

# 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）

**2021 年中期报告**

**2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| <b>2 基金简介</b>                           | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>4 管理人报告</b>                          | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 16        |
| <b>5 托管人报告</b>                          | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 19        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 39        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 40        |
| 7.3.1 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所有股票投资明细 | 40        |
| 7.3.2 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所有股票投资明细 | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 47        |
| 7.6 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      | 47        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 47        |
| 7.8 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   | 47        |
| 7.9 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      | 48        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 48        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 48        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 48        |

|                                   |    |
|-----------------------------------|----|
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构             | 49 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人                  | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况          | 50 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 50 |
| <b>9 开放式基金份额变动</b>                | 50 |
| <b>10 重大事件揭示</b>                  | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                  | 50 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动  | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼       | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变                    | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况             | 51 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况     | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况            | 51 |
| 10.8 其他重大事件                       | 53 |
| <b>11 备查文件目录</b>                  | 53 |
| 11.1 备查文件目录                       | 53 |
| 11.2 存放地点                         | 53 |
| 11.3 查阅方式                         | 54 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF） |
| 基金简称         | 国泰恒生港股通指数（LOF）       |
| 场内简称         | 港股通                  |
| 基金主代码        | 501309               |
| 交易代码         | 501309               |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式             |
| 基金合同生效日      | 2018 年 11 月 6 日      |
| 基金管理人        | 国泰基金管理有限公司           |
| 基金托管人        | 招商银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额   | 30,712,067.85 份      |
| 基金合同存续期      | 不定期                  |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所              |
| 上市日期         | 2018 年 12 月 10 日     |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                              |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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； 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、权证投资策略； 6、融资与转融通证券出借投资策略。                                                    |
| 业绩比较基准 | 经人民币汇率调整的恒生港股通指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                      |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                        | 基金托管人                  |
|-------------|------|------------------------------|------------------------|
| 名称          |      | 国泰基金管理有限公司                   | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘国华                          | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-31081600转                | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com         | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | (021) 31089000, 400-888-8688 | 95555                  |
| 传真          |      | 021-31081800                 | 0755-83195201          |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区                | 深圳深南大道7088号招商银行        |

|       |                            |                   |
|-------|----------------------------|-------------------|
|       | 浦东大道1200号2层225室            | 大厦                |
| 办公地址  | 上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层 | 深圳深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 200082                     | 518040            |
| 法定代表人 | 邱军                         | 缪建民               |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                           |
|---------------------|-----------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                                                   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层和本基金托管人住所                |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 215,432.40                           |
| 本期利润          | -1,342,392.29                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0383                              |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.03%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.02%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 3,375,536.97                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1099                               |
| 期末基金资产净值      | 38,347,895.11                        |
| 期末基金份额净值      | 1.2486                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | 24.86%                               |

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 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         | 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.20%    | 0.77%       | -0.48%     | 0.69%         | 0.68%  | 0.08%  |
| 过去三个月      | 0.91%    | 0.85%       | 0.60%      | 0.83%         | 0.31%  | 0.02%  |
| 过去六个月      | 4.02%    | 1.29%       | 5.89%      | 1.25%         | -1.87% | 0.04%  |
| 过去一年       | 18.84%   | 1.29%       | 17.17%     | 1.21%         | 1.67%  | 0.08%  |
| 自基金合同生效起至今 | 24.86%   | 1.22%       | 22.13%     | 1.24%         | 2.73%  | -0.02% |

### 3.2.2 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

国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2018 年 11 月 6 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2018 年 11 月 6 日。本基金在六个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、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）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证

食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、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）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、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，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价

值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、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转型而来）、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、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、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）、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）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰中证钢铁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、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、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、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、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合

型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、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）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                                                                                                                 | 任本基金的基金经理<br>（助理）期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                    | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 朱丹  | 国泰恒生港股通指数（LOF）的基金经理                                                                                                | 2020-11-06          | -    | 5 年        | 硕士研究生。2016 年 1 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2020 年 11 月起任国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 吴向军 | 国泰中国企业境外高收益债券（QDII）、国泰纳斯达克 100 指数（QDII）、国泰大宗商品（QDII-LOF）、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰恒生港股通指数（LOF）的基金经理、国际业务部总监、投资总监（海外） | 2018-11-06          | -    | 17 年       | 硕士研究生。2004 年 6 月至 2011 年 4 月在美国 Guggenheim Partners 工作，历任研究员，高级研究员，投资经理。2011 年 5 月起加盟国泰基金管理有限公司，2013 年 4 月起任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金的基金经理，2013 年 8 月至 2017 年 12 月任国泰美国房地产开发股票型证券投资基金的基金经理，2015 年 7 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金和国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）的基金经理，2015 年 12 月至 2020 年 10 月任国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金的基金经理，2017 年 9 月至 2021 年 5 月任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）的基金经理，2018 年 5 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，2018 年 11 月起兼任国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2015 年 8 月至 2016 年 6 月任国际业务部副总监，2016 年 6 月至 2018 年 7 月任国际业务部副总监（主持工作），2017 年 7 月起任投资总监（海外），2018 年 7 月起任国际业务部总监。 |

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，基金管理团队保持独立运作，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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，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。

##### （一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，港股市场呈现“周期强、科技弱”的结构性分化表现。恒生指数、恒生国企指数、恒生科技指数分别上涨 5.9%、下跌 0.7%、下跌 3.2%。本基金跟踪的恒生港股通指数上半年上涨 7.4%，体现出新旧经济更加均衡、防守和进攻性都更强的优势。究其原因，一方面去年疫情以来科技股涨幅远大于周期股引发了自然获利回吐现象，另一方面产业政策变化也催化并加深了分化走势。

宏观层面，一季度国内经济延续复苏，和中国工业需求紧密相关的全球大宗商品价格均有明显反弹，对港股中资股特别是周期股基本面有一定承托。同时海外疫情也有所缓和，欧美等国疫苗稳步推进，叠加美国 3 月初出台新一轮 1.9 万亿财政刺激，进一步推升了通胀预期和全球周期品价格，对港股外需股和周期股起到了支撑。二季度，出口仍受益于中国强大稳定的供应链地位以及居高不下的外需维持强劲，消费则由于收入水平恢复进度慢于预期而表现相对低迷。同时，大宗商品价格上涨带来 PPI 与 CPI 剪刀差扩大，侵蚀了下游需求的同时，也导致部分中下游企业的盈利水平受到挤压。海外方面，美国经济复苏进程稳步推进，零售消费、工业产出等经济数据持续向好，但物价上行压力也导致了市场有关美联储货币政策提前转向的担忧，从而导致市场震荡幅度加大，对港股也产生了一定扰动。

