

国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）

2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国泰中证申万证券行业指数（LOF） |
| 场内简称 | 券商基金 LOF |
| 基金主代码 | 501016 |
| 交易代码 | 501016 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 4 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,048,560,369.82 份 |
| 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、存托凭证投资策略；3、固定收益类投资工具投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、权证投资策略。 |

| | | |
|-----------------|--|--------------------|
| 业绩比较基准 | 中证申万证券行业指数收益率×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。 | |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰中证申万证券行业指数（LOF）A | 国泰中证申万证券行业指数（LOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 501016 | 015598 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,028,894,924.84 份 | 19,665,444.98 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 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) | |
|----------------|---|------------------------|
| | 国泰中证申万证券行业 指数（LOF）A | 国泰中证申万证券行业 指数（LOF）C |
| 1.本期已实现收益 | -18,557,532.77 | -49,202.97 |
| 2.本期利润 | 110,112,275.78 | 16,780.97 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0540 | 0.0029 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,912,487,745.18 | 18,529,472.52 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9426 | 0.9422 |

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、国泰中证申万证券行业指数（LOF）A：

| 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 | 5.97% | 1.36% | 5.98% | 1.38% | -0.01% | -0.02% |
| 过去六个月 | -9.89% | 1.36% | -11.78% | 1.39% | 1.89% | -0.03% |
| 过去一年 | -24.16% | 1.56% | -26.10% | 1.58% | 1.94% | -0.02% |
| 过去三年 | -15.12% | 1.73% | -23.65% | 1.76% | 8.53% | -0.03% |
| 过去五年 | -1.72% | 1.81% | -17.70% | 1.85% | 15.98% | -0.04% |
| 自基金合同 生效起至今 | -5.74% | 1.73% | -23.59% | 1.77% | 17.85% | -0.04% |

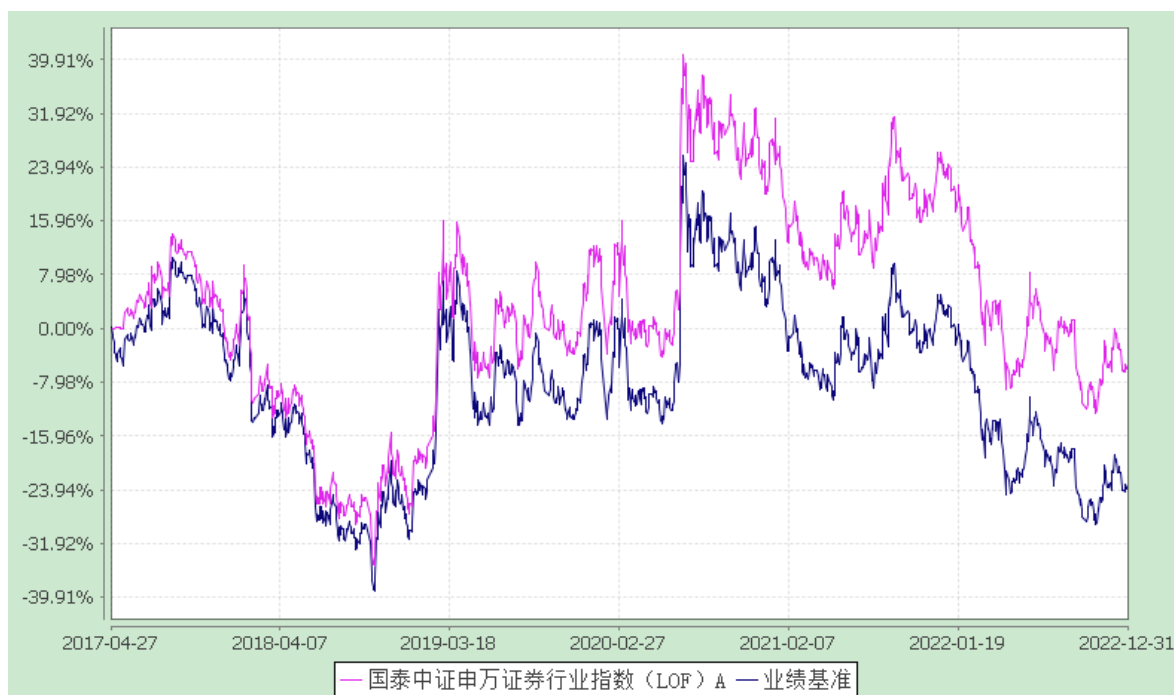
2、国泰中证申万证券行业指数（LOF）C：

| 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 | 5.92% | 1.36% | 5.98% | 1.38% | -0.06% | -0.02% |
| 过去六个月 | -9.98% | 1.36% | -11.78% | 1.39% | 1.80% | -0.03% |
| 自新增 C 类 份额起至今 | 0.47% | 1.45% | -1.75% | 1.48% | 2.22% | -0.03% |

