

# 国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰中证新能源汽车 ETF                                                          |
| 场内简称       | 新能车                                                                    |
| 基金主代码      | 159806                                                                 |
| 交易代码       | 159806                                                                 |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2020 年 3 月 10 日                                                        |
| 报告期末基金份额总额 | 652,696,482.00 份                                                       |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                             |
| 投资策略       | 1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、融资与转融通证券出借投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中证新能源汽车指数收益率                                                           |

|        |                                                                                                                            |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证新能源汽车指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p> |
| 基金管理人  | 国泰基金管理有限公司                                                                                                                 |
| 基金托管人  | 上海浦东发展银行股份有限公司                                                                                                             |

### § 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>(2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |
|-----------------|-----------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 234,713,603.08                          |
| 2. 本期利润         | 249,825,417.24                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.3769                                  |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,006,301,842.09                        |
| 5. 期末基金份额净值     | 3.0739                                  |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

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

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|

|            |         |       |         | ④     |        |        |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月      | 13.63%  | 2.90% | 13.09%  | 2.93% | 0.54%  | -0.03% |
| 过去六个月      | 65.79%  | 2.60% | 64.82%  | 2.63% | 0.97%  | -0.03% |
| 过去一年       | 120.30% | 2.57% | 117.97% | 2.60% | 2.33%  | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 207.39% | 2.40% | 156.72% | 2.48% | 50.67% | -0.08% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 3 月 10 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：本基金的合同生效日为2020年3月10日。本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年 | 说明 |
|----|----|-------------|-------|----|
|----|----|-------------|-------|----|

|     |                                                                                                                                                                                                 | 任职日期       | 离任日期 | 限    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 徐成城 | 国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、<br>国泰中证煤炭 ETF、<br>国泰中证钢铁 ETF、<br>国泰中证全指家用电器 ETF、<br>国泰中证新能源汽车 ETF、<br>国泰中证动漫游戏 ETF、<br>国泰中证细分机械设备产业主题 ETF、<br>国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、<br>国泰中证细分机械设备产业主题 ETF 联接、<br>国泰中证有色金属 | 2020-03-10 | -    | 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 月至 2021 年 7 月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 月至 2021 年 7 月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联接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和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资 |

|  |                                                                                  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|----------------------------------------------------------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | ETF、国泰中证动漫游戏 ETF 联接、国泰中证光伏产业 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF 发起联接、国泰中证有色金属 ETF 发起联接的基金经理 |  |  | 基金的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 7 月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和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 月至 2021 年 7 月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发起式联接基金和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的基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 7 月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，2021 年 2 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任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和国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任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、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理,2021 年 7 月起兼任国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2021 年 8 月起兼任国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2021 年三季度，包括我国在内的全球经济持续复苏，国内多数大宗商品价格见顶，通胀压力有一定的缓解。但较高的成本和产业链利润分配的不均，仍主导着上市企业在三季度业绩的表现。叠加反垄断、控能耗等产业政策的影响，A 股在基本面和情绪面的驱动下，整体呈现涨跌反复的震荡态势。从宽基指数表现来看，上证综指三季度微跌 0.64%，沪深 300 指数下跌约 6.85%，创业板和科创 50 指数分别下跌 6.69% 和 13.82%。从成交额来看，A 股三季度日均成交额已达 1 万亿以上，较上半年有明显提升。外资方面，尽管未能达到二季度的净流入水平，三季度的北向资金累计净买入也达到了近 700 亿，并呈现前低后高的趋势。分行业来看，三季度申万一级行业中，煤炭采掘行业以超过 36% 的涨幅居 28 个行业之首，有色、公用事业、钢铁、电气设备和化工行业也在三季度斩获 10% 至 30% 的涨幅；跌幅居前的则是以大消费为代表的休闲服务、医药、食品和传媒等行业。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 13.63%，同期业绩比较基准收益率为 13.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，四季度 A 股市场仍将处于基本面和政策面的双重影响下：一方面，随着全球经济复苏叠流动性宽松仍将持续至年底，A 股在盈利和资金的推动下，仍会处于上升区间；但另一方面，随着通胀的上升，政策整体趋紧的可能性正在累积，“双限”、“双控”政策的过度执行或将导致对经济的负面影响；此外，部分房企债务问题的解决与否，也将一定程度上影响市场的风险偏好。因此，震荡上行或将成为四季度 A 股市场的主要表现。行业方面，景气度较高的新能源和周期行业或将持续强势表现，而大消费行业也具备估值和情绪修复的空间。风格加速切换，或将成为四季度 A 股市场的常态。

新能源汽车行业是近期较为热门的投资主题，全球汽车产业在近十年都经历了从无到有的电动化浪潮，我国的新能源汽车产业在政策的大力支持下已初步具备全球竞争力，欧洲市场的新能源汽车也在补贴的刺激下销量不断上升。当前，新能源汽车产业加速趋势依然明显，行业发展空间仍然巨大。一方面，从政策层面上看，国内双积分政策、退补暂缓和欧洲碳排放方案等措施，都会驱动新能源汽车加速发展，而特斯拉、大众 MEB 平台等优质车型的陆续推出，将从供给侧来创造新需求；另一方面，从发展阶段来看，新能源汽车行业仍处于爆发初期，当前渗透率低，未来 10 年空间巨大。其中动力电池、电机电控等特有零部件、上游材料等需求预料将持续增长；最后，从投资的角度来看，围绕龙头供应链中具备全球竞争力的国内企业进行资产配置，更有望获得超额收益。投资者可积极利用国泰中证新能源汽车 ETF 基金，积极把握行业投资机会。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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              | 1,996,540,574.79 | 99.18        |
|    | 其中：股票             | 1,996,540,574.79 | 99.18        |
| 2  | 固定收益投资            | —                | —            |
|    | 其中：债券             | —                | —            |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —            |

|   |              |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 14,693,823.50    | 0.73   |
| 7 | 其他各项资产       | 1,783,466.92     | 0.09   |
| 8 | 合计           | 2,013,017,865.21 | 100.00 |

