

# 国泰国证房地产行业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。

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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，本基金管理人制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。根据方案安排，房地产 A 份额和房地产 B 份额的最后交易日为 2020 年 12 月 31 日，终止上市日为 2021 年 1 月 4 日。基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日，对该日登记在册的房地产 A 份额和房地产 B 份额办理基金份额折算，将房地产 A 份额、房地产 B 份额按照各自的基金份额净值折算成场内国泰房地产份额。《国泰国证房地产行业指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金名称于 2021 年 1 月 1 日起变更为“国泰国证房地产行业指数证券投资基金”，场外简称由“国泰国证房地产行业指数分级”变更为“国泰国证房地产行业指数”；场内简称不变，仍为“国泰地产”；基金代码不变，仍为 160218。《国泰国证房地产行业指数证券投资基金基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请国泰国证房地产行业指数证券投资基金的基金份额在深圳证券交易所上市交易。敬请投资者留意本基金管理人发布的相关公告。

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

|            |                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰国证房地产行业指数分级                                                                                                                                                                                                                                     |
| 场内简称       | 国泰地产                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 160218                                                                                                                                                                                                                                            |
| 交易代码       | 160218                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金合同生效日    | 2013 年 2 月 6 日                                                                                                                                                                                                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 986,114,325.07 份                                                                                                                                                                                                                                  |
| 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；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略。                                                                                                                                                                                                                     |
| 业绩比较基准     | 国证房地产行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征     | <p>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。</p> <p>运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰房地产份额、房地产 A 份额、房地产 B 份额。其中国泰房地产份额为普通的股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；房地产 A 份额的风险与预期收益较低；房地产 B 份额采用了杠杆式的结构，风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。</p> |
| 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     | 房地产 A           | 房地产 B           | 国泰地产             |
| 下属分级基金的场内简称     | 房地产 A           | 房地产 B           | 国泰地产             |
| 下属分级基金的交易代码     | 150117          | 150118          | 160218           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 80,073,892.00 份 | 80,073,892.00 份 | 825,966,541.07 份 |

### § 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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日) |
|-----------------|-------------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -16,504,035.08                            |
| 2. 本期利润         | -64,199,924.87                            |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0623                                   |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,003,053,429.84                          |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0172                                    |

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

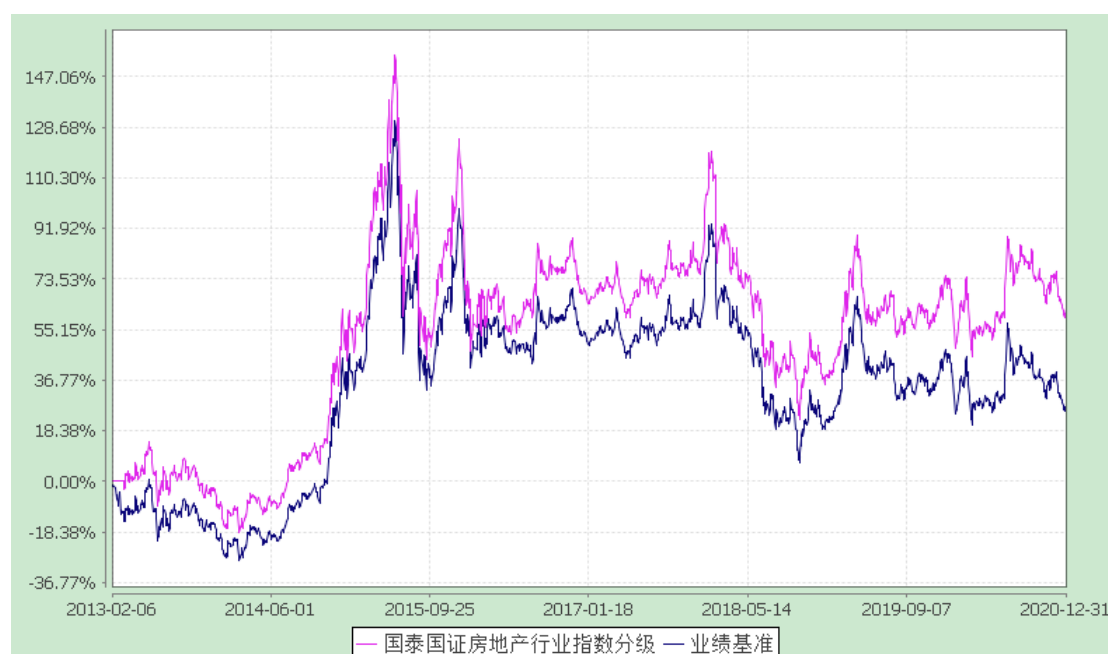
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -5.94%  | 0.93%     | -6.78%     | 0.95%         | 0.84%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 0.05%   | 1.29%     | -3.38%     | 1.43%         | 3.43%  | -0.14% |
| 过去一年       | -6.14%  | 1.46%     | -12.63%    | 1.54%         | 6.49%  | -0.08% |
| 过去三年       | -11.40% | 1.57%     | -21.59%    | 1.57%         | 10.19% | 0.00%  |
| 过去五年       | -22.47% | 1.53%     | -32.40%    | 1.47%         | 9.93%  | 0.06%  |
| 自基金合同生效起至今 | 62.38%  | 1.76%     | 27.70%     | 1.71%         | 34.68% | 0.05%  |