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

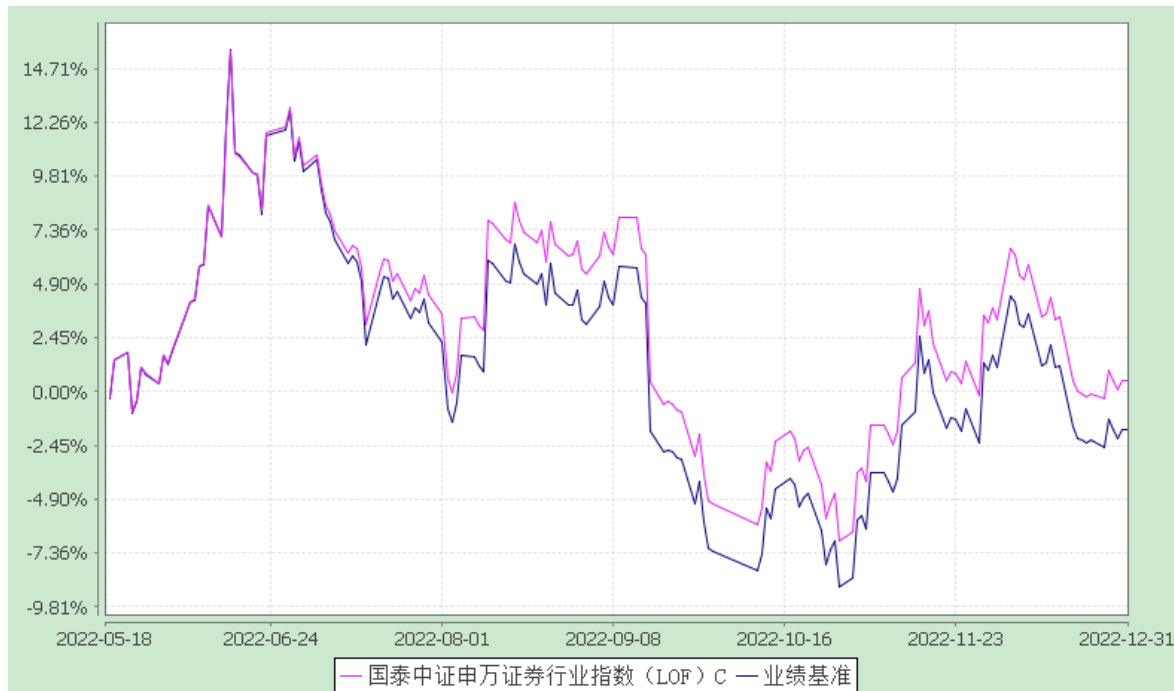
国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017 年 4 月 27 日至 2022 年 12 月 31 日)

1. 国泰中证申万证券行业指数（LOF）A：



注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰中证申万证券行业指数（LOF）C:



注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2022 年 5 月 18 日起，本基金增加 C 类份额并于 2022 年 5 月 19 日开始计算 C 类基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 期限 | | 证券从业 年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 艾小军 | 国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证 | 2017-04-27 | - | 22 年 | 硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | 航天 军工 指数 （LOF ）、国 泰中 证申 万证 券行 业指 数 （LOF ）、国 泰策 略价 值灵 活配 置混 合、芯 片 ETF、 国泰 中证 计算 机主 题 ETF、 国泰 中证 全指 通信 设备 ETF、 国泰 中证 全指 通信 设备 ETF 联 接、国 泰中 证全 指证 券公 | | | 券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|-------------------------------|--|--|--|---|
| | 司 ETF 联接的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监 | | | | CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）的基金经理，2019 年 7 月至 2021 年 1 月任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2020 年 12 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）的基金经理，2021 年 5 月起兼任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的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程总监。 |
|--|-------------------------------|--|--|--|---|

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所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

四季度全球金融市场进入美国强劲加息周期拐点，受通胀走势趋缓和良好的就业形势影响，以及史上最强加息节奏影响，美联储前瞻指引有所缓解，美元指数在 9 月底创出近年 114.16 新高以后逐步走弱，全球主要金融资产纷纷反弹；国内方面，受疫情管控放开预期影响，疫情修复板块如航空、酒店等社会服务板块纷纷走强，20 大以及中央经济工作会议对民营经济、平台经济等的支持也提升了相关板块的投资热情，管理层关于央企估值重估的表态对权重股形成了有力支撑，A 股市场震荡盘升；在美国出台芯片法案并持续对中国半导体芯片、高性能计算更大范围的打压下，包括半导体设备等国产化受益细分行业受到持续抛压；受经济悲观预期石油等能源价格走弱，前期表现较好的煤炭下跌较多。

