

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接 基金

(原国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金)

2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 1 月 19 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。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次大会投票表决起止时间为自 2020 年 9 月 28 日起至 2020 年 10 月 28 日 17:00 止，计票日为 2020 年 10 月 29 日。会议审议了《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，经统计，同意本次会议议案的基金份额持有人（或其代理人）所代表的国泰 TMT50 份额、TMT50A 份额、TMT50B 份额分别占出具表决意见的基金份额持有人（或其代理人）所持国泰 TMT50 份额、TMT50A 份额、TMT50B 份额各自类别表决权的三分之二以上，符合《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。决议内容如下：“根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，同意对国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金实施转型，内容包括取消基金份额上市交易及分级运作机制、调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费用、收益分配方式、变更基金份额类别设置，更名为“国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金”、并修订《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》。为实施国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型方案，同意授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰深

证 TMT50 指数分级证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》等法律文件进行修改和补充，并根据《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金实施转型。”根据《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》，并据此编制《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》。自 2020 年 12 月 3 日起，《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》生效，原《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金托管协议》同日起失效。详情可查阅本基金管理人发布的《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》、《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》等公告。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金简称	国泰中证计算机主题 ETF 联接
基金主代码	160224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 3 日
报告期末基金份额总额	491,273,743.77 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	本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为主要投资标的，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。 1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；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	中证计算机主题指数收益率*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	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国泰中证计算机主题 ETF 联接 A	国泰中证计算机主题 ETF 联接 C
下属两级基金的交易代码	160224	010210
报告期末下属两级基金的份额总额	491,255,713.80 份	18,029.97 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512720
基金运作方式	交易型开放式

基金合同生效日	2019 年 7 月 11 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 8 月 16 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	中国农业银行股份有限公司

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、可转换债券投资策略； 4、资产支持证券投资策略； 5、股指期货投资策略； 6、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证计算机主题指数收益率
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。

2.2 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

基金简称	国泰深证 TMT50 指数分级
场内简称	国泰 TMT
基金主代码	160224
交易代码	160224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日
报告期末基金份额总额	519,704,838.78 份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的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。 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。 3、股指期货投资策略 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杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。		
业绩比较基准	深证 TMT50 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金虽为股票型指数基金,但由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
基金管理人	国泰基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	国泰 TMT	TMTA	TMTB
下属分级基金的场内简称	国泰 TMT	TMTA	TMTB
下属分级基金的交易代码	160224	150215	150216
报告期末下属分级基金	476,305,288.78	21,699,775.00	21,699,775.00 份

的份额总额	份	份	
-------	---	---	--

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 12 月 3 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日)	
	国泰中证计算机主题 ETF 联接 A	国泰中证计算机主题 ETF 联接 C
1.本期已实现收益	95,073,978.80	-10.99
2.本期利润	-4,307,047.96	461.91
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0086	0.0537
4.期末基金资产净值	462,534,049.66	16,971.91
5.期末基金份额净值	0.9415	0.9413

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）本报告期自 2020 年 12 月 3 日至 2020 年 12 月 31 日。

3.1.2 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 2 日)
1.本期已实现收益	10,585,443.62

2.本期利润	24,631,611.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0389
4.期末基金资产净值	492,850,759.67
5.期末基金份额净值	0.9483

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）本报告期自 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期：2020年12月3日-2020年12月31日）

3.2.1.1 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. 国泰中证计算机主题 ETF 联接 A:

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 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
自基金合 同生效起 至今	-0.72%	1.30%	0.41%	1.33%	-1.13%	-0.03 %

2. 国泰中证计算机主题 ETF 联接 C:

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 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
2020 年 12 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日	-0.13%	1.36%	-0.59%	1.38%	0.46%	-0.02 %

