

# 国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 2023年第1季度报告

### 2023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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十二日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）
场内简称	国泰融丰 LOF
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	271,766,729.12 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市场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	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市场发展趋势的基础上，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。  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。	
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	267,274,021.69 份	4,492,707.43 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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)	
	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
1.本期已实现收益	1,003,612.92	7,094.36
2.本期利润	5,893,099.48	107,915.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0134	0.0176
4.期末基金资产净值	308,672,564.15	5,163,983.13

5.期末基金份额净值	1.1549	1.1494
------------	--------	--------

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 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	0.99%	0.18%	3.19%	0.51%	-2.20%	-0.33%
过去六个月	0.00%	0.20%	4.38%	0.65%	-4.38%	-0.45%
过去一年	0.04%	0.22%	-0.72%	0.68%	0.76%	-0.46%
过去三年	28.92%	0.29%	11.42%	0.72%	17.50%	-0.43%
过去五年	26.41%	0.48%	14.82%	0.77%	11.59%	-0.29%
自基金转型 起至今	22.43%	0.50%	12.50%	0.76%	9.93%	-0.26%

##### 2、国泰融丰外延增长灵活配置混合（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	0.89%	0.18%	3.19%	0.51%	-2.30%	-0.33%
过去六个月	-0.20%	0.20%	4.38%	0.65%	-4.58%	-0.45%
过去一年	-0.36%	0.22%	-0.72%	0.68%	0.36%	-0.46%
自新增 C 类 份额起至今	-0.36%	0.25%	-4.98%	0.73%	4.62%	-0.48%

#### 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 2023 年 3 月 31 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	-	17 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、国泰安璟债券的基金经理</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，2023 年 1 月起兼任国泰安环债券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

今年一季度，市场总体呈现一定程度的反弹，但各行业表现差异较大。在过去七年都鲜有表现的计算机、传媒等行业，在多种因素的催化下，走出了大幅上涨的行情，而过去几年表现较好的新能源等成长股，以及和宏观经济相关度较高的大金融板块走势较弱。最终上证指数上涨 5.94%，深证成指上涨 6.45%，创业板指上涨 2.25%。从申万一级行业来看，计算机、传媒、通信行业出现较大幅度上涨，而房地产、商贸零售、银行等行业出现一定幅度下跌。

一季度在疫情防控完全放开后，国内经济恢复到一个正常的运行轨道，社融和信贷从总量到结构都比较超预期，基建投资和消费都有不错的表现。美国通胀拐点也逐步显现，十年美债收益率和美元指数在震荡中回落，美欧银行业风险暂时得到解决。在这样的外部环境下，A 股也展开了持续的反弹。反弹初期表现为行业轮动，顺周期产业链、消费、新能源、数字经济都有所表现，随着 OpenAI 公司 ChatGPT 新产品的发布，行情开始出现分化，从申万一级行业来看，三月份全市场只有六个行业上涨，分别是 TMT 的四个行业以及建筑装饰和石油石化两个低估值行业，其余行业均出现不同程度的下跌。

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，一季度增加了计算机、有色、消费医药等股票配置，减持了部分新能源，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 0.99%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 0.89%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全年，我们维持判断经济主基调是疫后复苏的过渡之年。国内保持宽松的货币和财政政策，通胀处于较低水平，投资和消费有序恢复。今年是政府换届第一年，我们预计基建和制造业投资全年维持高位，房地产投资降幅有望持续收窄；消费方面主要是线下消费场景恢复，出行链会有较大反弹；由于外需趋弱，出口可能会面临一定压力，会呈现前低后高的趋势。从海外来看，美国通胀虽然仍有压力，但银行业出现的风险事件使其紧缩空间有限。

我们对今年全年 A 股市场表现相对乐观。一季度主题投资表现非常活跃，TMT 行业最大成

交占比超过全市场的 40%，一方面是因为 AI 技术的革命性突破，另一方面是宽松的流动性以及 A 股盈利增速处于低位的市场环境非常适合主题投资。我们认为后续主题投资仍然可能有机会，但需要防范主题退潮时带来的回撤。全年来看，我们看好海外衰退预期与避险需求下，贵金属板块的投资机会，看好低估值央国企价值重估的机会，看好景气逐步恢复的医药、消费板块的机会，同时看好半导体、光伏等成长行业在景气见底后的反转机会。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	86,472,412.66	23.18
	其中：股票	86,472,412.66	23.18
2	固定收益投资	259,979,083.01	69.70
	其中：债券	259,979,083.01	69.70
	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	10,791,000.00	2.89
	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	15,633,755.55	4.19
7	其他各项资产	114,360.44	0.03
8	合计	372,990,611.66	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	11,163,850.00	3.56
C	制造业	57,028,238.70	18.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,619.60	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,268,525.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,003,284.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,614,725.84	2.74
J	金融业	4,267,069.00	1.36
K	房地产业	1,092,324.00	0.35
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	977,490.60	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	50,285.92	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	86,472,412.66	27.55

