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 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

2.1 基金产品概况

基金简称	国泰中证计算机主题 ETF 联接
基金主代码	160224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月3日
报告期末基金份额总额	234,250,815.42 份
投资目标	通过主要投资于目标 ETF,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	本基金为目标 ETF 的联接基金,以目标 ETF 作为主要投
	资标的,方便投资人通过本基金投资目标 ETF,本基金并
	不参与目标 ETF 的管理。
	1、资产配置策略; 2、目标 ETF 投资策略; 3、股票投资
	策略; 4、存托凭证投资策略; 5、债券投资策略; 6、资
	产支持证券投资策略;7、股指期货投资策略;8、融资与

	转融通证券出借投资策略。				
业绩比较基准	中证计算机主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税				
	后)*5%				
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金,目	标 ETF 为股票型指数基金,			
	因此本基金属于较高预期风险	金和预期收益的证券投资基			
	金品种,其预期收益及预期原	风险水平高于混合型基金、债			
	券型基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于目标				
	ETF 跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所				
	代表的证券市场相似的风险收益特征。				
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				
下属分级基金的基金简称	国泰中证计算机主题 ETF 联接 A	国泰中证计算机主题 ETF 联接 C			
下属分级基金的交易代码	160224	010210			
报告期末下属分级基金的份额总额	229,141,559.27 份	5,109,256.15 份			

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512720
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年7月11日
基金份额上市的证券交易	上海证券交易所
所	工母此分义勿內
上市日期	2019年8月16日
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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、债券投资策略; 3、可转换债券投资策略; 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	中证计算机主题指数收益率
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,属于较高风险、较高收益的基金。

§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

	报告期			
主要财务指标	(2022年1月1日-	2022年3月31日)		
土 安 州 分 1 日 小	国泰中证计算机主题	国泰中证计算机主题		
	ETF 联接 A	ETF 联接 C		
1.本期已实现收益	124,613.87	230.32		
2.本期利润	-42,752,942.48	-705,682.60		
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1979	-0.2084		
4.期末基金资产净值	171,636,858.65	3,812,013.83		
5.期末基金份额净值	0.7490	0.7461		

- 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

1、国泰中证计算机主题 ETF 联接 A:

IV. FJ.	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	(1)-(2)	(D)—(A)
阶段	1	标准差②	准收益率③	准收益率标	1)-3	2)—4)

				准差④		
过去三个月	-20.61%	1.66%	-21.25%	1.72%	0.64%	-0.06%
过去六个月	-18.09%	1.36%	-18.23%	1.41%	0.14%	-0.05%
过去一年	-15.47%	1.34%	-17.49%	1.38%	2.02%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	-21.02%	1.38%	-22.61%	1.40%	1.59%	-0.02%

2、国泰中证计算机主题 ETF 联接 C:

阶段	净值增长率	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	-20.67%	1.66%	-21.25%	1.72%	0.58%	-0.06%
过去六个月	-18.20%	1.36%	-18.23%	1.41%	0.03%	-0.05%
过去一年	-15.71%	1.34%	-17.49%	1.38%	1.78%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	-20.84%	1.38%	-23.38%	1.41%	2.54%	-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

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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 (2020年12月3日至2022年3月31日)

1. 国泰中证计算机主题 ETF 联接 A:



注:本基金的合同生效日为2020年12月3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. 国泰中证计算机主题 ETF 联接 C:



注:本基金的合同生效日为 2020 年 12 月 3 日,自 2020 年 12 月 7 日起,C 类基金份额净值和基金份额累计净值开始计算。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。

§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 职务 限		证券从业	说明
XL-II	-0103	任职日期	离任日期	年限	20 /1
艾小军	国泰黄 金 ETF 联接、 国证 180 金融 ETF 国 泰上 证 180 金	2020-12-03	-	21 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 国泰基金管理有限公司,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