板块层面，一季度港股以 2 月中旬为分水岭，市场风格从高估值科技股领涨迅速切换到低估值周期股领涨，这和全球通胀预期升温、海外长端利率飙升有密切关系。能源业、地产建筑业、电讯业等偏价值的低估值板块均有 10%以上的涨幅。而必选消费、医疗保健、资讯科技等偏成长的高估值板块表现垫底。二季度整体延续一季度后半段“多周期空科技”的风格模式，并在新经济内部进一步产生分化。以疫苗为代表的医疗保健板块以及以纺织服饰为代表的可选消费板块表现良好，分别上涨 10%和 4%。随着中国实现新冠疫情“先进先出”，医药板块在疫苗股的带动下关注度持续提升，良好的业绩弹性与估值反弹帮助板块领涨二季度。纺织服饰受到“新疆棉”事件良性催化，国产国货替代热情高涨。信息技术行业因受到国内互联网反垄断监管高压表现相对弱势，单季度下跌 3%。

撇开短期涨跌，从中长维度来看，港股投资生态正发生着积极变化。今年一季度快手等国内新经济龙头选择了港股首发上市。百度、哔哩哔哩等热门中概股也纷纷回港二次上市。六月初，恒指历史最大改革的第一批调整名单正式生效，标志着港股投资生态积极转变的正式开启。市场预计将有更多新经济领域明星个股陆续纳入，科技、消费、医疗多领域新经济行业的覆盖度将进一步提升。新经济占比的提升、产业结构的变迁将吸引越来越多全球资金配置港股，提高其交投活跃度。

接下来我们仍将密切关注全球新冠疫苗普及、经济复苏、港股改革、美联储政策及海外市场波动等情况，支持投资决策。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 4.02%，同期业绩比较基准收益率为 5.89%。

#### 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 年下半年包括港股在内的全球资本市场的最大交易主题将是美联储政策动向和新冠疫苗推进情况，同时港股还需要密切关注包括互联网在内的行业监管动向以及中国宏观基本面的变化。

7 月美联储 FOMC 会议延续鸽派风格，但将于随后的联储会议上公布更加明确的退出量化宽松时间表。当前市场判断最早 9 月美联储将释放信号，退出实施时点预计在今年年底至明年年初，但如果后续月份的就业数据超出预期，不排除提前的可能。至于加息时点，尽管 6 月美联储点阵图显示转鹰信号，但考虑到美联储对于通胀一直以来秉持的暂时性论调，预计最快明年 4 季度开始。美联储政策的转向将对全球各类资产走势产生影响，港股市场也将面临更大的外盘扰动以及潜在的海外流动性拐点。

疫苗方面，美国新冠疫苗接种率距离此前所设定的 75%成年人接种目标还有一定差距，疫苗普及仍将成为拜登政府接下来的工作重心之一。中国新冠疫苗接种工作加速推进，目前接种数已超 12 亿剂，接种率已超 40%，预计今年年底前完成至少 70%目标人群的接种。当前传染性较强的新冠德尔塔变异毒株肆虐，导致全球范围内新冠疫情有重燃之势，疫苗推进进度仍然是重中之重。更快速的疫苗推进工作将帮助经济复苏步伐进一步加快，从而对风险资产起到有力支撑，尤其是周期板块。

中国方面首先是监管维度，受 K12 教培及互联网一系列监管措施影响，港股市场波动加大。超出预期的监管力度可能引发有关多个行业从严监管的担忧，并导致资金的离场以及部分行业的基本面重估。其次是宏观方面，国内经济整体恢复态势延续但增长动能趋缓，预计下半年出口及地产将下行风险，社融增速将延续下降趋势，但回落速度可能边际放缓。在国内流动性并无明显转松的预期下，南下资金可能也会有所影响，从而导致港股整体资金面有一定压力。

中长期来看，随着大量的优质中概回归、新经济比重提高、南下资金逐渐加码，与 A 股存在强互补性的港股仍然值得期待。港股的基本面和资金面仍在向好发展，随着更多新经济独角兽和美股优质中概股回归后，港股的投资生态将愈发具有活力。我们仍会继续利用国泰恒生港股通指数基金，为投资者追踪港股表现创造便利。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基

金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,599,056.23                   | 905,397.46                       |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | 16,416.74                      | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 35,968,846.04                  | 9,087,296.26                     |
| 其中：股票投资         |            | 35,968,846.04                  | 9,087,296.26                     |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 782,241.86                     | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 297.85                         | 135.27                           |
| 应收股利            |            | 191,920.14                     | 935.03                           |
| 应收申购款           |            | 43,628.98                      | 48,926.11                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>39,602,407.84</b>           | <b>10,042,690.13</b>             |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 3.90                             |
| 应付赎回款           |            | 1,162,530.15                   | 195,409.92                       |
| 应付管理人报酬         |            | 24,630.03                      | 6,037.58                         |
| 应付托管费           |            | 6,568.00                       | 1,610.00                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 8,675.98                       | 1,527.41                         |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |

|                   |          |                      |                      |
|-------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 应付利息              |          | -                    | -                    |
| 应付利润              |          | -                    | -                    |
| 递延所得税负债           |          | -                    | -                    |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 52,108.57            | 73,354.00            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>1,254,512.73</b>  | <b>277,942.81</b>    |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                    | -                    |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 30,712,067.85        | 8,134,663.92         |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 7,635,827.26         | 1,630,083.40         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>38,347,895.11</b> | <b>9,764,747.32</b>  |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>39,602,407.84</b> | <b>10,042,690.13</b> |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2486 元，基金份额总额 30,712,067.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>-862,625.98</b>                       | <b>350,934.99</b>                             |
| 1.利息收入                |          | 15,514.02                                | 2,195.54                                      |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 15,454.84                                | 2,182.75                                      |
| 债券利息收入                |          | 59.18                                    | 12.79                                         |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |          | -                                        | -                                             |
| 证券出借利息收入              |          | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 351,749.99                               | 134,722.74                                    |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | -89,018.69                               | 56,572.03                                     |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | 24.00                                    | -3.60                                         |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               |          | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.15 | 440,744.68                               | 78,154.31                                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -1,557,824.69                            | 179,164.92                                    |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17 | 327,934.70                               | 34,851.79                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>479,766.31</b>                        | <b>115,720.83</b>                             |
| 1. 管理人报酬              |          | 167,221.66                               | 20,645.08                                     |

|                     |          |               |            |
|---------------------|----------|---------------|------------|
| 2. 托管费              |          | 44,592.50     | 5,505.32   |
| 3. 销售服务费            |          | -             | -          |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.18 | 195,214.62    | 13,526.67  |
| 5. 利息支出             |          | -             | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | -             | -          |
| 6.税金及附加             |          | -             | -          |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.19 | 72,737.53     | 76,043.76  |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -1,342,392.29 | 235,214.16 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -1,342,392.29 | 235,214.16 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|----------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 8,134,663.92                               | 1,630,083.40   | 9,764,747.32   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -1,342,392.29  | -1,342,392.29  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 22,577,403.93                              | 7,348,136.15   | 29,925,540.08  |
| 其中：1.基金申购款                             | 64,919,729.37                              | 19,643,739.56  | 84,563,468.93  |
| 2.基金赎回款                                | -42,342,325.44                             | -12,295,603.41 | -54,637,928.85 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -              | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 30,712,067.85                              | 7,635,827.26   | 38,347,895.11  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 3,573,101.02                               | 224,903.04     | 3,798,004.06   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利                 | -                                          | 235,214.16     | 235,214.16     |