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为106,170,368.00元，占基金资产净值比例为5.29%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 5,766.30     | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 3,740,008.62 | 0.19         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | 20,183.39    | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 77,729.83    | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 3,345.12     | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 749,253.00   | 0.04         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 674,114.49   | 0.03         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 77,273.94    | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 8,952.62     | 0.00         |

|   |    |              |      |
|---|----|--------------|------|
| S | 综合 | -            | -    |
|   | 合计 | 5,356,627.31 | 0.27 |

## 5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 1,991,040,809.48 | 99.24        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -                | -            |
| J  | 金融业              | -                | -            |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -                | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 1,991,040,809.48 | 99.24        |

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|----------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 379,218 | 199,366,279.14 | 9.94         |

|    |        |      |           |                |      |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 2  | 002594 | 比亚迪  | 754,585   | 188,276,503.35 | 9.38 |
| 3  | 002812 | 恩捷股份 | 549,029   | 153,794,003.48 | 7.67 |
| 4  | 002460 | 赣锋锂业 | 901,101   | 146,825,396.94 | 7.32 |
| 5  | 300014 | 亿纬锂能 | 1,208,353 | 119,663,197.59 | 5.96 |
| 6  | 300124 | 汇川技术 | 1,695,656 | 106,826,328.00 | 5.32 |
| 7  | 002709 | 天赐材料 | 647,720   | 98,531,166.40  | 4.91 |
| 8  | 300450 | 先导智能 | 1,086,910 | 75,888,056.20  | 3.78 |
| 9  | 002340 | 格林美  | 5,427,986 | 60,684,883.48  | 3.02 |
| 10 | 002074 | 国轩高科 | 1,213,200 | 57,614,868.00  | 2.87 |

### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 688187 | 时代电气 | 33,865 | 1,472,788.85 | 0.07         |
| 2  | 688779 | 长远锂科 | 43,086 | 806,569.92   | 0.04         |
| 3  | 688083 | 中望软件 | 1,837  | 729,289.00   | 0.04         |
| 4  | 688131 | 皓元医药 | 1,955  | 654,670.85   | 0.03         |
| 5  | 688626 | 翔宇医疗 | 3,652  | 211,450.80   | 0.01         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国轩高科”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

国轩高科公司自身因业绩预测结果不准确或不及时，未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责等原因，受到当地证监局责令改正等监管处罚。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 736,528.73   |
| 2  | 应收证券清算款 | 977,875.98   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 69,062.21    |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 1,783,466.92 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值(元) | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明         |
|----|--------|------|--------------------|------------------|----------------------|
| 1  | 002812 | 恩捷股份 | 11,092,752.00      | 0.55             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 8,912,818.00       | 0.44             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 3  | 002594 | 比亚迪  | 7,610,055.00       | 0.38             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 4  | 002709 | 天赐材料 | 7,149,640.00       | 0.36             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 5  | 300014 | 亿纬锂能 | 7,110,354.00       | 0.35             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 6  | 300750 | 宁德时代 | 5,835,603.00       | 0.29             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 7  | 300450 | 先导智能 | 4,475,462.00       | 0.22             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 8  | 300124 | 汇川技术 | 4,032,000.00       | 0.20             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 9  | 002074 | 国轩高科 | 3,229,320.00       | 0.16             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |
| 10 | 002340 | 格林美  | 916,760.00         | 0.05             | 转融通证券<br>出借业务的<br>股票 |

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值(元) | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|------|------|--------------------|------------------|--------------|
|----|------|------|--------------------|------------------|--------------|

|   |        |      |              |      |      |
|---|--------|------|--------------|------|------|
| 1 | 688187 | 时代电气 | 1,472,788.85 | 0.07 | 新股锁定 |
| 2 | 688779 | 长远锂科 | 806,569.92   | 0.04 | 新股锁定 |
| 3 | 688131 | 皓元医药 | 654,670.85   | 0.03 | 新股锁定 |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |                |
|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 601,696,482.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 329,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 278,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | —              |
| 本报告期期末基金份额总额   | 652,696,482.00 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别           | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |                |               | 报告期末持有基金情况     |        |
|-----------------|----------------|-------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|--------|
|                 | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间  | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额          | 持有份额           | 份额占比   |
| 国泰中证新能源汽车交易型开放式 | 1              | 2021年07月01日至2021年09月30日 | 206,617,300.00 | 122,341,400.00 | 55,326,506.00 | 273,632,194.00 | 41.92% |

|                                                               |  |  |  |  |  |  |  |
|---------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|
| 指数证券投资基金发起式联接基金                                               |  |  |  |  |  |  |  |
| 产品特有风险                                                        |  |  |  |  |  |  |  |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |  |  |  |  |  |  |  |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000，400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日