

# 国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 10 月 24 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。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，投票表决起止时间为自 2022 年 4 月 15 日起至 2022 年 7 月 26 日 17:00 止。本次大会审议了《关于国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）调整 A 类基金份额的场外赎回费率的议案》。本次会议议案于 2022 年 7 月 27 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“根据《基金法》、《运作办法》和本基金基金合同的有关规定，同意调整本基金 A 类基金份额的场外赎回费率。为实施本基金调整 A 类基金份额场外赎回费率的方案，同意授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于确定调整 A 类基金份额的场外赎回费率的具体时间，对国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书、基金产品资料概要进行修改等。”修改内容自 2022 年 7 月 29 日起正式生效，本基金自该日起执行调整后的赎回费率（即自该日起提出的赎回申请适用调整后的赎回费率）。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 7 月 28 日披露的《国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|      |                     |
|------|---------------------|
| 基金简称 | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF） |
| 场内简称 | 国泰融丰                |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                             |                      |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|
| 基金主代码           | 501017                                                                                                                                                                                                                                                      |                      |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                      |                      |
| 基金合同生效日         | 2016 年 5 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                             |                      |
| 报告期末基金份额总额      | 743,642,101.13 份                                                                                                                                                                                                                                            |                      |
| 投资目标            | 深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的外延式增长的投资机会，在积极把握宏观经济和 market 发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益。                                                                                                                                                             |                      |
| 投资策略            | <p>在有效控制风险的前提下，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，在积极把握宏观经济和 market 发展趋势的基础上，将股权变动、资产重组等上市公司外延增长活动作为投资的主线，通过股票与债券等资产的合理配置，力争基金资产的持续稳健增值。</p> <p>本基金主要投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、个股精选投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益类投资工具投资策略；5、股指期货交易策略；6、中小企业私募债投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、权证投资策略。</p> |                      |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%                                                                                                                                                                                                                             |                      |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。                                                                                                                                                                                            |                      |
| 基金管理人           | 国泰基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                  |                      |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                  |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A                                                                                                                                                                                                                                        | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C |
| 下属分级基金的交易代码     | 501017                                                                                                                                                                                                                                                      | 015017               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 738,433,532.81 份                                                                                                                                                                                                                                            | 5,208,568.32 份       |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日) |                          |
|----------------|-----------------------------------------|--------------------------|
|                | 国泰融丰外延增长灵活<br>配置混合（LOF）A                | 国泰融丰外延增长灵活<br>配置混合（LOF）C |
|                |                                         |                          |
| 1.本期已实现收益      | 6,174,156.17                            | 32,293.16                |
| 2.本期利润         | -8,154,009.35                           | -67,672.08               |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0116                                 | -0.0154                  |
| 4.期末基金资产净值     | 852,825,037.06                          | 5,998,863.10             |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1549                                  | 1.1517                   |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

#### 3.2 基金净值表现

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

###### 1、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A：

| 阶段           | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④    |
|--------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月        | -0.93%     | 0.22%         | -8.79%         | 0.53%                 | 7.86%  | -0.31% |
| 过去六个月        | 0.04%      | 0.25%         | -4.89%         | 0.71%                 | 4.93%  | -0.46% |
| 过去一年         | 0.84%      | 0.26%         | -11.78%        | 0.70%                 | 12.62% | -0.44% |
| 过去三年         | 35.81%     | 0.37%         | 6.50%          | 0.76%                 | 29.31% | -0.39% |
| 自基金转型<br>起至今 | 22.43%     | 0.52%         | 7.78%          | 0.77%                 | 14.65% | -0.25% |

###### 2、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C：

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①－③ | ②－④ |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

|             | ①      | 标准差②  | 准收益率③  | 准收益率标准差④ |       |        |
|-------------|--------|-------|--------|----------|-------|--------|
| 过去三个月       | -1.04% | 0.22% | -8.79% | 0.53%    | 7.75% | -0.31% |
| 过去六个月       | -0.16% | 0.25% | -4.89% | 0.71%    | 4.73% | -0.46% |
| 自新增 C 类份额以来 | -0.16% | 0.28% | -8.97% | 0.79%    | 8.81% | -0.51% |

### 3.2.2 自基金转型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

国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 11 月 27 日至 2022 年 9 月 30 日)

#### 1. 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A:



注：（1）本基金合同生效日为 2016 年 5 月 26 日。根据基金合同和国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书的有关规定，本基金的封闭期自 2016 年 5 月 26 日起至 2017 年 11 月 26 日止，自 2017 年 11 月 27 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”；

（2）本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的建仓期为 3 个月，在 3 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

#### 2. 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C:



注：（1）本基金合同生效日为 2016 年 5 月 26 日。根据基金合同和国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书的有关规定，本基金的封闭期自 2016 年 5 月 26 日起至 2017 年 11 月 26 日止，自 2017 年 11 月 27 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”；

