

国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）

2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 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 2026 年 07 月 17 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 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰国证航天军工指数（LOF）
场内简称	军工基金 LOF
基金主代码	501019
交易代码	501019
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	1,258,629,614.57 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；6、融资与转融通证券

	出借投资策略。	
业绩比较基准	国证航天军工指数收益率×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	国泰国证航天军工指数（LOF）A	国泰国证航天军工指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	501019	015599
报告期末下属分级基金的份额总额	571, 509, 933. 26 份	687, 119, 681. 31 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 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	国泰国证航天军工指数 (LOF) A	国泰国证航天军工指数 (LOF) C
1.本期已实现收益	4,549,582.31	5,196,233.75
2.本期利润	4,247,676.82	10,900,954.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0073	0.0153
4.期末基金资产净值	774,178,668.21	923,376,298.41
5.期末基金份额净值	1.3546	1.3438

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、国泰国证航天军工指数（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	0.51%	1.71%	-0.78%	1.71%	1.29%	0.00%
过去六个月	-5.06%	1.95%	-6.27%	2.00%	1.21%	-0.05%
过去一年	7.08%	1.64%	4.78%	1.67%	2.30%	-0.03%
过去三年	7.91%	1.65%	4.00%	1.69%	3.91%	-0.04%
过去五年	7.55%	1.64%	0.23%	1.67%	7.32%	-0.03%
过去七年	83.10%	1.69%	42.14%	1.73%	40.96%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	35.46%	1.67%	1.10%	1.70%	34.36%	-0.03%

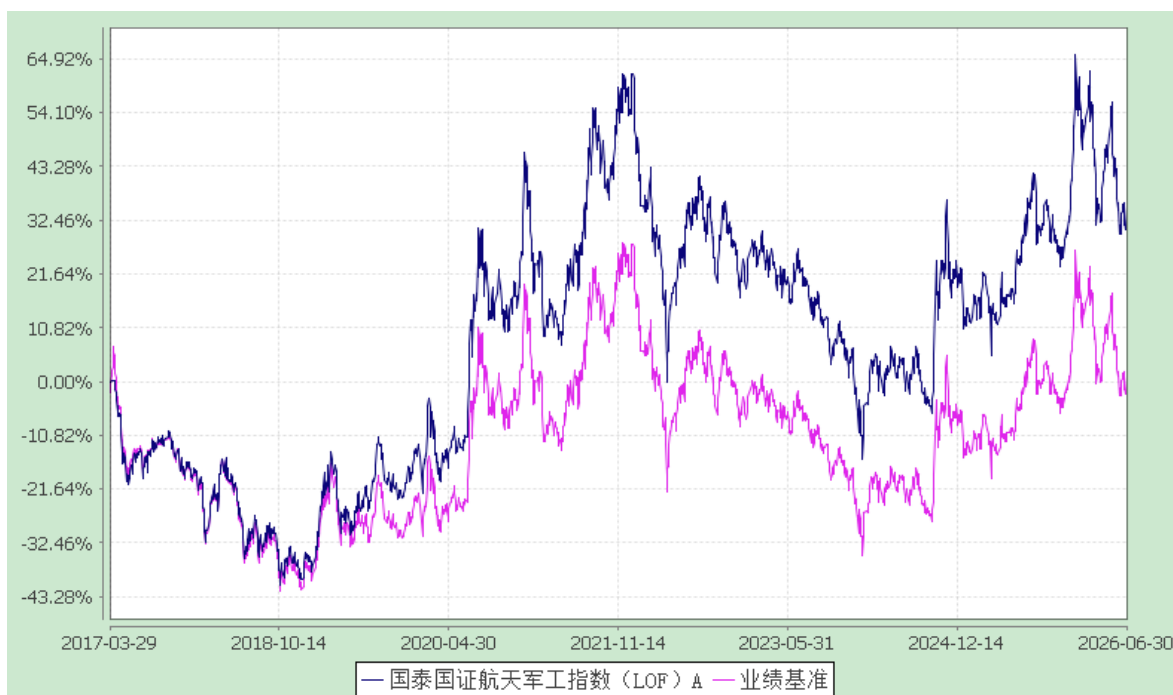
2、国泰国证航天军工指数（LOF）C：

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	0.46%	1.71%	-0.78%	1.71%	1.24%	0.00%
过去六个月	-5.16%	1.95%	-6.27%	2.00%	1.11%	-0.05%
过去一年	6.87%	1.63%	4.78%	1.67%	2.09%	-0.04%
过去三年	7.26%	1.65%	4.00%	1.69%	3.26%	-0.04%
自新增 C 类 份额起至今	12.21%	1.58%	8.04%	1.61%	4.17%	-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