|                                        |               |             |               |
|----------------------------------------|---------------|-------------|---------------|
| 润)                                     |               |             |               |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 2,945,786.89  | -129,304.89 | 2,816,482.00  |
| 其中：1.基金申购款                             | 9,928,968.58  | -114,697.53 | 9,814,271.05  |
| 2.基金赎回款                                | -6,983,181.69 | -14,607.36  | -6,997,789.05 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -             | -           | -             |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,518,887.91  | 330,812.31  | 6,849,700.22  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]345 号《关于准予国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)注册的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 225,955,789.89 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0707 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2018 年 11 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 226,064,924.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 109,134.92 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]第 148 号核准，本基金 72,059,169.00 份基金份额于 2018 年 12 月 10 日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票(包括港股通标的股票和经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包

括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、权证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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规和政策的规定在履行适当程序后参与融资和转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的恒生港股通指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登

记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 2,599,056.23           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 2,599,056.23           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |               |             |
|---------------|-------|------------------------|---------------|-------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            |       | 36,382,297.28          | 35,968,846.04 | -413,451.24 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -             | -           |
| 债券            | 交易所市场 | -                      | -             | -           |
|               | 银行间市场 | -                      | -             | -           |
|               | 合计    | -                      | -             | -           |
| 资产支持证券        |       | -                      | -             | -           |
| 基金            |       | -                      | -             | -           |
| 其他            |       | -                      | -             | -           |
| 合计            |       | 36,382,297.28          | 35,968,846.04 | -413,451.24 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 264.10                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 28.08                  |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | 3.16                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | 2.51                   |
| 合计         | 297.85                 |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 8,675.98               |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 8,675.98               |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 1,553.79               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 29,752.78              |
| 应付指数使用费     | 20,802.00              |
| 合计          | 52,108.57              |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 8,134,663.92                          | 8,134,663.92   |
| 本期申购          | 64,919,729.37                         | 64,919,729.37  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -42,342,325.44                        | -42,342,325.44 |
| 本期末           | 30,712,067.85                         | 30,712,067.85  |

注：截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 8,567,423.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 22,144,644.85 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 911,429.19    | 718,654.21    | 1,630,083.40   |
| 本期利润           | 215,432.40    | -1,557,824.69 | -1,342,392.29  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,248,675.38  | 5,099,460.77  | 7,348,136.15   |
| 其中：基金申购款       | 7,208,133.00  | 12,435,606.56 | 19,643,739.56  |
| 基金赎回款          | -4,959,457.62 | -7,336,145.79 | -12,295,603.41 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -              |
| 本期末            | 3,375,536.97  | 4,260,290.29  | 7,635,827.26   |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 8,404.17                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 5,863.35                              |
| 其他        | 1,187.32                              |
| 合计        | 15,454.84                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 41,794,866.84                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 41,883,885.53                         |
| 买卖股票差价收入   | -89,018.69                            |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 616,255.89                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 602,976.00                 |
| 减：应收利息总额               | 13,255.89                  |
| 买卖债券差价收入               | 24.00                      |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 440,744.68                 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                          |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 440,744.68 |
|----|------------|

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -1,557,824.69              |
| ——股票投资                     | -1,557,824.69              |
| ——债券投资                     | -                          |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -                          |
| ——贵金属投资                    | -                          |
| ——其他                       | -                          |
| 2.衍生工具                     | -                          |
| ——权证投资                     | -                          |
| 3.其他                       | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -1,557,824.69              |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 327,934.70                 |
| 合计      | 327,934.70                 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 195,214.62                            |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 195,214.62                            |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|         | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------|
| 审计费用    | 29,752.78            |
| 信息披露费   | -                    |
| 证券出借违约金 | -                    |
| 银行汇划费用  | 1,053.25             |
| 指数使用费   | 41,931.50            |
| 合计      | 72,737.53            |

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度港币 25,000.00 元。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系      |
|--------------------|--------------|
| 国泰基金管理有限公司         | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 167,221.66                     | 20,645.08                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 46,124.12                      | 6,987.07                            |

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.75% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 44,592.50                      | 5,505.32                            |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |          |
|-------|----------------------------|----------|---------------------------------|----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 招商银行  | 2,599,056.23               | 8,404.17 | 745,258.53                      | 1,519.67 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有基金托管人招商银行的 H 股普通股 13,000.00 股，成本总额为人民币 628,151.41 元，估值总额为人民币 716,690.00 元，占基金资产净值的比例为 1.87%。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，本基金的风险控制目标是追求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%。基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，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。同时，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。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责

公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30 日   | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产                       |              |       |       |               |               |
| 银行存款                     | 2,599,056.23 | -     | -     | -             | 2,599,056.23  |
| 存出保证金                    | 16,416.74    | -     | -     | -             | 16,416.74     |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 35,968,846.04 | 35,968,846.04 |
| 应收证券清算款                  | -            | -     | -     | 782,241.86    | 782,241.86    |
| 应收股利                     | -            | -     | -     | 191,920.14    | 191,920.14    |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 297.85        | 297.85        |
| 应收申购款                    | 1,829.78     | -     | -     | 41,799.20     | 43,628.98     |
| 资产总计                     | 2,617,302.75 | -     | -     | 36,985,105.09 | 39,602,407.84 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 1,162,530.15  | 1,162,530.15  |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 24,630.03     | 24,630.03     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 6,568.00      | 6,568.00      |
| 应付交易费用                   | -            | -     | -     | 8,675.98      | 8,675.98      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 52,108.57     | 52,108.57     |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 1,254,512.73  | 1,254,512.73  |
| 利率敏感度缺口                  | 2,617,302.75 | -     | -     | 35,730,592.36 | 38,347,895.11 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                       |              |       |       |               |               |