（2）本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的建仓期为 3 个月，在 3 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（3）自 2022 年 2 月 14 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                    | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                |
|-----|-----------------------|-------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                       | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                   |
| 樊利安 | 国泰浓益灵活配置混合、国泰民益灵活配置混合 | 2017-11-27  | -    | 16 年   | 硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资 |

|  |                                                                                        |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>（LOF）、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）、国泰宏益一年持有期混合、国泰同益 18 个月持有期混合、国泰浩益混合、国泰科创板两年定期开放混合的基金经理</p> |  |  | <p>基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2019 年 1 月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2020 年 5 月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2019 年 12 月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2018 年 2 月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 1 月任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）的基金经理，2016 年 5 月至 2017 年 11 月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 12 月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2019 年 12 月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2020 年 5 月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 6 月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 8 月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 9 月任国泰丰益</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 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，2017 年 11 月起兼任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）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2020 年 8 月任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）的基金经理，2019 年 5 月至 2020 年 6 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 10 月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月起兼任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月至 2022 年 2 月任国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金的</p> |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰浩益混合型证券投资基金（由国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金变更而来）和国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月至 2019 年 7 月任研究部总监。</p> |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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 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

今年三季度，市场在经历了 5、6 月份的反弹后再次出现调整。调整幅度较大的板块除了反弹较多的新能源、电子等成长股外，房地产产业链相关的建材、有色、钢铁跌幅也较大。最终上证指数下跌 11.01%，深证成指下跌 16.42%，创业板指下跌 18.56%。从申万一级行业来看，煤炭、综合、公用事业行业表现较好，其中煤炭是唯一上涨的行业，上涨 0.97%，而建筑材料、电力设备、电子等行业下跌幅度达到或接近 20%。

三季度对市场影响较大的主要是以下几个因素，一是美国通胀高企、美元持续加息、美元指数和美债收益率不断创新高打压全球市场估值，人民币持续贬值也对国内货币政策独立性形成挑战；二是经济恢复缓慢，房地产销售数据大幅下滑，新冠疫情在全国各地散发对消费产生较大影响；三是中报之后，市场预期高景气的行业下半年业绩增速难以保持；四是俄乌冲突、美国对中国科技产业制裁等不确定因素对市场情绪形成冲击。

本基金以绝对收益策略为主，在股票方面，行业配置相对均衡，三季度增加了地产、医药等股票配置，同时继续自下而上积极寻找具有自身成长逻辑的中小市值个股。债券方面，本基金主要以高等级信用债票息策略为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-0.93%，同期业绩比较基准收益率为-8.79%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-1.04%，同期业绩比较基准收益率为-8.79%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，我们以上提到的几个影响因素依然存在，但其影响可能减弱或逐步出现转机。美元加息是因为持续的高通胀，但美国劳动力市场在明年一季度出现恶化拐点的概率较高，通胀得到一定抑制之后，美元加息会停止。国内经济也面临较大困难，但随着二十大的召开，稳增长的经济政策还会持续落地，从 9 月企业中长期贷款出现较高增长可见一斑。另外随着国内市场的下跌，主要指数已经接近 4 月底水平，整体估值水平也进一步降低，处于历史相对低位水平。目前难以判断的是新冠疫情的影响，我们认为动态清零的政策短期难以改变，这将拉长疫情影响周期。

我们四季度组合配置将更加均衡，会从以下几个方面寻找机会。一个是跌出来的机会，随着成长股估值回落，部分成长逻辑没有变化，业绩增长确定性高的股票将迎来配置机会；二是地产和基建，这是提振经济的主要抓手，尤其是中央和地方国有房地产企业，竞争优势会进一步显现，

估值有提升空间；三是能源相关产业，油气、煤炭以及部分替代能源四季度仍然处于供应紧张状态。另外，消费、医药、化工等行业都存在自下而上的个股机会。债券方面，未来利率仍然处于区间振荡格局，我们维持中短久期信用债策略。

#### 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              | 117,706,739.73 | 13.65        |
|    | 其中：股票             | 117,706,739.73 | 13.65        |
| 2  | 固定收益投资            | 692,460,156.80 | 80.32        |
|    | 其中：债券             | 692,460,156.80 | 80.32        |
|    | 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          | 35,003,226.71  | 4.06         |
|    | 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      | 15,532,994.59  | 1.80         |
| 7  | 其他各项资产            | 1,401,362.03   | 0.16         |
| 8  | 合计                | 862,104,479.86 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末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              | 6,288,479.00   | 0.73  |
| C | 制造业              | 86,818,930.56  | 10.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,474,516.00   | 0.17  |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | 1,554,774.00   | 0.18  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,435,521.00   | 0.63  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,861,559.22   | 0.45  |
| J | 金融业              | 1,126,622.80   | 0.13  |
| K | 房地产业             | 4,967,307.00   | 0.58  |
| L | 租赁和商务服务业         | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | 3,901,586.15   | 0.45  |
| 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        | 2,277,444.00   | 0.27  |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 117,706,739.73 | 13.71 |