### 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

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金  
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

(2013 年 2 月 6 日至 2020 年 12 月 31 日)



注：本基金的合同生效日为2013年2月6日，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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 徐成城 | 本基金的基金经理、国泰创业板指数（LOF）、国泰黄金 ETF、国泰黄金 ETF 联接、国泰纳斯达克 100（QDI I-ETF）、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 | 2018-05-31  | -    | 15 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）的基金经理，2017 年 2 月至 2020 年 12 月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 月至 2020 年 12 月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 月至 2020 年 12 月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 |

|                                                                                                                                                                                                               |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ETF 联接、国<br>泰中<br>证钢<br>铁<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>全指<br>家用<br>电器<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>新能<br>源汽<br>车<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>新能<br>源汽<br>车 ETF<br>联接、<br>国泰<br>中证<br>全指<br>家用<br>电器<br>ETF 联<br>接的<br>基金<br>经理 |  |  |  |  | 金的基金经理,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 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,2021 年 1 月起兼任国泰国证房地产行业指数证券投资基金(由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)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》、《基金管理人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，对各个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

2020 年四季度，在国内经济持续复苏、外需强劲和流动性维持稳定略宽松的利好下，A 股整体表现不俗：上证指数上涨 7.9% 左右，沪深 300 指数上涨 13.6%，创业板指数上涨 15.2%。分行业来看，申万一级行业中的电器设备、有色金属、食品饮料、家用电器和汽车等行业表现强劲，四季度涨幅均超过 20%；而商贸、传媒、计算机、通信和房地产等行业表现较弱。整体来看，A 股四季度的表现很大程度上受到了包括内资机构、散户和北上增量资金的推动。随着疫情得到控制后经济加速复苏，流动性拐点又尚未到来，权益资产在当前依然具有较好的成长

性和相对投资价值。另一方面，即使估值相对上半年已然不便宜，但市场依然加大了对顺周期板块和景气赛道的投资布局，进一步加大了估值分化现象。

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

本基金在 2020 年第四季度的净值增长率为-5.94%，同期业绩比较基准收益率为-6.78%。

#### 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 2021 年前期，由于基数较低，A 股上市公司一季度有望迎来较高的业绩增速，叠加流动性大概率维持稳定和增量资金持续流入的利好，一季度权益市场或维持整体震荡上行的态势。低估值板块和景气成长行业或有不错的相对表现，而期待 A 股进一步向上突破则需要解决如何消化当前较高的估值这个首要问题。

比较全球资产而言，除中国以外的大多数经济体的央行都进行了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，叠加我国在疫情期间展现的高效政府管理能力和极具韧性的经济活力，都会在中长期提高人民币资产的吸引力。就房地产行业而言，板块估值相对较低，行业底部支撑明显且具有较确定的安全边际，超预期的业绩有望实现。国证房地产行业指数包含了沪深两市一、二线的 50 家主要上市公司，能够表征房地产行业的整体表现。投资者可利用国泰国证房地产行业指数基金，积极把握房地产行业阶段性的投资机会。投资者可关注国泰国证房地产行业指数基金（160218）的投资价值。

#### 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              | 932,310,573.39   | 92.03        |
|    | 其中：股票             | 932,310,573.39   | 92.03        |
| 2  | 固定收益投资            | —                | —            |
|    | 其中：债券             | —                | —            |
|    | 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      | 76,176,367.41    | 7.52         |
| 7  | 其他各项资产            | 4,519,889.33     | 0.45         |
| 8  | 合计                | 1,013,006,830.13 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 2,290,438.55 | 0.23         |
| 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 | 1,153,316.19 | 0.11 |
| J | 金融业             | —            | —    |
| K | 房地产业            | 8,975.14     | 0.00 |
| 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              | 3,552,023.64 | 0.35 |