3.2.1.2 自基金转型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

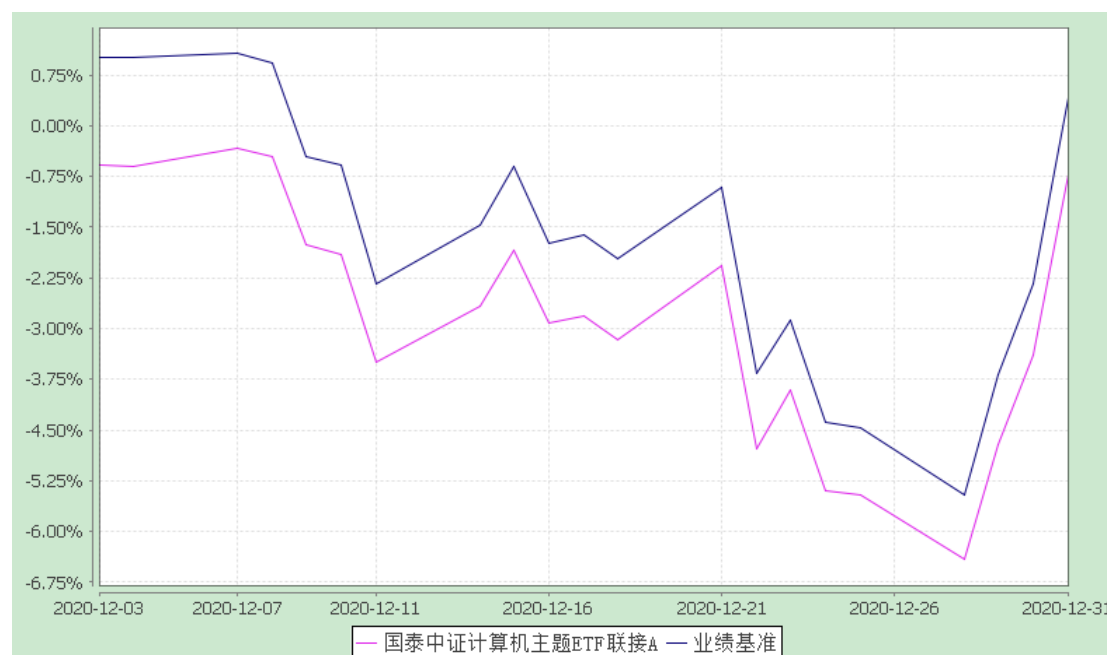
收益率变动的比较

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

(2020 年 12 月 3 日至 2020 年 12 月 31 日)

1、国泰中证计算机主题 ETF 联接 A

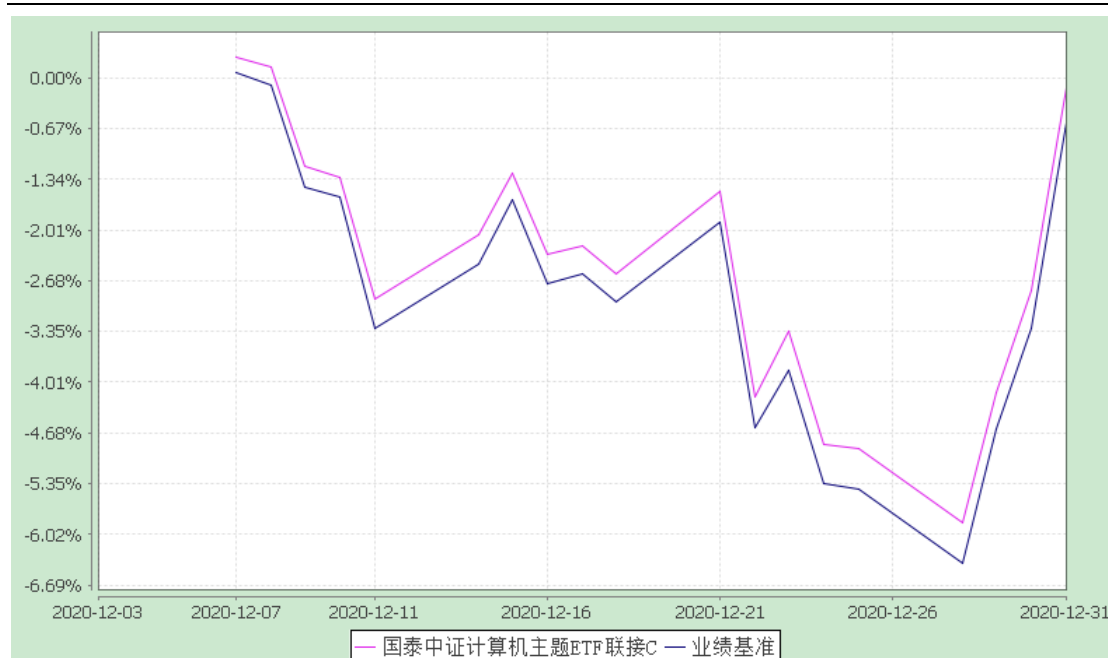


注：（1）本基金合同生效日为 2020 年 12 月 3 日，截止至 2020 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年。