度下F、国家中证。		
要中证	融	黄金交易型开放式证券投资基金、
中國	ETF、国	上证 180 金融交易型开放式指数
主题 ETF联 按、国 素賣金 ETF、	泰中证	证券投资基金、国泰上证 180 金融
ETF 联接、国	计算机	交易型开放式指数证券投资基金
接、国家黄金 ETF、国 基金经理,2015 年 4 月至 2021 年 1月任国家沪深 300 指数证券投资基金的基金经理,2016 年 4 月起 基金的基金经理,2016 年 4 月起 兼任国泰黄金交易型开放证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月起兼任国泰中证 章 经营业 空易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月起兼任国泰中证全指证 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 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 月起兼任国参与企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业	主题	联接基金的基金经理,2015年3
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月起聚户证券投资基金的基金经理,2016年4月起聚在国泰黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理,2016年7月起来任国泰世帝军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,为公司是下,国家国证的大军工指数证券投资基金的基金经理,2017年3月至2017年5月在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券投资基金的基金经理,2017年3月起来任国泰国证的大厅证券行业指数证券投资基金(LOF)的基金经理,2017年3月起来任国泰国证的大厅证券行业指数证券投资基金(LOF)的基金经理,2017年4月起证券投资基金(LOF)的基金经理,2017年5月起来任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金。1017年5月起来任国泰市证理方证券投资基金(由国市工资,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,芯片的基金经理,2017年5月至2019年5月任国泰中证券投资基金的基金经理,2017年8月起至2019年5月任国泰中证券投资基金的基金经理,2018年5月至202年3月任国泰全任理,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5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经理,2018年5月至2019年7月在国本全经证券投资基金的基金经理,2018年12月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经理,2018年5月至2019年4月在国本会经过,2018年5月至2019年4月在国本会经过,2018年5月至2019年4月在国本会经过,2018年5月至2019年4月在国本会经过,2018年5月至2019年4月至2019年4月至2019年4月至2018年5月至2019年4月至	ETF 联	月至 2020 年 12 月任国泰深证
ETF、国 素中证 军工 银行国泰党深 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的基金经理 第公司 医TF、国 泰国证 积	接、国	TMT50 指数分级证券投资基金的
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 月起兼任国泰中证至工 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 多公司 ETF、国 泰国证 新国证 新国证 新国证 (LOF) 、国泰 中证申 万证券 行业指 数 (LOF) 、国泰 中证申 万证券 行业指 数 (LOF) 、国泰 中证申 万证券 行业指 数 (LOF) 、国泰 等价 量之型。 是型。2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略的益灵活配置 混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月起兼任国泰国证航置 不工指数证券投资基金(LOF)的 基金经理,2017 年 4 月起兼任国 数 (LOF) 、国泰等的价 便灵活 配置混合型证券投资基金(由国表策略价值 是工作国泰策略价值 是工作国泰策略价值 是工作国泰策略价值 是工作国泰策略的价值 是工作。 是工作国泰策略的价值 是工作。 是工。 是工作。 是工。 是工。 是工。 是工。 是工。 是工。 是工。 是工	泰黄金	基金经理,2015年4月至2021年
#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 知國泰中证全指证券公司交易基金 图证券投资基金 和国泰中证全指证券公司交易基金 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 混合型证券投资基金的基金 (LOF) 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 4 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 月起兼任国泰国企制产 发达。(LOF) 以国泰 位见了 年 5 月起兼任国泰国企业券投资基金 (由国新 定证券投资基金 (由国新 定证券投资基金 (由国新 定证券投资基金 (由国 下本) 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 (基本) 的基金经理,2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量企业券投资基金的基金经理,2018 年 7 月任国泰量企业费证券投资基金的基金经理,2018 年 5 月至 2029 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 4 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 5 月至 2019 年 4 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 5 月至 2019 年 4 月任国泰组代自精选混合型证券投资基金的基金经理,2018 年 5 月至 2019 年 4 月任国泰组大2018 年 7 月任国泰组大2019 年 4 月任国泰组大2018 年 8 月至 2019 年 4 月至	ETF、国	1月任国泰沪深300指数证券投资
ETF、国	泰中证	基金的基金经理,2016年4月起
宏中证 全指证	军工	兼任国泰黄金交易型开放式证券
全指证 券公司 ETF、国 素国证	ETF、国	投资基金联接基金的基金经理,
## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ## ##	泰中证	2016 年 7 月起兼任国泰中证军工
ETF、国	全指证	交易型开放式指数证券投资基金
泰国证	券公司	和国泰中证全指证券公司交易型
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券投资基金的基金经理,2017年3月起兼任国泰国证航天	ETF、国	开放式指数证券投资基金的基金
工指数 (LOF) 、国泰 中证申 万证券 行业指 数 (LOF) 、国泰 中证申 方证券 行业指 数 (LOF) 、国泰 中证申 方证券 (LOF) 、国泰 (LOF) 、国泰 衛略价 值灵活 策略价 值灵活 配置混合型证券投资基金(LOF) 的基金经理, 2017 年 4 月起兼任国 数 (LOF) 、国泰 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(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 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 计算机 主题 ETF、国 泰中证 计算机 主题 ETF、国 泰中证 全指通 信设各 ETF、国 泰中证 全指通 高量区019 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	泰国证	经理,2017年3月至2017年5月