|         |            |   |   |              |               |
|---------|------------|---|---|--------------|---------------|
| 银行存款    | 905,397.46 | - | - | -            | 905,397.46    |
| 交易性金融资产 | -          | - | - | 9,087,296.26 | 9,087,296.26  |
| 应收股利    | -          | - | - | 935.03       | 935.03        |
| 应收利息    | -          | - | - | 135.27       | 135.27        |
| 应收申购款   | 199.98     | - | - | 48,726.13    | 48,926.11     |
| 资产总计    | 905,597.44 | - | - | 9,137,092.69 | 10,042,690.13 |
| 负债      | -          | - | - | -            | -             |
| 应付证券清算款 | -          | - | - | 3.90         | 3.90          |
| 应付赎回款   | -          | - | - | 195,409.92   | 195,409.92    |
| 应付管理人报酬 | -          | - | - | 6,037.58     | 6,037.58      |
| 应付托管费   | -          | - | - | 1,610.00     | 1,610.00      |
| 应付交易费用  | -          | - | - | 1,527.41     | 1,527.41      |
| 其他负债    | -          | - | - | 73,354.00    | 73,354.00     |
| 负债总计    | -          | - | - | 277,942.81   | 277,942.81    |
| 利率敏感度缺口 | 905,597.44 | - | - | 8,859,149.88 | 9,764,747.32  |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年6月30日 |             |    |
|-------|-------------------|-------------|----|
|       | 美元<br>折合人民币       | 港币<br>折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价 |                   |             |    |

|                   |                     |                      |                      |
|-------------------|---------------------|----------------------|----------------------|
| 的资产               |                     |                      |                      |
| 交易性金融资产           | -                   | 35,968,846.04        | 35,968,846.04        |
| 应收股利              | -                   | 191,920.14           | 191,920.14           |
| 资产合计              | -                   | <b>36,160,766.18</b> | <b>36,160,766.18</b> |
| 以外币计价的负债          |                     |                      |                      |
| 负债合计              | -                   | -                    | -                    |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | -                   | <b>36,160,766.18</b> | <b>36,160,766.18</b> |
| 项目                | 上年度末<br>2020年12月31日 |                      |                      |
|                   | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币          | 合计                   |
| 以外币计价的资产          |                     |                      |                      |
| 交易性金融资产           | -                   | 9,087,296.26         | 9,087,296.26         |
| 应收股利              | -                   | 935.03               | 935.03               |
| 资产合计              | -                   | <b>9,088,231.29</b>  | <b>9,088,231.29</b>  |
| 以外币计价的负债          |                     |                      |                      |
| 负债合计              | -                   | -                    | -                    |
| 资产负债表<br>外汇风险敞口净额 | -                   | <b>9,088,231.29</b>  | <b>9,088,231.29</b>  |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                  |                              |
|----|------------------|------------------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                              |
| 分析 | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） |

|  |              | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--|--------------|------------------------|--------------------------|
|  | 港币相对人民币升值 5% | 增加约 181                | 增加约 45                   |
|  | 港币相对人民币贬值 5% | 减少约 181                | 减少约 45                   |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在经人民币汇率调整的恒生港股通指数构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，本基金的基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

|              | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |
|--------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| 项目           | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 35,968,846.04          | 93.80         | 9,087,296.26             | 93.06         |

|               |               |       |              |       |
|---------------|---------------|-------|--------------|-------|
| 交易性金融资产—基金投资  | -             | -     | -            | -     |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -             | -     | -            | -     |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -     | -            | -     |
| 其他            | -             | -     | -            | -     |
| 合计            | 35,968,846.04 | 93.80 | 9,087,296.26 | 93.06 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除基准外其他市场风险变量不变      |                              |                          |
|----|---------------------|------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动           | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） |                          |
|    |                     | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日       | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 经人民币调整的恒生港股通指数上升 5% | 增加约 197                      | 增加约 47                   |
|    | 经人民币调整的恒生港股通指数下降 5% | 减少约 197                      | 增加约 47                   |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 35,968,846.04 元，无属于第二层次的余额及属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产属于第一层次的余额为

9,087,296.26 元，无属于第二层次的余额及属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 35,968,846.04 | 90.82         |
|    | 其中：股票  | 35,968,846.04 | 90.82         |
| 2  | 基金投资   | -             | -             |
| 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      | 2,599,056.23  | 6.56   |
| 8 | 其他各项资产            | 1,034,505.57  | 2.61   |
| 9 | 合计                | 39,602,407.84 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 35,968,846.04 元，占基金资产净值比例为 93.80%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资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境内股票。

### 7.2.2 积极投资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境内股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 金融       | 9,899,785.00 | 25.82        |
| 公用事业     | 1,572,195.00 | 4.10         |
| 通讯服务     | 4,645,349.00 | 12.11        |
| 非日常生活消费品 | 6,901,088.00 | 18.00        |
| 能源       | 842,910.00   | 2.20         |
| 房地产      | 2,255,874.14 | 5.88         |
| 日常消费品    | 1,214,505.00 | 3.17         |
| 工业       | 2,077,329.00 | 5.42         |
| 医疗保健     | 3,428,178.40 | 8.94         |
| 信息技术     | 2,831,911.00 | 7.38         |
| 原材料      | 299,721.50   | 0.78         |

|    |               |       |
|----|---------------|-------|
| 合计 | 35,968,846.04 | 93.80 |
|----|---------------|-------|

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码  | 股票名称   | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 00700 | 腾讯控股   | 7,300   | 3,547,289.00 | 9.25         |
| 2  | 03690 | 美团-W   | 8,400   | 2,239,440.00 | 5.84         |
| 3  | 01299 | 友邦保险   | 26,800  | 2,152,040.00 | 5.61         |
| 4  | 00005 | 汇丰控股   | 45,600  | 1,701,792.00 | 4.44         |
| 5  | 00939 | 建设银行   | 237,000 | 1,203,960.00 | 3.14         |
| 6  | 02269 | 药明生物   | 9,500   | 1,124,800.00 | 2.93         |
| 7  | 00388 | 香港交易所  | 2,800   | 1,078,252.00 | 2.81         |
| 8  | 01810 | 小米集团-W | 37,600  | 844,872.00   | 2.20         |
| 9  | 02318 | 中国平安   | 11,500  | 727,720.00   | 1.90         |
| 10 | 03968 | 招商银行   | 13,000  | 716,690.00   | 1.87         |
| 11 | 01398 | 工商银行   | 156,000 | 591,240.00   | 1.54         |
| 12 | 01211 | 比亚迪股份  | 3,000   | 579,630.00   | 1.51         |
| 13 | 00941 | 中国移动   | 11,500  | 464,600.00   | 1.21         |
| 14 | 02020 | 安踏体育   | 3,000   | 456,300.00   | 1.19         |
| 15 | 02331 | 李宁     | 5,500   | 433,840.00   | 1.13         |
| 16 | 02688 | 新奥能源   | 3,400   | 418,132.00   | 1.09         |
| 17 | 01997 | 九龙仓置业  | 11,000  | 413,270.00   | 1.08         |
| 18 | 00175 | 吉利汽车   | 20,000  | 406,800.00   | 1.06         |
| 19 | 00669 | 创科实业   | 3,500   | 394,905.00   | 1.03         |
| 20 | 02319 | 蒙牛乳业   | 10,000  | 390,700.00   | 1.02         |
| 21 | 00002 | 中电控股   | 6,000   | 383,400.00   | 1.00         |
| 22 | 00001 | 长和     | 7,500   | 377,550.00   | 0.98         |
| 23 | 02333 | 长城汽车   | 18,000  | 376,020.00   | 0.98         |
| 24 | 06098 | 碧桂园服务  | 5,000   | 349,050.00   | 0.91         |
| 25 | 03988 | 中国银行   | 150,000 | 348,000.00   | 0.91         |
| 26 | 01801 | 信达生物   | 4,500   | 339,030.00   | 0.88         |
| 27 | 00012 | 恒基地产   | 11,000  | 336,820.00   | 0.88         |
| 28 | 02313 | 申洲国际   | 2,000   | 326,340.00   | 0.85         |
| 29 | 00003 | 香港中华煤气 | 31,500  | 315,945.00   | 0.82         |
| 30 | 02196 | 复星医药   | 6,000   | 313,020.00   | 0.82         |
| 31 | 02359 | 药明康德   | 2,040   | 307,754.40   | 0.80         |

