

国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基 金

2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年四月二十二日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 4 月 20 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 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰富时中国国企开放共赢 ETF
场内简称	共赢 ETF
基金主代码	517090
交易代码	517090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 17 日
报告期末基金份额总额	57,074,975.00 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：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股

	权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	富时中国国企开放共赢指数（FTSE China SOE Sustainable Prosperity Index）收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，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。 本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 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
	(2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)
1. 本期已实现收益	3,899,589.49
2. 本期利润	5,339,286.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1608
4. 期末基金资产净值	58,552,589.27
5. 期末基金份额净值	1.0259

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

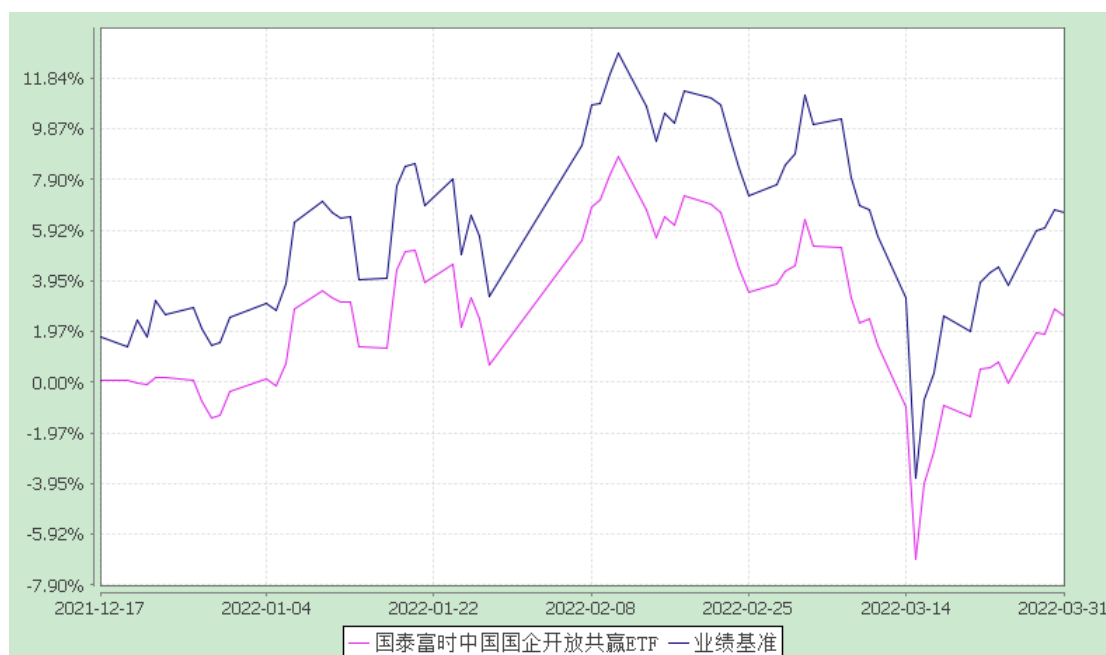
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.94%	1.58%	3.97%	1.78%	-1.03%	-0.20%
自基金合同生效起至今	2.59%	1.45%	6.59%	1.66%	-4.00%	-0.21%

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

国泰富时中国国企开放共赢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

(2021 年 12 月 17 日至 2022 年 3 月 31 日)



注：（1）本基金的合同生效日为2021年12月17日，截止至2022年3月31日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁杏	国泰中证生物医药ETF联接、国泰国证医药卫生行业指数、国泰国证食品	2021-12-17	-	15 年	学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 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

	饮料行业指数、国泰量化收益灵活配置混合、国泰中证生物医药 ETF、国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接、国泰上证综合 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证畜牧养殖 ETF、国泰中证医疗 ETF 联接、国泰中证全指软件 ETF 联接、国泰中证畜牧养殖 ETF 联接、国泰中证沪港深创新药产业 ETF、国				金的基金经理，2018 年 1 月至 2019 年 4 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月起兼任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月起兼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，2019 年 11 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（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）的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 1 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、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、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任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
--	---	--	--	--	---