（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。

（3）自 2020 年 12 月 3 日起国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型为国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2、国泰中证计算机主题 ETF 联接 C



注：（1）本基金的合同生效日为 2020 年 12 月 3 日，截止至 2020 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年。自 2020 年 12 月 7 日起，C 类基金份额净值和基金份额累计净值开始计算。

（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。

（3）自 2020 年 12 月 3 日起国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型为国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.2.2 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

（报告期：2020年10月1日-2020年12月2日）

3.2.2.1 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
2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日	3.83%	1.26%	4.40%	1.40%	-0.57%	-0.14%
2020 年 7 月 1 日至 2020	6.50%	1.72%	6.08%	1.79%	0.42%	-0.07%

年 12 月 2 日						
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日	33.35%	2.07%	32.03%	2.12%	1.32%	-0.05%
2018 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日	27.51%	1.91%	26.53%	1.93%	0.98%	-0.02%
2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日	16.56%	1.81%	15.82%	1.77%	0.74%	0.04%
自合同生效日至 2020 年 12 月 2 日	5.64%	2.12%	22.18%	1.99%	-16.54%	0.13%

3.2.2.2 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

国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

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
(2015 年 3 月 26 日至 2020 年 12 月 2 日)



注：(1)本基金的合同生效日为2015年3月26日。本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定；

(2)自2020年12月3日起国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型为国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§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、国泰上证180金融ETF联接、国泰上证180金融ETF、国泰黄金ETF、国泰中证军工ETF、国泰中证全指证券公司ETF、国泰国证	2020-12-03	-	20 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，2015 年 3 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 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

	航天军工指数（LOF）、 国泰中证申万证券行业指数（LOF）、 国泰策略价值灵活配置混合、 国泰黄金 ETF 联接、 芯片 ETF、 国泰量化成长优选混合、 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				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
--	---	--	--	--	--

	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				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 月至 2021 年 1 月任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月起兼任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，2020 年 12 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）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

四季度临近年底，十九届五中全会关于十四五规划和 2035 年远景目标的建议，为资本市场指明了中长期我国经济发展的方向，受中欧投资协定预计年底签订的预期，包括新能源汽车、光伏板块持续走强；在国内外疫苗陆续获得注册的利好预期下，疫情受损板块得以修复；临近年底，市场对于货币宽松政策退出的预期逐步得到修正，A 股市场震荡向上。结构上仍然维持分化，包括新能源汽车、光伏在内的能源革命主题，以及有色金属、化工等疫情受损板块表现较强，受益国内经济强劲复苏对于银行让利的担忧缓解，银行走出了一波估值修复行情。在权益爆款基金迭出的背景下，包括白酒、家电等消费板块屡创新高。科技领域，受特朗普政府对中国部分公司的无底线极限打压，整体走弱。

全季度来看，上证指数上涨 7.92%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 上涨 12.63%，沪深 300 指数上涨 13.6%，成长性中小盘股表征指数如中证 500 上涨 2.82%，板块上科技股占比较多的创业板指上涨 15.2%，科创板 50 下跌 1.82%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的有色金属、电气设备、食品饮料，涨幅分别为 30.31%、29.73%和 25.73%，表现落后的为商业贸易、传媒、通信，分别下跌了 10.56%、9.61%和 7.01%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰深证 TMT50 指数分级自 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日的净值增长率为 3.83%，同期业绩比较基准收益率为 4.40%。

国泰中证计算机主题 ETF 联接 A 类自 2020 年 12 月 3 日至 2020 年 12 月 31 日的净值增长率为-0.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

国泰中证计算机主题 ETF 联接 C 类自 2020 年 12 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日的净值增长率为-0.13%，同期业绩比较基准收益率为-0.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年是十四五的开局之年，虽然疫苗已陆续获批，但全球来看新冠疫情仍存在较大的不确定性，一季度预计货币环境仍然保持合理宽松；随着美国新政

