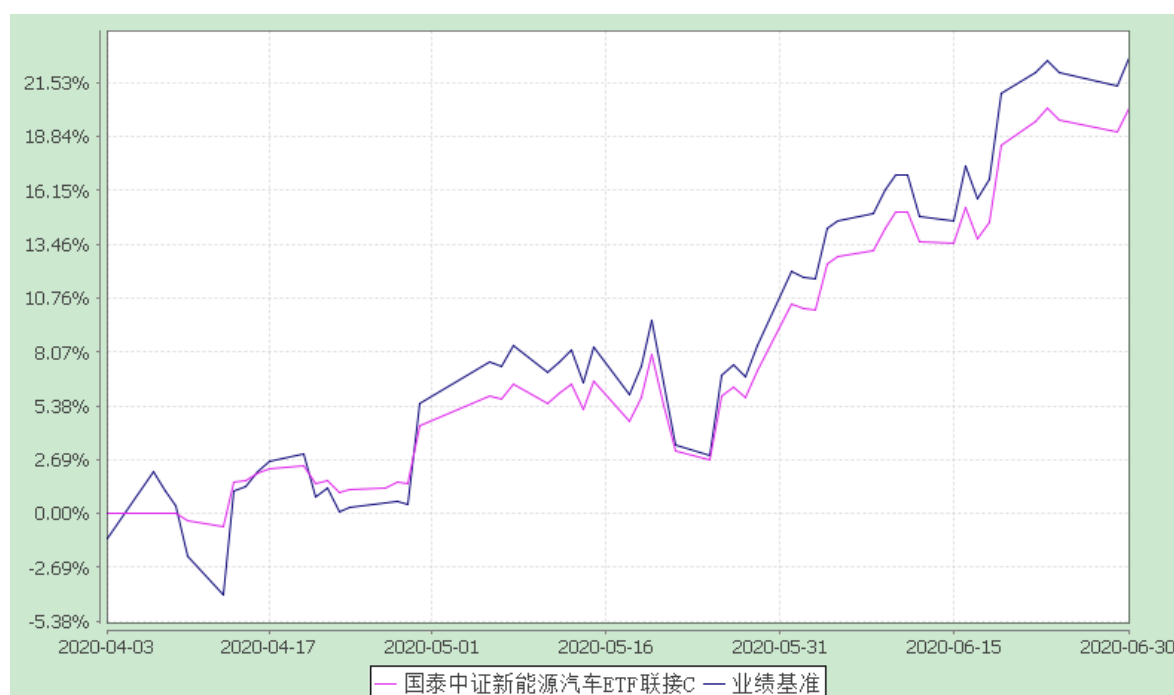
# 1. 国泰中证新能源汽车 ETF 联接 A:



注: (1)本基金合同生效日为 2020 年 4 月 3 日, 截止到 2020 年 6 月 30 日, 本基金成立尚未满一年。

(2)本基金的建仓期为 6 个月, 截止本报告期末, 本基金尚处于建仓期内, 将在六个月建仓期结束时, 确保各项资产配置比例符合合同约定。

# 2. 国泰中证新能源汽车 ETF 联接 C:



注：(1)本基金合同生效日为 2020 年 4 月 3 日，截止到 2020 年 6 月 30 日，本基金成立尚未满一年。

(2)本基金的建仓期为 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在六个月建仓期结束时，确保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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 徐成城 | 本基金的基金经理、国泰创业板指数（LOF）、国泰国证医药卫生行业指数分级、国泰国证食品饮料行业指数分级、国泰黄金 ETF、国泰黄金 ETF 联接、国泰国证房地产行业指数分级、国 | 2020-04-03  | -    | 14 年   | 硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月起任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数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 |

|  |                                                                                                                                                         |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰中证生物医药 ETF、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证钢铁 ETF 联接、国泰中证全指家用电器 ETF 联接的基金经理 |  |  |  | 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 2 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月起兼任国泰中证新能源汽车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全指家用电器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。 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

上半年随着新冠疫情在全球肆虐，世界经济陷入至 2008 年金融危机以来最大的衰退，全球各主要经济体的股市均出现了不同程度的下跌。由于防疫措施得力，新冠疫情在我国得到较好的控制，二季度我国率先开启了经济复苏模式，社会快速恢复生产和消费，A 股指数也随着经济复苏而持续上行。由于全球疫情期间 A 股表现出了强大的韧性，吸引了全球资金持续增持国内股票资产，北上资金上半年流入近 1200 亿元。在相对宽松的流动性的助力下，四月初至六月底，上证指数上涨 8.52%，沪深 300 指数上涨 12.96%，创业板指数更是大涨超过 30%，成为全球二季度表现

最出色的主要指数之一。分行业来看，申万一级行业中，受益于疫情期间对各种药物和医疗设备的需求增加，医药生物行业延续了一季度的强势，二季度涨幅近 30%；而具有较强避险属性的食品饮料行业，二季度股票指数也获得了近 29% 的上涨；受到疫情影响较少，且未来景气度持续上行的科技行业，二季度同样表现出色，电子和计算机行业的二季度涨幅分别在 30% 和 17% 左右；由于疫情期间过度悲观和二季度“报复性消费”的出现，休闲服务行业成为申万一级行业里二季度上涨速度最快的行业，涨幅达到了 60% 以上；相对而言，银行、采掘以及房地产相关行业二季度表现较弱，但这些行业当前较低的估值和业绩的边际改善，为未来的估值修复提供了有利条件。