	泰中证沪港深创新药产业 ETF 发起联接、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF 的基金经理、国泰中证港股通科技 ETF 的基金经理，量化投资（事业）部总监				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 1 月至 2022 年 2 月任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的基金经理，2021 年 2 月至 2022 年 2 月任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月起兼任国泰中证畜牧养殖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的基金经理，2021 年 7 月起兼任国泰中证畜牧养殖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 9 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业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 12 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金和国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资（事业）部副总监，2018 年 7 月起任量化投资（事业）部总监。
--	---	--	--	--	---

徐成城	国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF 联接、国泰中证有色金属 ETF、国	2021-12-17	-	16 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基金的基金经理，2020 年 1
-----	---	------------	---	------	--

	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、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF 的基金经理			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，2021 年 10 月起兼任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月起兼任国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年一季度，A 股市场呈现了较为明显的下跌走势：上证指数下跌 10.65%，沪深 300 指数下挫 14.53%，以大盘蓝筹为代表的上证 50 指数一季度下跌 11.47%，而以科技成长为代表的创业板指数和科创 50 指数的跌幅则分别为 19.96% 和 21.97%。一季度市场下跌的三个主要因素是：疫情冲击国内经济、美联储加息和俄乌冲突引发的通胀上行。首先，从国内经济情况来看，尽管一季度统计局的数据显示国内一至二月份在消费、进出口和固定资产投资增速方面都有不错表现，但三月份全国爆发的新一轮疫情，使得很多城市被迫采取严格的封控措施，其中不乏经济较为发达的城市。这些措施会对国内消费产生抑制，并在短期影响实体经济；其次，从美联储加息来看，3 月中旬的加息开启了流动性收紧的周期，中美利差的不断收窄，也引发了部分外资留出 A 股；最后，从俄乌冲突来看，这不仅是一次严重的地缘政治危机，也在冲击全球供应链导致通胀上行和避险情绪抬升等方面，对全球金融市场产生了负面影响。分行业来看，申万一级行业中的煤炭和房地产行业涨幅居前，主要原因在于供给不足导致的能源价格提升和房地产政策边际预期改善；而电子、国防军工和汽车等行业的跌幅较大，则是由通胀导致的成本提升、全球利率调整带来的成长板块估值下行等原因造成。而港股方面，今年以来受到国内政策监管趋严、中美法规制度博弈以及地缘冲突得影响，一季度港股表现较弱，三月份更是出现了一轮由中资股引发得集体快速下跌。

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 2.94%，同期业绩比较基准收益率为 3.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，尽管俄乌冲突还在持续，但对全球金融市场的冲击正在逐渐消退，未来随着冲突的缓和，前期大幅上涨的原油、有色金属和农产品等大宗商品的价格也会大概率会有所回落，减轻实体经济的成本压力。美联储方面，由于市场对加息的预期已经很高，第一次加息靴子落地后，市场已经消化了大部分加息预期，年内其他加息对全球市场的影响或逐步减少。国内方面，如果疫情能在短期内得到控制，随着今年稳增长政策持续发力、固定资产投资的增加以及内需的逐步改善，会不断增加中国经济的韧性，全年 5.5% 的 GDP 增长目标仍能实现。而企业盈利如果能在今年二季度后企稳回升，会使得 A 股在 2022 年仍然存在较强的正收益预期。从更长的时期来看，我国居民资产配置持续变化，权益资产权重逐年上升，让 A 股获得了长期且稳定的系统性资金支持，进一步强化了 A 股的长期配置价值。