府上台，预计中美关系将在一定程度上得到缓和。

总体而言我们对一季度行情保持乐观，结构上建议重点关注行业高景气度的军工；受益中欧投资协定关于碳达峰和碳中和目标的新能源汽车、光伏、风电。科技方面，建议关注调整幅度和空间均较大的半导体芯片、通信、计算机等板块。

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 国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期：2020年12月3日-2020年12月31日）

5.1.1 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	1,742,173.42	0.37
	其中：股票	1,742,173.42	0.37
2	基金投资	437,360,000.00	93.30
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	28,312,302.54	6.04
8	其他各项资产	1,374,560.39	0.29
9	合计	468,789,036.35	100.00

5.1.2 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	国泰中证计算机主题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	437,360,000.00	94.55

5.1.3 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	1,609,921.02	0.35
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,958.64	0.01
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	62,972.16	0.01
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	1,742,173.42	0.38

5.1.4 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	300866	安克创新	4,623	722,020.14	0.16
2	300999	金龙鱼	2,438	215,251.02	0.05
3	300898	熊猫乳品	4,457	210,994.38	0.05
4	300896	爱美客	171	103,174.56	0.02
5	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
6	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.01
7	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
8	300900	广联航空	879	29,147.64	0.01
9	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
10	300868	杰美特	588	25,448.64	0.01

5.1.5 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。

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 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。

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“熊猫乳品”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。

熊猫乳品公司本身因 2020 年 10 月 29 日，收到与收益相关的政府补贴 900.00 万元，占公司最近一个会计年度经审计归属于上市公司股东的净利润的 13.51%，但公司未及时履行信息披露义务，直至 2020 年 11 月 25 日才披露《关于公司获得政府补贴的公告》等原因，受到深圳证券交易所监管关注等监管措施。

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。

5.1.12.2 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。

5.1.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	85,479.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,559.75
5	应收申购款	1,282,520.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,374,560.39

5.1.12.4 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。

5.1.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	300866	安克创新	722,020.14	0.16	新股锁定
2	300999	金龙鱼	215,251.02	0.05	新股锁定
3	300896	爱美客	103,174.56	0.02	新股锁定
4	300867	圣元环保	47,891.06	0.01	新股锁定
5	300872	天阳科技	32,958.64	0.01	新股锁定
6	300870	欧陆通	31,390.26	0.01	新股锁定
7	300900	广联航空	29,147.64	0.01	新股锁定
8	300877	金春股份	28,933.65	0.01	新股锁定
9	300868	杰美特	25,448.64	0.01	新股锁定
10	300898	熊猫乳品	16,382.88	0.00	新股锁定

5.2 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

(报告期：2020年10月1日-2020年12月2日)

5.2.1 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	455,303,952.90	90.87
	其中：股票	455,303,952.90	90.87
2	固定收益投资	322,497.99	0.06
	其中：债券	322,497.99	0.06
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	44,620,310.23	8.91
7	其他各项资产	795,838.11	0.16
8	合计	501,042,599.23	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 积极投资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	1,873,090.21	0.39
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	16,477.76	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	22,501.16	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,217.41	0.01
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	161,988.54	0.03
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	2,124,275.08	0.43

5.2.2.2 指数投资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	323,946,912.44	65.74
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	82,117,228.74	16.66
J	金融业	6,684,960.00	1.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	25,248,608.22	5.12
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	15,181,968.42	3.08
S	综合	-	-
	合计	453,179,677.82	91.95

5.2.3 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

5.2.3.1 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

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	002415	海康威视	765,070	34,298,088.10	6.96
2	002475	立讯精密	576,081	29,725,779.60	6.03
3	000725	京东方 A	4,850,683	27,794,413.59	5.64
4	002027	分众传媒	2,423,091	25,248,608.22	5.12
5	000100	TCL 科技	2,609,452	20,901,710.52	4.24
6	000063	中兴通讯	555,612	19,713,113.76	4.00
7	002241	歌尔股份	475,020	17,618,491.80	3.57
8	300014	亿纬锂能	267,566	16,637,253.88	3.38
9	002230	科大讯飞	350,243	13,631,457.56	2.77
10	002410	广联达	204,692	13,489,202.80	2.74