作为完全跟踪标的指数的被动型基金，本基金避免了不必要的主动操作，减少了交易冲击成本，并通过精细化管理确保基金组合与指数权重基本一致。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰中证新能源汽车 ETF 联接 A 类自 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日的净值增长率为 20.31%，同期业绩比较基准收益率为 22.81%。

国泰中证新能源汽车 ETF 联接 C 类自 2020 年 4 月 3 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日的净值增长率为 20.24%，同期业绩比较基准收益率为 22.81%。

#### 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 2020 年全年，尽管二季度我国防控成绩斐然，但全球新冠疫情依然严峻，输入性病例屡见不鲜。短期来看，我们认为新冠疫情的防控仍是全球经济走势的主要影响因素，但长远来讲，新冠疫情终究只是短期扰动。就全球市场而言，除中国以外的大多数经济体的央行都进行大规模的流动性宽松，而得益于前期对疫情的有效管控和较为独立的货币政策，我国仍保留有不少的政策宽松空间，这将会提高人民币资产的吸引力。

新能源汽车行业是上半年较为热门的投资主题，全球汽车产业在近十年都经历了从无到有的电动化浪潮，我国的新能源汽车产业在政策的大力支持下已初步具备全球竞争力。当前，新能源汽车产业加速趋势依然明显，行业发展空间仍然巨大。

一方面，从政策层面上看，国内双积分政策、退补暂缓和欧洲碳排放方案等措施，都会驱动新能源汽车加速发展，而特斯拉、大众 MEB 平台等优质车型的陆续推出，将从供给侧来创造新需求；另一方面，从发展阶段来看，新能源汽车行业仍处于爆发初期，当前渗透率低，未来 10 年空间巨大。其中动力电池、电机电控等特有零部件、上游材料等需求预料将持续增长；最后，从投资的角度来看，围绕龙头供应链中具备全球竞争力的国内企业进行资产配置，更有望获得超额收益。投资者可积极利用国泰中证新能源车 ETF 联接基金，积极把握行业投资机会。

#### 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              | 462,690.00    | 0.55         |
|    | 其中：股票             | 462,690.00    | 0.55         |
| 2  | 基金投资              | 65,739,054.10 | 78.09        |
| 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      | 12,127,634.83 | 14.41        |
| 8  | 其他各项资产            | 5,859,395.35  | 6.96         |
| 9  | 合计                | 84,188,774.28 | 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 | 国泰中证新能源汽车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 | 65,739,054.10 | 90.16 |
|---|-------------------------|-----|--------|------------|---------------|-------|

### 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              | 462,690.00 | 0.63         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | -          | -            |
| F  | 批发和零售业           | -          | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -          | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -          | -            |
| J  | 金融业              | -          | -            |
| K  | 房地产业             | -          | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -          | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -          | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -          | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -          | -            |
| P  | 教育               | -          | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -          | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -          | -            |
| S  | 综合               | -          | -            |
|    | 合计               | 462,690.00 | 0.63         |

### 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  | 300750 | 宁德时代 | 2,000 | 348,720.00 | 0.48         |

|   |        |      |       |            |      |
|---|--------|------|-------|------------|------|
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 3,000 | 113,970.00 | 0.16 |
|---|--------|------|-------|------------|------|

#### 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   | 21,213.49 |
| 2  | 应收证券清算款 | 43,452.75 |
| 3  | 应收股利    | -         |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 1,663.24     |
| 5 | 应收申购款 | 5,643,721.37 |
| 6 | 其他应收款 | 149,344.50   |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 5,859,395.35 |

#### 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

| 项目                          | 国泰中证新能源汽车<br>ETF联接A | 国泰中证新能源汽车<br>ETF联接C |
|-----------------------------|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日基金份额总额               | 10,446,816.64       | 313,768.27          |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总<br>申购份额   | 16,841,664.53       | 67,526,952.91       |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基<br>金总赎回份额 | 3,943,064.22        | 30,561,687.60       |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆<br>分变动份额  | -                   | -                   |
| 本报告期期末基金份额总额                | 23,345,416.95       | 37,279,033.58       |

### §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

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额       | 10,000,450.05 |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额   | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额   | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,450.05 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 16.50         |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）       | 交易金额（元）       | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|------|
| 1  | 基金认购 | 2020-04-01 | 10,000,450.05 | 10,001,000.00 | -    |
| 合计 |      |            | 10,000,450.05 | 10,001,000.00 |      |

注：基金管理人国泰基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托直销柜台办理，认购费为1,000元。

## §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   | 10,000,450.05 | 16.50%               | 10,000,450.05 | 16.50%               | 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          | 10,000,450.05 | 16.50%               | 10,000,450.05 | 16.50%               | -              |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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<br>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 4 月 3 日         | 10,000 | -    | -    | 10,000,450. | 16.50% |

|                                                               |  |                      |              |  |  |    |  |
|---------------------------------------------------------------|--|----------------------|--------------|--|--|----|--|
|                                                               |  | 至 2020 年 6 月 17<br>日 | , 450.0<br>5 |  |  | 05 |  |
| 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。 |  |                      |              |  |  |    |  |

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、国泰中证新能源汽车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
- 2、国泰中证新能源汽车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
- 3、关于准予国泰中证新能源汽车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
- 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

### 10.2 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。

### 10.3 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  
二〇二〇年七月二十一日