|    |       |             |        |            |      |
|----|-------|-------------|--------|------------|------|
| 32 | 01928 | 金沙中国有限公司    | 10,800 | 293,868.00 | 0.77 |
| 33 | 00016 | 新鸿基地产       | 3,000  | 288,810.00 | 0.75 |
| 34 | 00883 | 中国海洋石油      | 39,000 | 286,650.00 | 0.75 |
| 35 | 02400 | 心动公司        | 5,000  | 285,000.00 | 0.74 |
| 36 | 00968 | 信义光能        | 20,000 | 279,000.00 | 0.73 |
| 37 | 00522 | ASM PACIFIC | 3,100  | 271,343.00 | 0.71 |
| 38 | 01308 | 海丰国际        | 10,000 | 270,000.00 | 0.70 |
| 39 | 06169 | 宇华教育        | 46,000 | 269,100.00 | 0.70 |
| 40 | 01093 | 石药集团        | 28,480 | 266,288.00 | 0.69 |
| 41 | 00011 | 恒生银行        | 2,000  | 258,120.00 | 0.67 |
| 42 | 02388 | 中银香港        | 11,500 | 252,195.00 | 0.66 |
| 43 | 06186 | 中国飞鹤        | 18,000 | 251,100.00 | 0.65 |
| 44 | 02588 | 中银航空租赁      | 4,600  | 250,700.00 | 0.65 |
| 45 | 02382 | 舜宇光学科技      | 1,200  | 245,028.00 | 0.64 |
| 46 | 00066 | 港铁公司        | 6,500  | 233,935.00 | 0.61 |
| 47 | 00291 | 华润啤酒        | 4,000  | 232,160.00 | 0.61 |
| 48 | 01177 | 中国生物制药      | 36,000 | 228,240.00 | 0.60 |
| 49 | 06060 | 众安在线        | 6,000  | 219,420.00 | 0.57 |
| 50 | 00268 | 金蝶国际        | 10,000 | 219,300.00 | 0.57 |
| 51 | 03606 | 福耀玻璃        | 4,800  | 218,448.00 | 0.57 |
| 52 | 00868 | 信义玻璃        | 8,000  | 210,720.00 | 0.55 |
| 53 | 01109 | 华润置地        | 8,000  | 209,360.00 | 0.55 |
| 54 | 00992 | 联想集团        | 28,000 | 208,040.00 | 0.54 |
| 55 | 00027 | 银河娱乐        | 4,000  | 206,840.00 | 0.54 |
| 56 | 00386 | 中国石油化工股份    | 62,000 | 202,740.00 | 0.53 |
| 57 | 00857 | 中国石油股份      | 64,000 | 201,600.00 | 0.53 |
| 58 | 00241 | 阿里健康        | 14,000 | 200,620.00 | 0.52 |
| 59 | 00981 | 中芯国际        | 10,000 | 198,900.00 | 0.52 |
| 60 | 00006 | 电能实业        | 5,000  | 198,250.00 | 0.52 |
| 61 | 01288 | 农业银行        | 86,000 | 193,500.00 | 0.50 |
| 62 | 01347 | 华虹半导体       | 5,000  | 178,500.00 | 0.47 |
| 63 | 00288 | 万洲国际        | 30,500 | 177,205.00 | 0.46 |
| 64 | 02338 | 潍柴动力        | 12,000 | 172,320.00 | 0.45 |
| 65 | 03759 | 康龙化成        | 1,000  | 172,240.00 | 0.45 |
| 66 | 06690 | 海尔智家        | 7,600  | 171,380.00 | 0.45 |
| 67 | 03692 | 翰森制药        | 6,000  | 169,740.00 | 0.44 |
| 68 | 00826 | 天工国际        | 60,000 | 165,000.00 | 0.43 |
| 69 | 00728 | 中国电信        | 68,000 | 164,560.00 | 0.43 |
| 70 | 01999 | 敏华控股        | 10,400 | 161,512.00 | 0.42 |
| 71 | 01658 | 邮储银行        | 36,000 | 156,600.00 | 0.41 |
| 72 | 03669 | 永达汽车        | 13,500 | 156,195.00 | 0.41 |
| 73 | 02343 | 太平洋航运       | 60,000 | 156,000.00 | 0.41 |