国泰国证航天军工指数证券投资基金（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 3 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日)

1. 国泰国证航天军工指数（LOF）A：



注：本基金的合同生效日为 2017 年 3 月 29 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. 国泰国证航天军工指数（LOF）C:



注：本基金的合同生效日为 2017 年 3 月 29 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 19 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。自 2022 年 5 月 23 日起，C 类基金份额净值和基金份额累计净值开始计算。

§ 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	2017-03-29	-	25 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 ）、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 司 ETF 联接、 国泰 纳斯 达克 100			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 月至 2023 年 9 月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
--	--	--	--	--

	(QDI I-ETF)、国 泰标 普 500ET F、国 泰中 证半 导体 材料 设备 主题 ETF 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, 2023 年 5 月起兼任纳 斯达克 100 交易型开放式指 数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基 金(QDII)的基金经理, 2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体 材料设备主题交易型开放式 指数证券投资基金的基金经 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法律法规及行业协会的相关规定。

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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资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 and 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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 5 次，为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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

2026 年二季度，地缘政治冲突趋势上走向缓和，但进程中反复博弈；同时，霍尔木兹海峡的封锁也持续影响全球宏观经济。海外方面，沃什正式接任美联储主席，议息会议“首秀”中释放鹰派信号，市场对美联储的政策预期由“年内降

息”逐步切换至“加息交易”，对全球资产价格也有所扰动。

聚焦国内宏观经济，在稳中求进的工作总基调下，国民经济延续了平稳复苏与结构优化态势，同时在政策大力支持下，新兴产业蓬勃发展，供给侧的高技术和装备制造保持较快增长，但同时，需求侧的商品消费、地产投资和民间投资偏弱，5 月社会消费品零售总额同比下降 0.6%，环比下降 0.38%。

经济数据的分化也一定程度传导至 A 股市场。二季度，美伊冲突的趋势性缓和使得 A 股整体走出修复性行情，但内部结构性轮动不断加速。一方面，全球 AI 需求扩张带动算力基建（CPO、PCB、光模块）订单与业绩兑现，同时自主可控政策加码推动半导体设备材料国产替代加速、半导体设备景气上行，相应企业盈利大幅修复，驱动科技板块向上突破。另一方面，经济的 K 型分化、社零数据的阶段性承压对传统消费板块产生压制；海外加息预期的抬升又对大宗商品价格产生影响，压制顺周期板块的表现。

整体看，2026 年二季度权益市场呈现上行态势，但内部分化极致。截至 6 月 30 日收盘，上证综指二季度累计上涨 5.2%，创业板指涨超 36%，科创 50 指数年内涨超 75%。行业表现方面，科技为二季度最强主线，其他板块有所承压。分行业看，31 个申万一级行业中，电子、通信板块分别以 85.75%、60.22%的涨幅领跑，同样受益于 AI 上游的建材、机械设备均涨超 20%；其他行业均出现回调，石油石化、农林牧渔、钢铁跌幅较深。

作为被动指数基金的基金经理，我们的工作重点在于紧密跟踪标的指数，力求实现与指数表现相匹配的投资回报。在 2026 年二季度，我们的基金严格按照既定的投资策略，依据标的指数的成分股及其权重构建投资组合，以最小化跟踪误差。

在实际操作中，我们对指数的成分股变化保持密切关注，及时进行相应的调整，确保基金持仓与指数成分的一致性。同时，利用量化分析和风险评估模型，对投资组合进行动态监控，以控制跟踪误差在合理范围内。尽管面临市场的大幅波动和成分股的调整，基金整体较好地实现了对标的指数的跟踪，在多数时间段内，净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年跟踪误差均控制在较低水平。

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 0.51%，同期业绩比较基准收益率为 -0.78%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 0.46%，同期业绩比较基准收益率为 -0.78%。

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 2026 年下半年，我们对中国宏观经济的平稳健康发展和资本市场的长期投资价值抱有坚定信心。在科技创新与新质生产力领域，人工智能及相关硬科技产业正在步入商业化落地与生态繁荣的深化阶段。经历了两年的底层架构搭建与技术迭代，多模态大模型的能力边界不断拓宽，相关的应用场景正在从前期的概念验证加速向实际的生产力工具转化。

