

**国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金**  
**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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

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 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                     |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰黄金 ETF 联接                                                                                                                                                                         |
| 基金主代码      | 000218                                                                                                                                                                              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                              |
| 基金合同生效日    | 2016 年 4 月 13 日                                                                                                                                                                     |
| 报告期末基金份额总额 | 219,638,229.10 份                                                                                                                                                                    |
| 投资目标       | 紧密跟踪黄金资产的表现，追求跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                             |
| 投资策略       | <p>本基金为国泰黄金 ETF 的联接基金。国泰黄金 ETF 主要采取被动式管理策略来跟踪黄金资产的价格。本基金主要通过投资于国泰黄金 ETF 实现对黄金资产的紧密跟踪，追求日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</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</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                              |                  |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | <p>方式或二级市场买卖的方式投资于国泰黄金交易型开放式证券投资基金。本基金还将适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。</p> <p>本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与业绩比较基准的跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。</p> |                  |
| 业绩比较基准          | 上海黄金交易所挂盘交易的 Au99.99 合约收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%                                                                                                                                                |                  |
| 风险收益特征          | 本基金主要投资对象为国泰黄金 ETF，预期风险收益水平与黄金资产相似，不同于股票基金、混合基金、债券基金和货币市场基金。                                                                                                                                 |                  |
| 基金管理人           | 国泰基金管理有限公司                                                                                                                                                                                   |                  |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                                                                 |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰黄金 ETF 联接 A                                                                                                                                                                                | 国泰黄金 ETF 联接 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 000218                                                                                                                                                                                       | 004253           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 114,577,185.84 份                                                                                                                                                                             | 105,061,043.26 份 |

### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 基金名称         | 国泰黄金交易型开放式证券投资基金 |
| 基金主代码        | 518800           |
| 基金运作方式       | 交易型开放式           |
| 基金合同生效日      | 2013 年 7 月 18 日  |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所          |
| 上市日期         | 2013 年 7 月 29 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 | 中国工商银行股份有限公司 |
|---------|--------------|

## 2.1.2 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪黄金资产的价格变化，追求跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                 |
| 投资策略   | 本基金采取被动式管理策略。为更好地实现投资目标，紧密跟踪黄金资产的价格变化，本基金可从事黄金租赁业务、黄金互换业务及投资于黄金现货延期交收合约等，以期降低基金运营费用的拖累，降低跟踪误差水平。本基金进行保证金交易只能用于风险管理或提高资产配置效率。正常市场情况下，本基金的风险管理目标是追求日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。当基金跟踪误差超过了上述范围时，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差的进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为上海黄金交易所挂牌交易的 Au99.99 合约。                                                                                                                                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金主要投资对象为黄金现货合约，预期风险收益水平与黄金资产相似，不同于股票基金、混合基金、债券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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日) |                |
|----------------|-------------------------------------------|----------------|
|                | 国泰黄金 ETF 联接 A                             | 国泰黄金 ETF 联接 C  |
| 1.本期已实现收益      | 662,732.05                                | 454,065.72     |
| 2.本期利润         | -6,211,060.09                             | -5,409,235.34  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0520                                   | -0.0495        |
| 4.期末基金资产净值     | 166,184,064.97                            | 151,731,472.71 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4504                                    | 1.4442         |

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、国泰黄金 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   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -3.42%     | 0.79%         | -3.05%         | 0.76%                 | -0.37% | 0.03% |
| 过去六个月          | -2.44%     | 1.04%         | -1.81%         | 1.01%                 | -0.63% | 0.03% |
| 过去一年           | 13.54%     | 1.12%         | 13.77%         | 1.09%                 | -0.23% | 0.03% |
| 过去三年           | 39.34%     | 0.81%         | 40.58%         | 0.79%                 | -1.24% | 0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 45.04%     | 0.75%         | 46.66%         | 0.74%                 | -1.62% | 0.01% |