#### 5.2.2 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              | 22,885,388.93  | 2.28         |
| 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              | 7,758,439.84   | 0.77         |
| K  | 房地产业             | 878,098,203.07 | 87.54        |
| L  | 租赁和商务服务业         | 20,016,517.91  | 2.00         |
| 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        | 928,758,549.75 | 92.59 |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|----------------|----------------------|
| 1  | 000002 | 万 科 A | 5,124,598 | 147,075,962.60 | 14.66                |
| 2  | 600048 | 保利地产  | 9,083,527 | 143,701,397.14 | 14.33                |
| 3  | 001979 | 招商蛇口  | 4,343,627 | 57,726,802.83  | 5.76                 |
| 4  | 600383 | 金地集团  | 2,838,493 | 38,319,655.50  | 3.82                 |
| 5  | 601155 | 新城控股  | 1,090,858 | 37,994,584.14  | 3.79                 |
| 6  | 000656 | 金科股份  | 4,326,952 | 30,678,089.68  | 3.06                 |
| 7  | 600340 | 华夏幸福  | 2,262,153 | 29,249,638.29  | 2.92                 |
| 8  | 600606 | 绿地控股  | 4,069,832 | 23,727,120.56  | 2.37                 |
| 9  | 600177 | 雅戈尔   | 3,182,947 | 22,885,388.93  | 2.28                 |
| 10 | 000961 | 中南建设  | 2,578,100 | 22,764,623.00  | 2.27                 |

#### 5.3.2 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|------|------|-------|---------|----------------------|
|----|------|------|-------|---------|----------------------|

|   |        |      |       |              |      |
|---|--------|------|-------|--------------|------|
| 1 | 688256 | 寒武纪  | 7,583 | 1,088,463.82 | 0.11 |
| 2 | 688017 | 绿的谐波 | 4,138 | 570,257.78   | 0.06 |
| 3 | 300999 | 金龙鱼  | 4,876 | 430,502.04   | 0.04 |
| 4 | 300896 | 爱美客  | 350   | 211,176.00   | 0.02 |
| 5 | 688595 | 芯海科技 | 3,190 | 193,282.10   | 0.02 |

#### 5.4 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。

#### 5.5 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

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。

#### 5.7 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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 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。

#### 5.10 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“中南建设”公告自身或分支机构违规外）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。

中南建设公司自身因 2016 年至 2019 年存在向公司合并报表范围外或所占权益比例不超过 50%的房地产项目公司提供财务资助但未履行相关审议程序和披露义务的情形，期间使用闲置募集资金补充流动资金，受到深圳证券交易所监管关注等监管处罚。

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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 207,327.44   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,185,991.28 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 7,826.10     |
| 5  | 应收申购款   | 3,118,744.51 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 4,519,889.33 |

### 5.11.4 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可转换债券。

### 5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 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<br>(元) | 占基金资产<br>净值比例 (%) | 流通受限<br>情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 688256 | 寒武纪  | 1,088,463.82       | 0.11              | 新股锁定         |
| 2  | 688017 | 绿的谐波 | 570,257.78         | 0.06              | 新股锁定         |
| 3  | 300999 | 金龙鱼  | 430,502.04         | 0.04              | 新股锁定         |
| 4  | 300896 | 爱美客  | 211,176.00         | 0.02              | 新股锁定         |
| 5  | 688595 | 芯海科技 | 193,282.10         | 0.02              | 新股锁定         |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                     | 房地产A           | 房地产B           | 国泰地产           |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初<br>基金份额总额       | 104,559,152.00 | 104,559,152.00 | 854,135,659.33 |
| 报告期期间基<br>金总申购份额       | -              | -              | 264,384,477.17 |
| 减：报告期期<br>间基金总赎回<br>份额 | -              | -              | 341,524,115.43 |
| 报告期期间基<br>金拆分变动份<br>额  | -24,485,260.00 | -24,485,260.00 | 48,970,520.00  |
| 本报告期期末<br>基金份额总额       | 80,073,892.00  | 80,073,892.00  | 825,966,541.07 |

## § 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 影响投资者决策的其他重要信息

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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，本基金管理人制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。根据方案安排，房地产 A 份额和房地产 B 份额的最后交易日为 2020 年 12 月 31 日，终止上市日为 2021 年 1 月 4 日。基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日，对该日登记在册的房地产 A 份额和房地产 B 份额办理基金份额折算，将房地产 A 份额、房地产 B 份额按照各自的基金份额净值折算成场内国泰房地产份额。《国泰国证房地产行业指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金名称于 2021 年 1 月 1 日起变更为“国泰国证房地产行业指数证券投资基金”，场外简称由“国泰国证房地产行业指数分级”变更为“国泰国证房地产行业指数”；场内简称不变，仍为“国泰地产”；基金代码不变，仍为 160218。《国泰国证房地产行业指数证券投资基金基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请国泰国证房地产行业指数证券投资基金的基金份额在深圳证券交易所上市交易。敬请投资者留意本基金管理人发布的相关公告。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同
- 2、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金托管协议

- 3、关于准予国泰国证房地产行业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