在算力基础设施层面，尽管短期内市场对海外云厂商资本开支的节奏存在一定分歧，但随着端侧 AI 应用的爆发以及推理端算力需求的指数级增长，底层算力的需求中枢依然具备较高的确定性。这不仅为高端计算芯片、先进封装技术提供了广阔的市场空间，也将持续推动光通信模块、高速连接器以及新型散热系统等产业链核心环节的技术升级。与此同时，在科技自立自强的时代背景下，半导体产业链的国产化进程正在向核心设备与先进制程领域纵深推进。

国防军工及航空航天也是未来具备较高成长潜力的重点方向。随着国防军队现代化建设目标的持续推进，军工行业整体的装备采购需求有望迎来实质性的恢复与稳定增长。商业航天作为新一代空间基础设施的代表，其战略地位正日益凸显。随着我国低轨宽带卫星互联网星座组网计划的密集实施，火箭运载发射能力、卫星平台制造以及地面终端接收设备产业链的景气度正处于快速上升通道。

此外，大金融板块目前整体处于历史估值的相对低位区间，具备较高的安全边际与修复空间。头部证券公司通过行业内部的并购重组实现做优做强的预期正在逐步升温。伴随资本市场制度的不断完善，财富管理业务的深化转型与投行资本化业务的拓展，将有助于逐步改善证券行业的盈利结构与资产质量。银行板块深度回调后，高股息价值也或将显现。

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	1,610,086,120.14	93.17
	其中：股票	1,610,086,120.14	93.17
2	固定收益投资	7,542,448.10	0.44
	其中：债券	7,542,448.10	0.44
	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	91,871,964.31	5.32
7	其他各项资产	18,596,039.13	1.08
8	合计	1,728,096,571.68	100.00

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境内股票投资组合

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	36,149.82	0.00
C	制造业	10,672,622.59	0.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	731,812.35	0.04

	业		
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
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	2,443.98	0.00
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	11,444,612.20	0.67

5.2.2 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,530,219,080.54	90.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	9,046,944.00	0.53
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	59,375,483.40	3.50
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	1,598,641,507.94	94.17

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	600150	中国船舶	5,292,333	178,827,932.07	10.53
2	300395	菲利华	794,702	102,643,123.21	6.05
3	002049	紫光国微	859,471	76,278,051.25	4.49
4	600879	航天电子	3,358,164	71,495,311.56	4.21
5	002179	中航光电	1,505,929	69,573,919.80	4.10
6	600893	航发动力	1,787,422	68,529,759.48	4.04
7	600118	中国卫星	784,780	64,391,199.00	3.79
8	002625	光启技术	2,120,493	64,293,347.76	3.79
9	688629	华丰科技	323,094	58,861,935.84	3.47
10	600760	中航沈飞	1,268,513	52,135,884.30	3.07

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	688795	摩尔线程	3,987	2,698,959.78	0.16
2	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.15
3	688802	沐曦股份	2,896	2,226,705.44	0.13
4	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.05
5	001248	华润新能源	72,385	731,812.35	0.04

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	5,032,409.59	0.30
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	2,510,038.51	0.15
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	7,542,448.10	0.44

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	019827	26 国债 01	50,000	5,032,409.5	0.30

				9	
2	110101	宝钛转债	25,100	2,510,038.51	0.15

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，紫光国芯微电子股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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约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	377,084.82
2	应收证券清算款	8,151,703.55
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	10,067,250.76
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	18,596,039.13

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处于转股期的可转换债券。

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	300395	菲利华	27,209,373.46	1.60	增发中签
2	688629	华丰科技	12,282,201.72	0.72	增发中签

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	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	688795	摩尔线程	2,698,959.78	0.16	新股锁定
2	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.15	新股锁定
3	688802	沐曦股份	2,226,705.44	0.13	新股锁定
4	688765	禾元生物	799,783.20	0.05	新股锁定
5	001248	华润新能源	512,273.70	0.03	新股锁定
6	001248	华润新能源	219,538.65	0.01	网下中签

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰国证航天军工指数 (LOF) A	国泰国证航天军工指数 (LOF) C
本报告期期初基金份额总额	572,214,644.55	724,889,052.97
报告期期间基金总申购份额	180,852,306.63	460,094,099.94
减：报告期期间基金总赎回份额	181,557,017.92	497,863,471.60
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	571,509,933.26	687,119,681.31

§ 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	80,873.43
报告期期间买入/申购总份额	-
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	80,873.43
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

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

本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰国证航天军工指数证券投资基金（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

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 15-20 层。

基金托管人住所或办公场所。

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

二〇二六年七月二十一日