|     |       |          |        |            |      |
|-----|-------|----------|--------|------------|------|
| 74  | 01088 | 中国神华     | 12,000 | 151,920.00 | 0.40 |
| 75  | 00762 | 中国联通     | 40,000 | 141,200.00 | 0.37 |
| 76  | 02601 | 中国太保     | 6,800  | 138,312.00 | 0.36 |
| 77  | 00763 | 中兴通讯     | 6,600  | 133,188.00 | 0.35 |
| 78  | 00688 | 中国海外发展   | 9,000  | 132,120.00 | 0.34 |
| 79  | 01951 | 锦欣生殖     | 8,000  | 130,480.00 | 0.34 |
| 80  | 00960 | 龙湖集团     | 3,500  | 126,700.00 | 0.33 |
| 81  | 01055 | 中国南方航空股份 | 30,000 | 120,300.00 | 0.31 |
| 82  | 03888 | 金山软件     | 3,000  | 116,190.00 | 0.30 |
| 83  | 00881 | 中升控股     | 2,000  | 107,500.00 | 0.28 |
| 84  | 00384 | 中国燃气     | 5,400  | 106,488.00 | 0.28 |
| 85  | 00884 | 旭辉控股集团   | 18,000 | 90,720.00  | 0.24 |
| 86  | 00285 | 比亚迪电子    | 2,000  | 84,880.00  | 0.22 |
| 87  | 06078 | 海吉亚医疗    | 1,000  | 84,870.00  | 0.22 |
| 88  | 00322 | 康师傅控股    | 6,000  | 77,400.00  | 0.20 |
| 89  | 01038 | 长江基建集团   | 2,000  | 77,060.00  | 0.20 |
| 90  | 03908 | 中金公司     | 4,400  | 76,516.00  | 0.20 |
| 91  | 03347 | 泰格医药     | 500    | 75,720.00  | 0.20 |
| 92  | 06969 | 思摩尔国际    | 2,000  | 71,640.00  | 0.19 |
| 93  | 00914 | 海螺水泥     | 2,000  | 68,560.00  | 0.18 |
| 94  | 01157 | 中联重科     | 10,000 | 67,600.00  | 0.18 |
| 95  | 00017 | 新世界发展    | 1,750  | 58,747.50  | 0.15 |
| 96  | 00670 | 中国东方航空股份 | 20,000 | 54,800.00  | 0.14 |
| 97  | 00813 | 世茂集团     | 3,000  | 47,520.00  | 0.12 |
| 98  | 03998 | 波司登      | 10,000 | 46,200.00  | 0.12 |
| 99  | 01113 | 长实集团     | 1,000  | 44,600.00  | 0.12 |
| 100 | 00799 | IGG      | 5,000  | 42,700.00  | 0.11 |
| 101 | 00880 | 澳博控股     | 6,000  | 42,360.00  | 0.11 |
| 102 | 00586 | 海螺创业     | 1,500  | 40,815.00  | 0.11 |
| 103 | 00270 | 粤海投资     | 4,000  | 37,160.00  | 0.10 |
| 104 | 00135 | 昆仑能源     | 6,000  | 35,760.00  | 0.09 |
| 105 | 09909 | 宝龙商业     | 1,500  | 34,080.00  | 0.09 |
| 106 | 01919 | 中远海控     | 2,000  | 32,560.00  | 0.08 |
| 107 | 06030 | 中信证券     | 2,000  | 32,420.00  | 0.08 |
| 108 | 01995 | 旭辉永升服务   | 2,000  | 32,080.00  | 0.08 |
| 109 | 06886 | HTSC     | 3,200  | 30,368.00  | 0.08 |
| 110 | 03323 | 中国建材     | 4,000  | 30,360.00  | 0.08 |
| 111 | 02007 | 碧桂园      | 4,000  | 28,960.00  | 0.08 |
| 112 | 02013 | 微盟集团     | 2,000  | 28,500.00  | 0.07 |
| 113 | 00631 | 三一国际     | 4,000  | 26,200.00  | 0.07 |
| 114 | 02018 | 瑞声科技     | 500    | 24,170.00  | 0.06 |
| 115 | 02328 | 中国财险     | 4,000  | 22,640.00  | 0.06 |

|     |       |          |        |           |      |
|-----|-------|----------|--------|-----------|------|
| 116 | 02202 | 万科企业     | 1,000  | 20,220.00 | 0.05 |
| 117 | 00144 | 招商局港口    | 2,000  | 18,880.00 | 0.05 |
| 118 | 01813 | 合景泰富集团   | 2,000  | 17,300.00 | 0.05 |
| 119 | 00101 | 恒隆地产     | 1,000  | 15,690.00 | 0.04 |
| 120 | 01099 | 国药控股     | 800    | 15,376.00 | 0.04 |
| 121 | 00177 | 江苏宁沪高速公路 | 2,000  | 14,620.00 | 0.04 |
| 122 | 00839 | 中教控股     | 1,000  | 14,410.00 | 0.04 |
| 123 | 01117 | 现代牧业     | 10,000 | 14,300.00 | 0.04 |
| 124 | 00152 | 深圳国际     | 1,500  | 13,410.00 | 0.03 |
| 125 | 01313 | 华润水泥控股   | 2,000  | 12,280.00 | 0.03 |
| 126 | 01787 | 山东黄金     | 1,050  | 12,001.50 | 0.03 |
| 127 | 03993 | 洛阳钼业     | 3,000  | 11,520.00 | 0.03 |
| 128 | 03913 | 合景悠活     | 1,000  | 8,290.00  | 0.02 |
| 129 | 03808 | 中国重汽     | 500    | 6,925.00  | 0.02 |
| 130 | 02208 | 金风科技     | 400    | 4,040.00  | 0.01 |
| 131 | 03898 | 中车时代电气   | 100    | 3,819.00  | 0.01 |
| 132 | 01186 | 中国铁建     | 500    | 2,135.00  | 0.01 |
| 133 | 01516 | 融创服务     | 64     | 1,536.64  | 0.00 |

注：所用证券代码采用当地市场代码。

### 7.3.2 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码  | 股票名称   | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|-------|--------|--------------|-----------------|
| 1  | 00700 | 腾讯控股   | 6,928,846.85 | 70.96           |
| 2  | 03690 | 美团-W   | 5,366,254.79 | 54.96           |
| 3  | 00005 | 汇丰控股   | 2,792,229.86 | 28.60           |
| 4  | 01299 | 友邦保险   | 2,711,789.96 | 27.77           |
| 5  | 00388 | 香港交易所  | 2,555,145.24 | 26.17           |
| 6  | 01810 | 小米集团-W | 2,127,173.73 | 21.78           |
| 7  | 00939 | 建设银行   | 2,037,217.03 | 20.86           |
| 8  | 02318 | 中国平安   | 1,703,840.74 | 17.45           |
| 9  | 02269 | 药明生物   | 1,513,886.75 | 15.50           |
| 10 | 00175 | 吉利汽车   | 1,227,704.10 | 12.57           |
| 11 | 00941 | 中国移动   | 1,203,754.22 | 12.33           |