##### 2、国泰黄金 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   |
|-----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月           | -3.50%     | 0.79%         | -3.05%         | 0.76%                 | -0.45% | 0.03% |
| 过去六个月           | -2.61%     | 1.04%         | -1.81%         | 1.01%                 | -0.80% | 0.03% |
| 过去一年            | 13.15%     | 1.12%         | 13.77%         | 1.09%                 | -0.62% | 0.03% |
| 过去三年            | 38.06%     | 0.81%         | 40.58%         | 0.79%                 | -2.52% | 0.02% |
| 自增加 C 类<br>份额以来 | 34.66%     | 0.75%         | 36.83%         | 0.74%                 | -2.17% | 0.01% |

#### 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

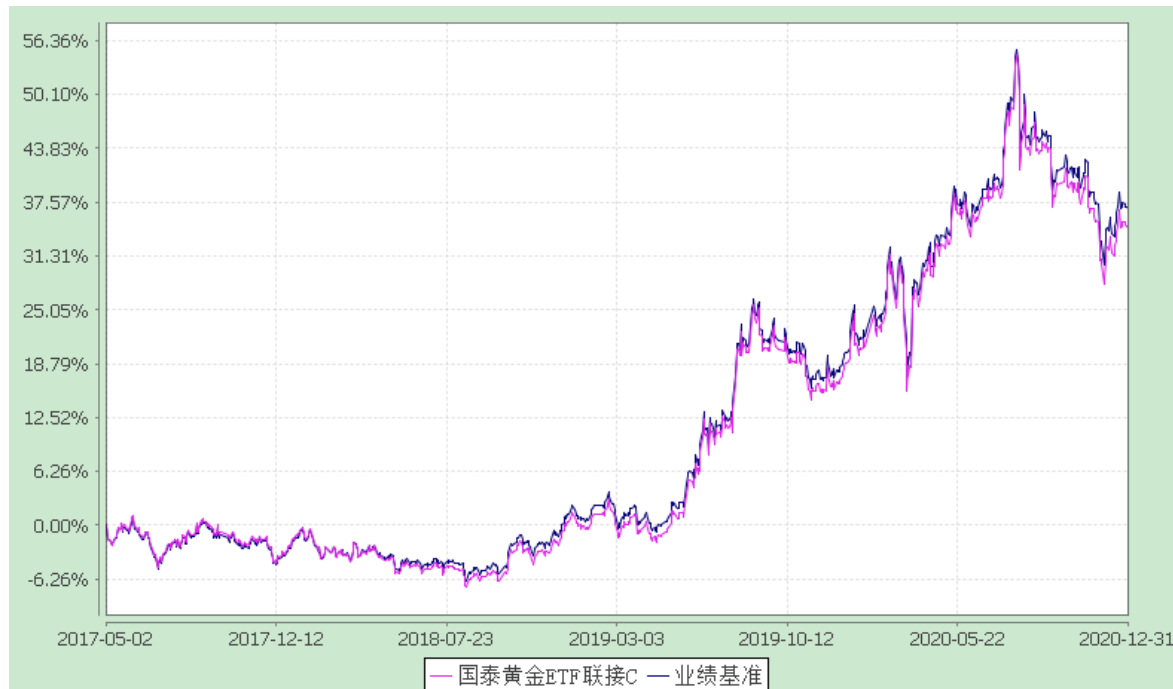
国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016 年 4 月 13 日至 2020 年 12 月 31 日)

##### 1. 国泰黄金 ETF 联接 A:



注：本基金合同生效日为 2016 年 4 月 13 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。

## 2. 国泰黄金 ETF 联接 C:



注：本基金合同生效日为 2016 年 4 月 13 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。自 2017 年 5 月 2 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