全季度来看，上证指数震荡上涨 2.14%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数微涨 0.96%，沪深 300 指数上涨 1.75%，成长性中盘股表征指数如中证 500

上涨 2.63%，小盘股表征指数中证 1000 上涨 2.56%。板块上新能源汽车、医药医疗科技占比较多的创业板指上涨 2.53%，科创板 50 上涨 2.19%。

在行业表现上，申万一级行业中表现靠前的为社会服务、计算机、传媒，涨幅分别为 21.84%、14.18%和 14.08%，表现落后的为煤炭、石油石化、电力设备，分别下跌了 16.37%、5.12%和 3.89%。

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 5.97%，同期业绩比较基准收益率为 5.98%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 5.92%，同期业绩比较基准收益率为 5.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年是新一届政府开局之年，新冠疫情常态化放开后，包括消费在内的民营经济有望得到较大的恢复，投资者过度悲观的预期有望逐步修正，我们预计国内宏观流动性将保持合理充裕，各项稳经济政策将持续发力，经济活动恢复有望加快，整体上有利于投资者信心的修复，我们对 2023 年证券市场保持乐观。

后疫情时代，全球地缘政治纷繁复杂，地缘政治危机成为影响全球政治经济的最大的不确定性。另一方面，新冠病毒变种不确定性加大，经济恢复总体上仍然比较脆弱，尤其是在中国经济体量逐步赶超主要发达国家的进程中，主要经济体的博弈和竞争料将带来更多的不确定性。

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 | 1,795,115,663.68 | 92.78 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：股票 | 1,795,115,663.68 | 92.78 |
| 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 | 137,575,175.22 | 7.11 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,074,207.45 | 0.11 |
| 8 | 合计 | 1,934,765,046.35 | 100.00 |

注：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 38,306,250.00 元，占基金资产净值比例为 1.98%。

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 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 2,007,597.37 | 0.10 |
| 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 | 210,097.28 | 0.01 |
| 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 | 23,968.80 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 38,283.70 | 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 | 106,663.20 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 2,386,610.35 | 0.12 |

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 | — | — |
| 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 | 1,792,729,053.33 | 92.84 |
| 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 | 1,792,729,053.33 | 92.84 |

5.3 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 | 300059 | 东方财富 | 13,363,159 | 259,245,284.60 | 13.43 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 12,373,601 | 246,358,395.91 | 12.76 |
| 3 | 600837 | 海通证券 | 12,238,622 | 106,353,625.18 | 5.51 |
| 4 | 601688 | 华泰证券 | 6,527,703 | 83,162,936.22 | 4.31 |
| 5 | 601211 | 国泰君安 | 5,715,792 | 77,677,613.28 | 4.02 |
| 6 | 600999 | 招商证券 | 4,703,788 | 62,560,380.40 | 3.24 |
| 7 | 600958 | 东方证券 | 6,628,839 | 59,261,820.66 | 3.07 |
| 8 | 000776 | 广发证券 | 3,751,423 | 58,109,542.27 | 3.01 |
| 9 | 601377 | 兴业证券 | 8,759,755 | 50,280,993.70 | 2.60 |
| 10 | 000166 | 申万宏源 | 11,425,865 | 45,474,942.70 | 2.35 |

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 | 688375 | 国博电子 | 6,110 | 575,562.00 | 0.03 |
| 2 | 688475 | 萤石网络 | 20,526 | 532,239.18 | 0.03 |
| 3 | 688382 | 益方生物 | 36,208 | 466,721.12 | 0.02 |
| 4 | 688496 | 清越科技 | 12,000 | 103,800.00 | 0.01 |
| 5 | 301269 | 华大九天 | 1,168 | 102,713.92 | 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名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“华泰证券”、“招商证券”、“国泰君安”、“广发证券”、“兴业证券”、“中信证券”、“海通证券”、“东方证券”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。

华泰证券及其下属分支机构因部分场外期权合约个股挂钩标的超出当期融资融券范围、未对部分期限小于 30 天的场外期权合约出具书面合规意见书、场外期权业务相关内部制度不健全，内部流程执行不规范，未按要求进行衍生品准入管理；地方营业部内部控制不完善、营业部合规管理岗从事营销活动、营业部存在对客户的“双录”工作不完整、不全面等原因，受到证监局责令改正处罚。

招商证券及下属分支机构因信息披露违规，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，多次网络安全事件反映出公司内部管理存在漏洞、权责分配机制不完善，投资银行类业务尽职调查不充分，投资银行类业务内部控制不完善，未配备合规管理人员，未向监管部门报送财务及业务报表等原因，受到上交所、深交所、中国证监会、上海证监局罚款、责令改正、没收违法所得、立案、警示函等处罚。