|    |       |        |              |       |
|----|-------|--------|--------------|-------|
| 12 | 01398 | 工商银行   | 1,115,698.27 | 11.43 |
| 13 | 03968 | 招商银行   | 1,079,928.13 | 11.06 |
| 14 | 02382 | 舜宇光学科技 | 981,318.42   | 10.05 |
| 15 | 02313 | 申洲国际   | 944,153.83   | 9.67  |
| 16 | 01211 | 比亚迪股份  | 881,738.98   | 9.03  |
| 17 | 06969 | 思摩尔国际  | 868,391.56   | 8.89  |
| 18 | 00669 | 创科实业   | 846,528.01   | 8.67  |
| 19 | 00883 | 中国海洋石油 | 841,503.11   | 8.62  |
| 20 | 01801 | 信达生物   | 774,526.28   | 7.93  |
| 21 | 02333 | 长城汽车   | 711,044.35   | 7.28  |
| 22 | 00241 | 阿里健康   | 700,363.20   | 7.17  |
| 23 | 00968 | 信义光能   | 680,462.80   | 6.97  |
| 24 | 01109 | 华润置地   | 679,286.18   | 6.96  |
| 25 | 00884 | 旭辉控股集团 | 679,284.33   | 6.96  |
| 26 | 00992 | 联想集团   | 676,379.46   | 6.93  |
| 27 | 06186 | 中国飞鹤   | 674,906.16   | 6.91  |
| 28 | 00268 | 金蝶国际   | 632,236.15   | 6.47  |
| 29 | 02601 | 中国太保   | 619,951.90   | 6.35  |
| 30 | 01999 | 敏华控股   | 602,823.83   | 6.17  |
| 31 | 01918 | 融创中国   | 600,552.03   | 6.15  |
| 32 | 01658 | 邮储银行   | 590,721.93   | 6.05  |
| 33 | 02359 | 药明康德   | 585,513.99   | 6.00  |
| 34 | 02319 | 蒙牛乳业   | 578,253.05   | 5.92  |
| 35 | 03888 | 金山软件   | 574,208.37   | 5.88  |
| 36 | 00688 | 中国海外发展 | 546,301.01   | 5.59  |
| 37 | 00016 | 新鸿基地产  | 543,884.00   | 5.57  |
| 38 | 03759 | 康龙化成   | 505,219.99   | 5.17  |
| 39 | 00288 | 万洲国际   | 485,552.11   | 4.97  |
| 40 | 00291 | 华润啤酒   | 472,302.70   | 4.84  |
| 41 | 03606 | 福耀玻璃   | 471,783.27   | 4.83  |
| 42 | 01833 | 平安好医生  | 468,411.91   | 4.80  |
| 43 | 01579 | 颐海国际   | 454,055.04   | 4.65  |
| 44 | 02331 | 李宁     | 453,142.21   | 4.64  |
| 45 | 03908 | 中金公司   | 442,590.91   | 4.53  |
| 46 | 06098 | 碧桂园服务  | 435,174.09   | 4.46  |
| 47 | 02688 | 新奥能源   | 431,185.34   | 4.42  |
| 48 | 01995 | 旭辉永升服务 | 421,383.18   | 4.32  |
| 49 | 00881 | 中升控股   | 417,324.78   | 4.27  |
| 50 | 00960 | 龙湖集团   | 416,709.99   | 4.27  |
| 51 | 03692 | 翰森制药   | 416,110.16   | 4.26  |
| 52 | 02013 | 微盟集团   | 407,000.17   | 4.17  |
| 53 | 00826 | 天工国际   | 395,411.83   | 4.05  |
| 54 | 02883 | 中海油田服务 | 389,048.04   | 3.98  |
| 55 | 00322 | 康师傅控股  | 382,602.40   | 3.92  |

|    |       |             |            |      |
|----|-------|-------------|------------|------|
| 56 | 00066 | 港铁公司        | 377,141.08 | 3.86 |
| 57 | 00001 | 长和          | 371,450.32 | 3.80 |
| 58 | 01997 | 九龙仓置业       | 360,833.22 | 3.70 |
| 59 | 02628 | 中国人寿        | 356,233.98 | 3.65 |
| 60 | 00011 | 恒生银行        | 355,732.24 | 3.64 |
| 61 | 06690 | 海尔智家        | 351,216.60 | 3.60 |
| 62 | 02196 | 复星医药        | 344,288.09 | 3.53 |
| 63 | 03988 | 中国银行        | 341,718.87 | 3.50 |
| 64 | 06060 | 众安在线        | 333,986.69 | 3.42 |
| 65 | 06169 | 宇华教育        | 332,805.60 | 3.41 |
| 66 | 02400 | 心动公司        | 330,967.67 | 3.39 |
| 67 | 00522 | ASM PACIFIC | 330,485.94 | 3.38 |
| 68 | 00868 | 信义玻璃        | 329,273.92 | 3.37 |
| 69 | 00285 | 比亚迪电子       | 322,053.47 | 3.30 |
| 70 | 01797 | 新东方在线       | 321,243.18 | 3.29 |
| 71 | 02020 | 安踏体育        | 320,978.34 | 3.29 |
| 72 | 00002 | 中电控股        | 312,346.47 | 3.20 |
| 73 | 01928 | 金沙中国有限公司    | 311,617.50 | 3.19 |
| 74 | 00003 | 香港中华煤气      | 301,251.07 | 3.09 |
| 75 | 00631 | 三一国际        | 284,435.45 | 2.91 |
| 76 | 00880 | 澳博控股        | 281,702.21 | 2.88 |
| 77 | 00012 | 恒基地产        | 268,847.94 | 2.75 |
| 78 | 01610 | 中粮家佳康       | 267,914.43 | 2.74 |
| 79 | 02588 | 中银航空租赁      | 256,469.53 | 2.63 |
| 80 | 01055 | 中国南方航空股份    | 254,372.11 | 2.61 |
| 81 | 06862 | 海底捞         | 223,942.39 | 2.29 |
| 82 | 01117 | 现代牧业        | 223,514.67 | 2.29 |
| 83 | 01177 | 中国生物制药      | 222,829.48 | 2.28 |
| 84 | 00914 | 海螺水泥        | 210,445.69 | 2.16 |
| 85 | 01308 | 海丰国际        | 205,994.13 | 2.11 |
| 86 | 00813 | 世茂集团        | 200,297.53 | 2.05 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码  | 股票名称  | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-------|-------|--------------|--------------------|
| 1  | 00700 | 腾讯控股  | 3,802,090.18 | 38.94              |
| 2  | 03690 | 美团-W  | 3,398,550.33 | 34.80              |
| 3  | 00388 | 香港交易所 | 1,711,952.29 | 17.53              |
| 4  | 00005 | 汇丰控股  | 1,689,896.83 | 17.31              |