**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	000603	盛达资源	290,700	4,941,900.00	1.57
2	600988	赤峰黄金	217,300	3,943,995.00	1.26
3	688518	联赢激光	116,360	3,635,086.40	1.16
4	301035	润丰股份	52,944	3,626,134.56	1.16
5	003002	壶化股份	180,600	3,612,000.00	1.15
6	002940	昂利康	88,215	2,925,209.40	0.93
7	600079	人福医药	90,000	2,410,200.00	0.77

8	600519	贵州茅台	1,300	2,366,000.00	0.75
9	600511	国药股份	60,900	2,268,525.00	0.72
10	603688	石英股份	17,800	2,197,944.00	0.70

#### 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	20,269,243.84	6.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	87,355,518.08	27.83
5	企业短期融资券	20,448,557.81	6.52
6	中期票据	101,863,259.51	32.46
7	可转债（可交换债）	157,210.34	0.05
8	同业存单	29,885,293.43	9.52
9	其他	-	-
10	合计	259,979,083.01	82.84

#### 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	143734	18 金隅 02	300,000	31,044,657.53	9.89
2	072210068	22 国信证券 CP014	200,000	20,448,557.81	6.52
3	102000888	20 南航股 MTN009	200,000	20,445,521.10	6.51
4	175175	20 招证 G5	200,000	20,428,141.37	6.51
5	102001078	20 沪港务 MTN001	200,000	20,385,021.37	6.50

#### 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”、“华夏银行”、“长江证券”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、投资银行类业务内部控制不完善、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、分公司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问题，受到中国证监会、深交所、上交所、深圳证监局警示函、立案、罚款、责令改正、没收违法所得等处罚。

华夏银行下属分支机构因贷后管理不到位，贷款业务严重违反审慎经营规则，个人贷款调查不尽职，流动资金贷款贷前调查不尽职，授信审批不审慎，信用证开证前调查不尽职，员工行为管理不到位，办理无真实贸易背景的银行承兑汇票，贷款调查不审慎，首付款来源真实性审核不到位，贷款五级分类不准确，贴现资金管理不到位，员工违规与中介合作揽储，信贷管理不审慎，个人经营性贷款“三查”不审慎，贷款资金被挪用于支付土地出让金、土拍保证金和拆迁补偿款，虚增存贷款，与融资租赁公司业务合作开展不审慎，违规发放固定资产贷款，贷款管理不到位，流动资金贷款被挪用于借款人子公司小额贷款公司购买理财和放贷，因管理不善导致金融许可证遗失，贴现资金回流至出票人用作保证金，滚动签发银行承兑汇票，信贷资金流入证券市场，严重违反审慎经营规则，转嫁经营成本，违规由客户承担抵押登记费，违规向有足值抵押物的借款人销售人身保险，部分非现场监管统计数据不真实、不准确，保理融资业务贷前调查审查不尽职，银行承兑汇票业务贸易背景审查不严，个人按揭贷款未核实借款人首付款资金来源，银信通道业务资

金回流借款人，滚动开票虚增存贷款规模，通过“第三方存单质押”业务虚增存贷款规模，内控制度执行不严格，发生业内案件且形成信贷业务资金损失，迟报案件风险信息，向不具备贷款主体资格的借款人发放贷款掩盖风险，违规宣传理财及代销保险产品，服务收费管理不规范，对借款人收入认定不审慎，未建立以分级授权为核心的消费者金融信息使用管理制度，投诉信息报送错误、投诉数据迟报，员工消费贷款违规挪用于限控领域，侵害消费者合法权益，利用同业存款虚增一般性存款问题屡查屡犯等问题，受到地方银保监局、央行派出机构罚款、没收违法所得、警告、责令改正等处罚。

长江证券因营业部员工存在在营业部具备期货 IB 业务展业条件前及其未取得期货从业资格的情况下,从事期货 IB 业务的行为，营业部员工存在未取得基金销售业务资格从事基金销售业务的行为,营业部员工存在未取得期货投资咨询资格为客户提供期货投资咨询建议的行为，在未和客户签订证券投资顾问服务协议、营业部多名员工在未取得证券投资咨询业务资格并在中国证券业协会注册登记为证券投资顾问的情况下，就证券市场、证券品种的走势,投资证券的可行性,在微信群中向公众发送个股分析、预测或建议等相关信息受到地方证监局出具警示函、责令整改的处罚。

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	61,978.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,382.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,360.44

#### 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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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

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
本报告期初基金份额总额	500,449,514.33	7,874,120.53
报告期期间基金总申购份额	10,718,206.94	1,327,587.44
减：报告期期间基金总赎回份额	243,893,699.58	4,709,000.54
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	267,274,021.69	4,492,707.43

### §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	87,320.99
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	87,320.99
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.03

#### 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



投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	2023年01月01日至2023年03月14日，2023年03月20日至2023年03月26日	105,686,079.43	-	105,686,079.43	-	-
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、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

二〇二三年四月二十二日