

# 国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）

## 2023 年第 4 季度报告

### 2023 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：二〇二四年一月二十二日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 01 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 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	1,831,399,927.70 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	1,779,189,753.97 份	52,210,173.73 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 10 月 1 日-2023 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	-5,796,606.75	-173,800.33
2.本期利润	-78,376,047.49	-2,328,785.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0442	-0.0555
4.期末基金资产净值	1,745,872,945.38	51,110,545.27
5.期末基金份额净值	0.9813	0.9789

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	-4.25%	1.00%	-4.20%	1.03%	-0.05%	-0.03%
过去六个月	2.88%	1.39%	2.18%	1.41%	0.70%	-0.02%
过去一年	4.11%	1.33%	2.96%	1.35%	1.15%	-0.02%
过去三年	-22.97%	1.44%	-28.41%	1.47%	5.44%	-0.03%
过去五年	32.81%	1.73%	12.51%	1.76%	20.30%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-1.87%	1.68%	-21.33%	1.72%	19.46%	-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	-4.31%	1.00%	-4.20%	1.03%	-0.11%	-0.03%
过去六个月	2.77%	1.39%	2.18%	1.41%	0.59%	-0.02%
过去一年	3.90%	1.33%	2.96%	1.35%	0.94%	-0.02%
自新增 C 类 份额起至今	4.38%	1.38%	1.15%	1.40%	3.23%	-0.02%

#### 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 2023 年 12 月 31 日)

##### 1. 国泰中证申万证券行业指数（LOF）A：



注：本基金的合同生效日为 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：本基金的合同生效日为 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	-	23 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

	<p>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</p>			<p>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</p>
--	---	--	--	---

	(QDI I-ETF)、国泰标普 500ETF、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《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

延续 7 月份中央政治局会议提出要活跃资本市场，提振投资者信心，中央金融工作会议提出金融强国，一系列利好政策频出，凸显管理层呵护市场之意。但国内宏观经济仍然面临较大的压力，PMI 在 17 月份再度回到荣枯线下方，一方面进出口数据持续走弱，另一方面基于收入前景的担忧消费难以提振。国际上，美国经济仍然表现较为强劲，在美国加大扶持替代中国供应链的政策下，包括日

本、印度、越南等经济体表现较为出色。面对错综复杂的国内外政治经济形势，投资者风险偏好持续下降，市场表现上体现低估值高分红偏好，机构持仓较小的微小盘股成为游资追逐的对象，整体市场维持二季度震荡下跌的态势，成交持续缩量。

全季度来看，上证指数震荡下跌 4.36%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数下跌 7.22%，沪深 300 指数下跌 7%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 4.6%，小盘股表征指数中证 1000 下跌 3.15%，中证 2000 上涨 1.92%，万得微盘股指数逆市上涨 9.39%。板块上新能源汽车、医药医疗科技占比较多的创业板指下跌 5.62%，硬科技占比较高的科创板 50 下跌 4.03%，科创 100 下跌 2.41%。

在行业表现上，申万一级行业中表现靠前的为煤炭、电子、农林牧渔，涨幅分别为 4.18%、3.92%和 1.73%，表现落后的为美容护理、房地产、建筑材料，分别下跌了 14.55%、14.47%和 14.47%。

#### 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-4.25%，同期业绩比较基准收益率为-4.20%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-4.31%，同期业绩比较基准收益率为-4.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在一系列活跃资本市场提振投资者信心的举措落地并实行后，我们预计上市公司将更加重视回报投资者，市场资金流动有望趋向良性；宏观经济面，包括 PMI、PPI、CPI 等指标有趋势性走好的迹象；随着国内大型科技公司在智能汽车、智能手机新品的持续发力，投资者情绪有望得到修复。GPT 引燃的人工智能技术及应用的又一次的科技创新浪潮有望赋能千行百业，TMT 板块的投资机会有望持续并扩散到更多板块。

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，经济恢复总体上仍然比较脆弱。2024 年是全球多个国家和地区选举年，预计选举进展将对全球金融市场带来一定的冲击。