(LOF) 、国泰 中证申 万证券 行业指 数 (LOF) 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 数 (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 值灵活 附置混合型证券投资基金 (国际) 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 月任国泰中证 计算机 主题 ETF、国 泰中证 计算机 主题 ETF、国 秦中证 全指通 信设各 ETF、国 秦中证 专列至 2018 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 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 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 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 5 月至 2019	航天军	任国泰保本混合型证券投资基金
混合型证券投资基金的基金经理,中证申 万证券 万证券 行业指 数 (LOF)的 基金经理,2017年4月起兼任国 数 (LOF)的基金经理,2017年4月起兼任国 数 (LOF)的基金经理,2017年4月起兼任国 数 (LOF)的基金经理,2017年5月起兼任国泰策略价值灵活 策略价值灵活 配置混合型证券投资基金(由国泰 强本混合型证券投资基金(由国泰 保本混合型证券投资基金(由国泰 保本混合型证券投资基金的基金经理,2017年5月在国泰量化收益灵活 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 计算机 主题 ETF、国 泰中证 计算机 主题 ETF、国 泰中证 全理,2017年8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5月至2019年7月任国泰营和人价值精选混合 型证券投资基金的基金经理,2018年5月至2019年7月任国泰营和人价值精选混合	工指数	的基金经理,2017年3月至2018
中证申 万证券 行业指 数 (LOF)的 基金经理, 2017 年 4 月起兼任国 数 (LOF)。 、国泰 (LOF)。 、国泰 值灵活 配置混 合型证券投资基金(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 值灵活 配置混 合、芯 方 方 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上	(LOF)	年 12 月任国泰策略收益灵活配置
万证券 行业指数 发 (LOF)的基金经理,2017年4月起兼任国数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策略价值灵活商工工产,的基金经理,2017年5月至6、芯片 四十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二	、国泰	混合型证券投资基金的基金经理,
世界	中证申	2017 年 3 月起兼任国泰国证航天
数 (LOF) 次基金 (LOF) 的基金经理,2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活策略价值灵活 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配置混 会、芯 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计算机 主题 程序 2018 年 5 月至2022 年 3 月任国泰臣TF、国泰中证全指通信设备 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管设备 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	万证券	军工指数证券投资基金(LOF)的
(LOF) 、国泰 策略价 值灵活 策略价 值灵活 同型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 合、芯 片 ETF、国 泰中证 计算机 主题 ETF、国 秦中证 全指通 信设备 ETF、国 泰中证 全指通 信设备 ETF、国 秦中证 全指通 泰中证 会院备	行业指	基金经理,2017年4月起兼任国
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 计算机 主题 2018年5月至2022年3月任国泰臣TF、国泰中证 全指通 信设备 医TF、国 每 1	数	泰中证申万证券行业指数证券投
策略价值灵活	(LOF)	资基金(LOF)的基金经理,2017
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 泰中证 全指通 高设备 ETF、国 泰中证 全指通 泰中证 全指通 高设备 ETF、国 泰中证 全指通 高设备 ETF、国 泰中证 全指通 高设备 ETF、国 泰中证 全指通 泰中证 全指通 泰中证 全指通 泰中证 全指通 泰中证 会的基金经理,2018年5月至2019年4月任国泰结构 泰中证 会的基金经理,2018年12月至	、国泰	年 5 月起兼任国泰策略价值灵活
RT型混合、芯片	策略价	配置混合型证券投资基金(由国泰
合、芯 片 医TF、国 泰中证 计算机 主题 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 泰中证 全指通 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5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	值灵活	保本混合型证券投资基金变更而
居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	配置混	来)的基金经理,2017年5月至
ETF、国	合、芯	2018 年 7 月任国泰量化收益灵活
泰中证 计算机 主题 2018年5月至2022年3月任国泰 是TF、国 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 管设备 医TF、国 泰中证 全指通 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	片	配置混合型证券投资基金的基金
计算机 主题 2018年5月至2022年3月任国泰 ETF、国 泰中证 全指通 6 设备 ETF、国 医TF、国 基本中证 全指通 6 定备 型证券投资基金的基金经理,2018年5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	ETF、国	经理,2017年8月起至2019年5
主题 ETF、国 泰中证 全指通 信设备 ETF、国 素中证 全指通 表中证 全指通 表中证 全指通 表中证 全指通 表中证 全指通 表中证 全指通	泰中证	月任国泰宁益定期开放灵活配置
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1月任国泰量化价值精选混合管设备。由于1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1年,1	计算机	混合型证券投资基金的基金经理,
泰中证 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	主题	2018年5月至2022年3月任国泰
全指通 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 ETF、国泰中证全指通 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	ETF、国	量化成长优选混合型证券投资基
信设备 ETF、国	泰中证	金的基金经理,2018年5月至2019
ETF、国 年8月至2019年4月任国泰结构 泰中证 转型灵活配置混合型证券投资基 全指通 金的基金经理,2018年12月至	全指通	年 7 月任国泰量化价值精选混合
泰中证 全指通 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	信设备	型证券投资基金的基金经理,2018
全指通 金的基金经理,2018 年 12 月至	ETF、国	年8月至2019年4月任国泰结构
	泰中证	转型灵活配置混合型证券投资基
信设备 2019 年 3 月任国泰量化策略收益	全指通	金的基金经理, 2018 年 12 月至
	信设备	2019 年 3 月任国泰量化策略收益