## §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、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF） | 2016-04-13  | -    | 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 |

|  |                                                                                                     |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 、国泰量化成长优选混合、国泰策略价值灵活配置混合、芯片 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 |  |  | 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 徐成城 | 本基金的基金经理、国泰创业板指数（LOF）、国泰黄金 ETF、国泰中证房地产行业指数、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 ETF 联接、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证 | 2018-01-22 | - | 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 |

|  |                                                                  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 全指家用电器 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF 联接、国泰中证全指家用电器 ETF 联接的基金经理 |  |  |  | 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

2020 年四季度，尽管期间有所波动，但最终伦敦黄金现货收盘价格仍维持在 1897 美元/盎司附近，而国内黄金现货 Au9999 价格则小幅下跌 3.22%。由于美国经济数据保持了恢复向上的趋势，尤其是新冠肺炎疫苗研发进展的顺利，导致投资者避险情绪下降，十年期美债实际收益率走高。因此伦敦黄金现货价格在 10 月和 11 月持续震荡调整，由 10 月初的 1880 美元附近，下跌到了 11 月底的 1770 美元附近。此后，通胀预期开始升温，同时 12 月美联储议息会议表达了继续购债和延迟加息的宽松态度，金价也在 12 月迎来反弹。除此之外，12 月底美国还通过了 9000 亿美元的新冠纾困法案，为政府提供资金并提供长期的新冠救助，该法案也进一步对金价形成了支撑。整体来看，四季度黄金价格的驱动因素，逐步由名义利率转向了通胀预期，黄金价格也呈现了前低后高的走势。

本基金为被动跟踪金价的基金，为更好的跟踪金价的表现，本基金仓位大部分时间维持在较高水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰黄金 ETF 联接 A 在 2020 年第四季度的净值增长率为-3.42%，同期业绩比较基准收益率为-3.05%。

国泰黄金 ETF 联接 C 在 2020 年第四季度的净值增长率为-3.50%，同期业绩比较基准收益率为-3.05%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前新冠肺炎疫情仍在蔓延肆虐，随着疫苗的大规模接种，全球经济或将在 2021 年逐步回归常态。短期来看，十年期美债收益率已回到 0.9%附近，主要是由于通胀预期的抬升。虽然通胀预期已经接近 2016 年以来的高点，但美联储采取的平均通胀目标政策还是为通胀预期的进一步上行

打开了空间。中期来看，2020 年上半年的大宗商品暴跌导致的低通胀为 2021 年造就了较低的通胀基数，2021 年上半年通胀很可能处于较高水平，有望成为黄金行情的催化剂。此外，根据 12 月美联储议息会议的表态，持续的低利率环境也会对黄金相对有利。站在当下，黄金仍具有较强的配置价值，在全球风险事件频发的情况下，黄金的避险价值或将凸显，在资产组合中加入黄金能够有效降低组合波动率。全球经济衰退的风险正在逐渐增大，包括美联储在内的各国央行仍在持续释放流动性以维持经济，全球负利率债券规模持续攀升，黄金或逐渐将迎来大周期上的机会。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | 294,600,260.87 | 91.51        |
| 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      | 22,876,252.95  | 7.11         |
| 8  | 其他各项资产            | 4,468,040.60   | 1.39         |
| 9  | 合计                | 321,944,554.42 | 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  | 国泰黄金交易型开放式证券投资基金 | 商品型  | 交易型开放式 | 国泰基金管理有限公司 | 294,600,260.87 | 92.67         |

## 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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   | 2,778,163.82 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,437.72     |
| 5  | 应收申购款   | 1,687,439.06 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,468,040.60 |

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 国泰黄金ETF联接A     | 国泰黄金ETF联接C     |
|--------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 120,188,998.44 | 110,585,407.06 |

|                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金总申购份额   | 38,185,180.39  | 63,944,059.84  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 43,796,992.99  | 69,468,423.64  |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 本报告期末基金份额总额    | 114,577,185.84 | 105,061,043.26 |

## §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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金注册的批复
- 2、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同
- 3、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议
- 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

### 8.2 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。

### 8.3 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