国泰君安证券股份有限公司及下属分支机构因营业部负责人兼任合规风控岗；从事信息技术、合规风控的人员经办客户账户业务；部分客户开户资料存在不完整、不准确；未勤勉尽责对发行人主要客户的关联关系履行充分的核查程序并合并披露相关信息，涉诉专利涉及产品金额前后披露不一致且差异大，对发行人相关流水核查存在依赖发行人提供资料；对部分符合回访筛选标准的投顾签约投资者未进行回访；投资顾问在提供证券投资顾问服务过程中，存在通过微信及微信群向投资者发布误导性陈述的行为等原因，多次受到监管机构公开处罚。

广发证券股份有限公司下属分支机构因内部制度不完善，受到福建证监局、大连证监局对其营业部采取出具警示函的行政监督管理措施。

兴业证券下属分支机构因分公司个别员工存在替客户开展证券交易、与客户约定分享投资收益，对客户证券买卖的收益或者赔偿证券买卖的损失作出承诺的行为，受到福建证监局警示函处罚。

中信证券及下属分支机构因设立海外子公司，未报证监会批准、未按期完成境外子公司股权架构调整工作、存在境外子公司从事房地产基金管理等非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务，组织架构规范整改不力，合规经营存在问题、内部控制不完善，未能建立健全风险管理和内部控制制度，也未能有效防范和控制风险等问题，受到中国证监会、江西证监局、江苏证监局、深圳证监局警示函、责令改正等处罚。

海通证券股份有限公司因设立子公司未按规定履行或者履行完毕备案程序；通过子公司从事的商业保理业务未完成清理；境外经营机构股权架构梳理以及整改方案制定工作不认真，存在重大错漏；除涉及刑事案件或已提交上市申请项目外，海通开元国际投资有限公司以自有资金所投资（包括直接或者间接投资）境内项目未完成清理；海通国际控股有限公司的公司章程未按照《境外办法》的规定完成修订；未按期完成子公司组织架构整改，涉及未整改事项多，整改进度缓慢，反映出公司合规意识薄弱、风险管理不足、内部控制不完善等问题；存在对承销业务中涉及的部分事项尽职调查不充分等未履行勤勉尽责义务等原因，多次受到监管机构公开处罚。

东方证券因在开展股票质押业务、子公司投资等业务过程中，存在部分业务决策流于形式、风险管理不到位和内部控制不健全，在某新建具有交易功能移动 APP 存在上线测试报告不完整等问题，受到上海证监局出具警示函等处罚。

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 | 53,990.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | 218,123.35 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 1,788,797.73 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | 13,296.07 |
| 9 | 合计 | 2,074,207.45 |

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 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 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产 净值比例(%) | 流通受限 情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1 | 300059 | 东方财富 | 356,960.00 | 0.02 | 转融通证券出借业务的股票 |
| 2 | 000776 | 广发证券 | 154,900.00 | 0.01 | 转融通证券出借业务的股票 |
| 3 | 601688 | 华泰证券 | 127,400.00 | 0.01 | 转融通证券出借业务的股票 |

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 | 占基金资产 | 流通受限 |
|----|------|------|--------|-------|------|
|----|------|------|--------|-------|------|

| | | | 的公允价值 (元) | 净值比例 (%) | 情况说明 |
|---|--------|------|--------------|----------|------|
| 1 | 688375 | 国博电子 | 575,562.00 | 0.03 | 新股锁定 |
| 2 | 688382 | 益方生物 | 466,721.12 | 0.02 | 新股锁定 |
| 3 | 688496 | 清越科技 | 103,800.00 | 0.01 | 新股锁定 |
| 4 | 301269 | 华大九天 | 102,713.92 | 0.01 | 新股锁定 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国泰中证申万证券行业 指数（LOF）A | 国泰中证申万证券行业 指数（LOF）C |
|----------------|------------------------|------------------------|
| 本报告期初基金份额总额 | 2,034,594,571.74 | 1,919,379.86 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 132,593,084.09 | 21,351,140.86 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 138,292,730.99 | 3,605,075.74 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,028,894,924.84 | 19,665,444.98 |

§ 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

| 项目 | 国泰中证申万证券行业指 数（LOF）A | 国泰中证申万证券行业指 数（LOF）C |
|------------------------------|------------------------|------------------------|
| 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 | - | 103,241.79 |
| 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 | - | 103,241.79 |
| 报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例（%） | - | 0.01 |

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 | 申购 | 2022-12-16 | 103,241.79 | 100,000.00 | - |
| 合计 | | | 103,241.79 | 100,000.00 | |

注：本基金管理人于本报告期内申购本基金的适用费用为0.00元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（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

8.2 存放地点

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

基金托管人住所。

8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年一月二十日