|    |       |        |              |       |
|----|-------|--------|--------------|-------|
| 5  | 01810 | 小米集团－W | 1,271,730.72 | 13.02 |
| 6  | 00939 | 建设银行   | 1,235,274.82 | 12.65 |
| 7  | 01299 | 友邦保险   | 1,099,887.37 | 11.26 |
| 8  | 02318 | 中国平安   | 1,040,052.27 | 10.65 |
| 9  | 00941 | 中国移动   | 975,738.62   | 9.99  |
| 10 | 02313 | 申洲国际   | 802,128.05   | 8.21  |
| 11 | 02382 | 舜宇光学科技 | 799,815.29   | 8.19  |
| 12 | 00883 | 中国海洋石油 | 689,763.25   | 7.06  |
| 13 | 00175 | 吉利汽车   | 688,476.05   | 7.05  |
| 14 | 01398 | 工商银行   | 671,055.20   | 6.87  |
| 15 | 03968 | 招商银行   | 657,101.10   | 6.73  |
| 16 | 01833 | 平安好医生  | 647,181.91   | 6.63  |
| 17 | 00669 | 创科实业   | 646,558.27   | 6.62  |
| 18 | 00884 | 旭辉控股集团 | 637,524.53   | 6.53  |
| 19 | 01918 | 融创中国   | 634,670.08   | 6.50  |
| 20 | 02269 | 药明生物   | 629,745.91   | 6.45  |
| 21 | 06969 | 思摩尔国际  | 609,309.61   | 6.24  |
| 22 | 01109 | 华润置地   | 564,024.62   | 5.78  |
| 23 | 01658 | 邮储银行   | 537,456.81   | 5.50  |
| 24 | 02601 | 中国太保   | 510,646.30   | 5.23  |
| 25 | 00992 | 联想集团   | 495,855.65   | 5.08  |
| 26 | 00688 | 中国海外发展 | 475,024.45   | 4.86  |
| 27 | 01999 | 敏华控股   | 462,080.08   | 4.73  |
| 28 | 00881 | 中升控股   | 459,820.41   | 4.71  |
| 29 | 03888 | 金山软件   | 454,759.92   | 4.66  |
| 30 | 02013 | 微盟集团   | 443,373.44   | 4.54  |
| 31 | 02628 | 中国人寿   | 425,865.50   | 4.36  |
| 32 | 01579 | 颐海国际   | 414,017.65   | 4.24  |
| 33 | 00241 | 阿里健康   | 407,729.10   | 4.18  |
| 34 | 01801 | 信达生物   | 397,168.85   | 4.07  |
| 35 | 00268 | 金蝶国际   | 386,503.91   | 3.96  |
| 36 | 00288 | 万洲国际   | 385,611.42   | 3.95  |
| 37 | 02331 | 李宁     | 374,605.17   | 3.84  |
| 38 | 00960 | 龙湖集团   | 360,722.01   | 3.69  |
| 39 | 03759 | 康龙化成   | 356,039.72   | 3.65  |
| 40 | 02883 | 中海油田服务 | 351,054.94   | 3.60  |
| 41 | 00968 | 信义光能   | 349,365.40   | 3.58  |
| 42 | 00016 | 新鸿基地产  | 347,709.65   | 3.56  |
| 43 | 00631 | 三一国际   | 347,649.02   | 3.56  |
| 44 | 00322 | 康师傅控股  | 343,561.05   | 3.52  |
| 45 | 06186 | 中国飞鹤   | 339,495.57   | 3.48  |
| 46 | 01995 | 旭辉永升服务 | 335,795.20   | 3.44  |
| 47 | 01211 | 比亚迪股份  | 334,427.83   | 3.42  |
| 48 | 01797 | 新东方在线  | 334,055.31   | 3.42  |

|    |       |       |            |      |
|----|-------|-------|------------|------|
| 49 | 02359 | 药明康德  | 325,134.19 | 3.33 |
| 50 | 02333 | 长城汽车  | 313,164.39 | 3.21 |
| 51 | 03908 | 中金公司  | 311,986.41 | 3.20 |
| 52 | 03606 | 福耀玻璃  | 286,167.02 | 2.93 |
| 53 | 00285 | 比亚迪电子 | 280,766.30 | 2.88 |
| 54 | 06862 | 海底捞   | 277,458.94 | 2.84 |
| 55 | 00868 | 信义玻璃  | 259,731.82 | 2.66 |
| 56 | 02319 | 蒙牛乳业  | 257,211.92 | 2.63 |
| 57 | 06098 | 碧桂园服务 | 251,133.44 | 2.57 |
| 58 | 02899 | 紫金矿业  | 245,902.87 | 2.52 |
| 59 | 03692 | 翰森制药  | 239,309.76 | 2.45 |
| 60 | 09909 | 宝龙商业  | 239,064.34 | 2.45 |
| 61 | 02196 | 复星医药  | 229,318.42 | 2.35 |
| 62 | 00880 | 澳博控股  | 216,326.72 | 2.22 |
| 63 | 00291 | 华润啤酒  | 206,874.18 | 2.12 |
| 64 | 00011 | 恒生银行  | 198,792.19 | 2.04 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 70,323,260.00 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 41,794,866.84 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 16,416.74    |
| 2  | 应收证券清算款 | 782,241.86   |
| 3  | 应收股利    | 191,920.14   |
| 4  | 应收利息    | 297.85       |
| 5  | 应收申购款   | 43,628.98    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,034,505.57 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构     |            |               |            |
|----------|---------------|-----------|------------|---------------|------------|
|          |               | 机构投资者     |            | 个人投资者         |            |
|          |               | 持有份额      | 占总份额<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 4,901    | 6,266.49      | 23,555.00 | 0.08%      | 30,688,512.85 | 99.92%     |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例 |
|----|-------|------------|----------|
| 1  | 邵常红   | 726,055.00 | 8.47%    |
| 2  | 卜勤学   | 443,362.00 | 5.17%    |
| 3  | 高敬意   | 400,000.00 | 4.67%    |
| 4  | 杨凯    | 313,802.00 | 3.66%    |
| 5  | 刘江辉   | 265,391.00 | 3.10%    |
| 6  | 朱奕炯   | 200,000.00 | 2.33%    |
| 7  | 李锐    | 156,600.00 | 1.83%    |
| 8  | 李运超   | 148,300.00 | 1.73%    |
| 9  | 韩金亮   | 143,700.00 | 1.68%    |
| 10 | 周小知   | 143,624.00 | 1.68%    |

注：上述份额均为场内份额，持有人均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 89,768.85 | 0.29%    |

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 11 月 6 日）基金份额总额 | 226,064,924.81 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 8,134,663.92   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 64,919,729.37  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 42,342,325.44  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 30,712,067.85  |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 3 月 31 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过，张伟先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》，经本基金管理人股东会审议通过，对本基金管理人董事会成员进行了调整。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|        |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 招商证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 万联证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 财通证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 德邦证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券   | 4      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券   | 3      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券华南 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司   | 1      | 97,213,203.94 | 86.71%       | 58,327.97 | 86.71%     | -  |
| 瑞银证券   | 1      | 14,904,922.90 | 13.29%       | 8,942.98  | 13.29%     | -  |

注：基金租用席位的选择标准是：

- （1）资力雄厚，信誉良好；
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （3）经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （5）公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易         |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|--------|--------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 西南证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 万联证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 财通证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 德邦证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 川财证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 太平洋证券  | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券华南 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国盛证券   | 1,205,976.00 | 100.00%      | -    | -            | -    | -            |
| 中金公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 瑞银证券   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                    | 法定披露方式                 | 法定披露日期     |
|----|-----------------------------------------|------------------------|------------|
| 1  | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）溢价风险提示公告            | 《中国证券报》                | 2021-01-21 |
| 2  | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》                | 2021-02-04 |
| 3  | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》                | 2021-03-30 |
| 4  | 国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2021-03-31 |
| 5  | 国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告                    | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2021-03-31 |
| 6  | 国泰基金管理有限公司董事变更公告                        | 《中国证券报》                | 2021-04-01 |
| 7  | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 《上海证券报》                | 2021-04-26 |
| 8  | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》                | 2021-05-14 |
| 9  | 国泰基金管理有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履职的公告          | 《中国证券报》                | 2021-06-26 |
| 10 | 国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》                | 2021-06-28 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）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

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇二一年八月三十一日