### 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  | 301035 | 润丰股份 | 129,744 | 13,333,790.88 | 1.55         |
| 2  | 688518 | 联赢激光 | 189,928 | 7,633,206.32  | 0.89         |
| 3  | 002353 | 杰瑞股份 | 138,198 | 4,303,485.72  | 0.50         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 2,100   | 3,932,250.00  | 0.46         |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 14,800  | 3,413,768.00  | 0.40         |
| 6  | 301190 | 善水科技 | 168,389 | 3,342,521.65  | 0.39         |
| 7  | 600188 | 兖矿能源 | 64,200  | 3,220,914.00  | 0.38         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 106,600 | 3,134,040.00  | 0.36         |
| 9  | 600026 | 中远海能 | 172,300 | 3,116,907.00  | 0.36         |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 7,600   | 3,046,764.00  | 0.35         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 46,412,637.17  | 5.40         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 251,149,182.47 | 29.24        |
| 5  | 企业短期融资券   | 20,255,488.22  | 2.36         |
| 6  | 中期票据      | 280,293,763.82 | 32.64        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 15,400,767.20  | 1.79         |
| 8  | 同业存单      | 78,948,317.92  | 9.19         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 692,460,156.80 | 80.63        |

#### 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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 102001109 | 20 中石化 MTN003 | 500,000 | 50,428,780.82 | 5.87         |
| 2  | 019666    | 22 国债 01      | 456,720 | 46,412,637.17 | 5.40         |
| 3  | 101901396 | 19 浙小商 MTN002 | 400,000 | 41,532,789.04 | 4.84         |
| 4  | 143734    | 18 金隅 02      | 400,000 | 41,199,068.49 | 4.80         |
| 5  | 163105    | 20 国君 G1      | 400,000 | 40,950,947.94 | 4.77         |

#### 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“招商证券、国泰君安、银河证券”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。

招商证券因信息披露违规，涉嫌违反证券法律法规，内部制度不完善，金融软件产品不合格，独立财务顾问业务工作期间未勤勉尽责，涉嫌违法违规，投资银行类业务尽职调查不充分等原因，受到上交所、深交所、中国证监会罚款、责令改正、没收违法所得、立案、警示函等处罚。

国泰君安及其下属分支机构因未勤勉尽责对发行人主要客户履行充分的核查程序并合并披露相关信息；部分地方营业部负责人兼任合规风控岗；信息技术、合规风控人员经办账户业务以及开户资料不完整不准确；某分公司对部分符合回访筛选标准的投顾签约投资者未进行回访、证券投资顾问服务合规管理不到位等原因，受到证监局警示函、责令改正等处罚。

银河证券下属分支机构因存在对员工客户招揽活动管理不到位，未能严格规范工作人员执业行为，内部制度不完善，未依法履行职责等问题，受到地方证监局警示、责令整改等处罚。

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 基金投资的前十名证券中，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   | 75,453.47    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,209,516.80 |
| 3  | 应收股利    | -            |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | -            |
| 5 | 应收申购款 | 116,391.76   |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 1,401,362.03 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 113052 | 兴业转债 | 8,447,405.14 | 0.98         |
| 2  | 110059 | 浦发转债 | 4,334,314.69 | 0.50         |
| 3  | 113044 | 大秦转债 | 2,533,844.57 | 0.30         |

#### 5.11.5 报告期末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 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 002353 | 杰瑞股份 | 4,303,485.72   | 0.50         | 增发中签     |

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C |
|----------------|----------------------|----------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 675,990,440.98       | 4,100,214.74         |
| 报告期期间基金总申购份额   | 152,348,246.18       | 2,322,948.87         |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 89,905,154.35        | 1,214,595.29         |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                    | -                    |
| 本报告期末基金份额总额    | 738,433,532.81       | 5,208,568.32         |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，投票表决起止时间为自 2022 年 4 月 15 日起至 2022 年 7 月 26 日 17:00 止。本次大会审议了《关于国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）调整 A 类基金份额的场外赎回费率的议案》。本次会议议案于 2022 年 7 月 27 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“根据《基金法》、《运作办法》和本基金基金合同的有关规定，同意调整本基金 A 类基金份额的场外赎回费率。为实施本基金调整 A 类基金份额场外赎回费率的方案，同意授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于确定调整 A 类基金份额的场外赎回费率的具体时间，对国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书、基金产品资料概要进行修改等。”修改内容自 2022 年 7 月 29 日起正式生效，本基金自该日起执行调整后的赎回费率（即自该日起提出的赎回申请适用调整后的赎回费率）。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 7 月 28 日披露的《国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰融丰定增灵活配置混合型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

二〇二二年十月二十六日