ETF 联	混合型证券投资基金(由国泰策略
接、国	收益灵活配置混合型证券投资基
泰中证	金变更而来)的基金经理,2019
全指证	年4月至2019年11月任国泰沪深
券公司	300 指数增强型证券投资基金(由
ETF 联	国泰结构转型灵活配置混合型证
接的基	券投资基金变更而来)的基金经
金经	理, 2019年5月至2019年11月
理、投	任国泰中证 500 指数增强型证券
资总监	投资基金(由国泰宁益定期开放灵
(量	活配置混合型证券投资基金变更
化)、金	注册而来)的基金经理,2019年5
融工程	月起兼任国泰 CES 半导体芯片行
总监	业交易型开放式指数证券投资基
	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遵规守信情况的说明

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

一季度受国内外多重压力,A股市场震荡下行;国外受乌克兰局势骤然升温,以北约为主的主要西方经济体持续加大对俄罗斯的全方位无极限制裁,主要大宗商品尤其是油气能源以及食品价格大幅攀升,美欧主要经济体通胀持续攀升,美联储货币政策收紧的预期高企;国内受新冠疫情多点散发,尤其是三月份以来包括吉林、上海疫情大面积扩散导致的封城,对于国内本就面临下行压力的经济更是雪上加霜。在国内外多重压力下,市场预期作为传统稳经济的重要手段的房地产政策有望得到阶段性的松动,受地缘政治影响,作为避险资产的黄金震荡上行,受美国为代表的西方主要经济体对俄罗斯的制裁影响,国内主要能源供给煤炭表现出现。

全季度来看,上证指数震荡下跌 10.65%,大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 11.47%,沪

深 300 指数下跌 14.53%, 成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 14.06%,小盘股表征指数中证 1000 下跌 15.46%。板块上医药医疗科技占比较多的创业板指下跌 19.96%,科创板 50 下跌 21.97%。

在行业表现上,申万一级行业中表现较好的为煤炭、房地产、银行,涨幅分别为 22.63%、7.27% 和 1.66%,表现落后的为电子、军工、汽车,分别下跌了 25.46%、23.3%和 21.4%。

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-20.61%,同期业绩比较基准收益率为-21.25%。本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-20.67%,同期业绩比较基准收益率为-21.25%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年是新冠疫情的第三年,随着新冠疫苗在主要经济体的逐步接种以及抗新冠药物逐步上市,全球经济有望从新冠疫情的阴霾中逐步恢复。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过程中,主要经济体的博弈和竞争料将带来更多的不确定性。随着基数效应的减弱,出口面临的压力,国内外形势错综复杂,经济下行压力加大,在新冠疫情压力持续加大的情况下,我们预计政策将着力于稳增长为主,传统经济增长的支柱产业在六稳的政策环境下有望迎来阶段性的投资机会。以半导体芯片为代表的科技领域投资价值随着国产替代的渗透而凸显,兼具高景气度以及为我国经济体量相匹配的军工行业是我们中长期坚定看好的方向。随着扩产产能的逐步释放,包括军工、芯片、新能源等制约供给的行业盈利能力有望释放。

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	-	-
	其中: 股票	-	-

2	基金投资	162,825,066.72	92.27
3	固定收益投资	10,135,630.14	5.74
	其中:债券	10,135,630.14	5.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	1	-
5	金融衍生品投资	ı	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	1	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,121,903.05	1.77
8	其他各项资产	377,438.33	0.21
9	合计	176,460,038.24	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金	运作方式	管理人	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	国泰中证计算机主题交易 型开放式指数证券投资基 金	股票型	交易型 开放式	国泰基金管 理有限公司	162,825,066.72	92.80

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 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	10,135,630.14	5.78
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,135,630.14	5.78

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	019658	21 国债 10	100,000	10,135,630.14	5.78

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。

- **5.8** 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贵金属投资明细本基金本报告期末未持有贵金属。
- **5.9 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。
- 5.10 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。

5.11 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。

5.12投资组合报告附注

- 5.12.1 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。
- 5.12.2 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。

5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,365.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	371,072.42
6	其他应收款	0.15
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	377,438.33

5.12.4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。

5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位: 份

塔口	国泰中证计算机主题	国泰中证计算机主题
项目	ETF联接A	ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	201,652,202.61	1,486,469.15

报告期期间基金总申购份额	57,216,831.60	6,312,369.77
减:报告期期间基金总赎回份额	29,727,474.94	2,689,582.77
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	229,141,559.27	5,109,256.15

§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

本报告期內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 备查文件目录

8.1备查文件目录

- 1、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基金合同
- 2、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托管协议
- 3、关于准予国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金变更注册的批复
- 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

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

二〇二二年四月二十二日