港股方面，尽管目前由于美联储加息、政治博弈和国内反垄断等因素的存在，对港股市场形成了较强的压力。但由于标的的稀缺性，香港市场依然吸引着内地的南下资金和全球配置型投资者。随着外部环境不确定性增大，海外上市的互联网科技等新经济成长中概股将掀起回归潮，并且大多都会选择香港市场作为二次上市的场地。更多优质中概股回港上市已在不断拓宽互联网科技等新经济方向的投资版图。当前港股市场对国内外风险较为敏感，但平均市盈率仅在 10 倍左右，处于历史低位，向下空间较为有限。未来随着风险释放和市场信心修复，港股的配置价值未来将进一步被强化。富时中国国企开放共赢指数基本覆盖国家重点发展领域，反映了沪港深三地市场具有开放共赢概念的上市公司股票的整体表现，投资者或可积极利用国泰富时中国国企开放共赢 ETF，积极把握三地市场上市国企的投资机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2022 年 01 月 12 日至 2022 年 03 月 24 日期间存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	56,121,427.82	95.72
	其中：股票	56,121,427.82	95.72
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	2,444,590.86	4.17
7	其他各项资产	67,586.63	0.12
8	合计	58,633,605.31	100.00

注：1、上述股票投资包括可退替代款估值增值。

2、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17,303,639.62元，占基金资产净值比例为29.55%。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	13,952,282.32	23.83
C	制造业	3,590,506.00	6.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,911,425.88	6.68
E	建筑业	13,783,777.00	23.54

F	批发和零售业	174,528.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	420,065.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,432,654.00	2.45
J	金融业	77,130.00	0.13
K	房地产业	1,475,420.00	2.52
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	38,817,788.20	66.30

5.2.3 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（%）
房地产	4,162,630.48	7.11
工业	2,613,139.10	4.46
公用事业	2,210,910.58	3.78
原材料	1,372,293.80	2.34
医疗保健	828,320.19	1.41
能源	452,932.86	0.77
信息技术	0.00	0.00
日常消费品	0.00	0.00
非消日常生活用品	57,322.19	0.10
通信服务	5,606,090.42	9.57
金融	0.00	0.00
合计	17,303,639.62	29.55

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	601857	中国石油	1,303,041	7,192,786.32	12.28
2	601668	中国建筑	956,100	5,201,184.00	8.88
3	00941	中国移动	84,000	3,688,960.09	6.30
4	601088	中国神华	105,800	3,149,666.00	5.38
5	01109	华润置地	104,000	3,078,593.96	5.26
6	601390	中国中铁	508,300	3,065,049.00	5.23
7	600028	中国石化	659,200	2,847,744.00	4.86
8	601186	中国铁建	307,300	2,353,918.00	4.02
9	600050	中国联通	357,200	1,275,204.00	2.18
9	00762	中国联通	104,000	328,102.21	0.56
10	00836	华润电力	104,000	1,243,245.89	2.12

注：所有证券代码采用当地市场代码。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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	67,586.63
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	67,586.63

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	192,074,975.00
报告期期间基金总申购份额	59,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	194,000,000.00
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	57,074,975.00

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	45,000,000.00
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	45,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	78.84

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	强制调增	2022-03-25	45,000,000.00	44,985,500.10	-
合计			45,000,000.00	44,985,500.10	

注：本基金管理人于本报告期内强制调增本基金的适用费用为9,002.08元。

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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
机构	1	2022 年 03 月 25 日至 2022 年 03 月 31 日	—	45,000,000.00	—	45,000,000.00	78.84%
	2	2022 年 02 月 24 日至 2022 年 02 月 24 日	1,003,506.00	7,673,200.00	7,376,200.00	1,300,506.00	2.28%
	3	2022 年 01 月 13 日至 2022 年 03 月 23 日	7,203,337.00	65,383,673.00	67,940,147.00	4,646,863.00	8.14%
	4	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 01 月 06 日	40,000,277.00	—	40,000,277.00	—	—
个人	1	2022 年 01 月 11 日至 2022 年 01 月 12 日	9,662,200.00	67,049,800.00	76,712,000.00	—	—
	2	2022 年 01 月 07 日至 2022 年 01 月 07 日	7,000,000.00	20,021,077.00	27,021,077.00	—	—
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、关于准予国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

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
二〇二二年四月二十二日