5.2.3.2 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

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	300866	安克创新	4,623	786,603.45	0.16
2	300898	熊猫乳品	4,953	280,981.29	0.06
3	300999	金龙鱼	2,438	140,696.98	0.03
4	300912	凯龙高科	5,117	90,161.54	0.02
5	300913	兆龙互连	6,300	83,223.00	0.02

5.2.4 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	-	-
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）	322,497.99	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	322,497.99	0.07

5.2.5 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	128136	立讯转债	2,601	322,497.99	0.07

5.2.6 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。

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	85,479.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	177,048.51
5	应收申购款	533,309.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	795,838.11

5.2.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限 情况说明
1	300866	安克创新	786,603.45	0.16	新股锁定
2	300898	熊猫乳品	20,291.36	0.00	新股锁定
3	300999	金龙鱼	140,696.98	0.03	新股锁定
4	300912	凯龙高科	90,161.54	0.02	网下中签
5	300913	兆龙互连	83,223.00	0.02	网下中签

§6 开放式基金份额变动

6.1 国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：份

项目	国泰中证计算机主题ETF联接A	国泰中证计算机主题ETF联接C
基金合同生效日基金份额总额	519,704,838.78	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	52,276,289.49	18,029.97
减：基金合同生效日起至报告期期	80,725,414.47	-

末基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	491,255,713.80	18,029.97

6.2 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

单位：份

项目	国泰TMT	TMTA	TMTB
本报告期期初基金份额总额	513,415,120.77	9,009,437.00	9,009,437.00
报告期期间基金总申购份额	739,664,276.07	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	751,393,432.06	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-25,380,676.00	12,690,338.00	12,690,338.00
本报告期期末基金份额总额	476,305,288.78	21,699,775.00	21,699,775.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	国泰中证计算机主题ETF 联接A	国泰中证计算机主题 ETF联接C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	26,772,339.00	-
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	26,772,339.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.45	-

7.1.2 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	强增折算	2020-12-04	26,772,321.00	-	-
合计			26,772,321.00	-	

7.2 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	国泰 TMT	TMTA	TMTB
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	-
报告期期间买入/申购总份额	26,772,338.00	13,386,160.00	13,386,160.00
报告期期间卖出/赎回总份额	-26,772,320.00	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	18.00	13,386,160.00	13,386,160.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	2.58	2.58

7.2.2 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	申购 TMT 50	2020-10-14	10.00	9.69	-
2	申购 TMT 50	2020-10-22	26,772,328.00	24,999,999.89	-
3	强减基金 TMT 50 (拆分)	2020-10-23	26,772,320.00	-	-
4	强增基金 TMT A (拆分)	2020-10-23	13,386,160.00	-	-
5	强增基金 TMT B (拆分)	2020-10-23	13,386,160.00	-	-
6	强减基金 TMT A (折算)	2020-12-04	13,386,160.00	-	-
7	强减基金 TMT B (折算)	2020-12-04	13,386,160.00	-	-
合计			107,089,298.00	25,000,009.58	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次大会投票表决起止时间为自 2020 年 9 月 28 日起至 2020 年 10 月 28 日 17:00 止，计票日为 2020 年 10 月 29 日。会议审议了《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，经统计，同意本次会议议案的基金份额持有人（或其代理人）所代表的国泰 TMT50 份额、TMT50A 份额、TMT50B 份额分别占出具表决意见的基金份额持有人（或其代理人）所持国泰 TMT50 份额、TMT50A 份额、TMT50B 份额各自类别表决权的三分之二以上，符合《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。决议内容如下：“根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，同意对国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金实施转型，内容包括取消基金份额上市交易及分级运作机制、调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费用、收益分配方式、变更基金份额类别设置，更名为“国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金”、并修订《国泰深证 TMT50 指数分

级证券投资基金基金合同》。为实施国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型方案，同意授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》等法律文件进行修改和补充，并根据《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金实施转型。”根据《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》，并据此编制《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》。自 2020 年 12 月 3 日起，《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》生效，原《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金托管协议》同日起失效。详情可查阅本基金管理人发布的《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》、《关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》等公告。

99 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
- 2、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 3、关于准予国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金变更注册的批复
- 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

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。

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
二〇二一年一月二十二日