#### 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	1,686,928,832.25	93.71
	其中：股票	1,686,928,832.25	93.71
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	109,301,668.92	6.07
7	其他各项资产	3,951,314.11	0.22
8	合计	1,800,181,815.28	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33,195,459.00元，占基金资产净值比例为1.85%。

#### 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	-	-
C	制造业	2,910,038.42	0.16
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	19,537.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	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	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,178.92	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,966,726.77	0.17

### 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	-	-
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	1,683,962,105.48	93.71
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	1,683,962,105.48	93.71

### 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	600030	中信证券	10,954,431	223,141,759.47	12.42
2	300059	东方财富	14,236,991	199,887,353.64	11.12
3	600837	海通证券	10,834,830	101,522,357.10	5.65
4	601688	华泰证券	5,778,863	80,615,138.85	4.49
5	601211	国泰君安	5,059,092	75,279,288.96	4.19
6	600999	招商证券	4,165,308	56,814,801.12	3.16

7	600958	东方证券	5,868,639	51,057,159.30	2.84
8	000776	广发证券	3,321,423	47,463,134.67	2.64
9	601377	兴业证券	7,755,255	45,523,346.85	2.53
10	000166	申万宏源	10,117,176	44,920,261.44	2.50

### 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	688347	华虹公司	52,042	2,188,886.52	0.12
2	688563	航材股份	1,469	88,859.81	0.00
3	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
4	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
5	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00

### 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”、“海通证券”、“兴业证券”、“广发证券”、“中信证券”、“国泰君安”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。

华泰证券下属分支机构因证券经纪人登记执业地域与委托合同约定执业地域不一致；未将证券经纪人执业行为的合规性纳入考核范围；部分经纪关系确认单缺失，证券经纪人执业留痕不完整；个别客户业务办理资料留存不完整；营业部存在不相容岗位未分离的情况；未妥善保管个别客户档案，导致客户资料缺失；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，受到监管机构公开处罚。

招商证券及下属分支机构因营业部合规专员存在联系银行参与营销活动的行为，营业部营销、合规风控岗位未有效分离；营业部合规专员向协助开户银行相关人员转账，营业部向银行提供物品，营业部廉洁从业管理不到位；在分析师调研活动管理、服务客户、公开发表言论等方面的内控管理有效性不足；未对发行人收入相关内部控制不规范及整改情况、收入确认依据进行充分核查；对发行人部分会计科目核算规范性、列报准确性执行的核查程序不到位等原因，受到监管机构公开处罚。

海通证券因在申请首发上市项目的保荐工作中，存在对重要审核问询问题选择性

漏答，对发行人的收入确认、存货、采购成本、资金流水和研发费用等核查不到位等违规情形等原因，受到监管机构公开处罚。

兴业证券及下属分支机构因发布证券研究报告业务客户服务行为内部控制和合规管理不到位，个别分析师的发言内容不够审慎；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等原因，受到监管机构公开处罚。

广发证券及下属分支机构因存在个别员工擅自推介非广发证券股份有限公司自主发行或代销的金融产品的行为；在非公开发行股票保荐业务中未勤勉尽责等原因，受到监管机构公开处罚。

中信证券及其下属分支机构因 6 月 19 日网络安全事件中存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏；担任某上市公司收购业务重大资产重组财务顾问过程中，在重组、持续督导等阶段未进行审慎核查、内部控制制度执行不严格；作为发行上市保荐机构，对发行人未保持应有的职业审慎并开展审慎核查，发表核查意见不准确；违反反洗钱发相关规定等，分别受到深交所、上交所、地方证监局警示函、证监会监管谈话、央行罚款等处罚。

国泰君安因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送可疑交易报告，受到中国人民银行上海分行公开处罚，并处以罚款人民币 95 万元。其分支机构巴彦淖尔金川大道证券营业部自 2021 年 9 月起建立了三个客户服务微信群，但未按照内部制度规定进行报备，群内发布的信息未经合规人员、营业部负责人审核，受到内蒙古证监局出具警示函的行政监管措施。

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	62,598.40
2	应收证券清算款	166,593.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,698,349.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	23,772.89
9	合计	3,951,314.11

### 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	153,036.00	0.01	转融通证券出借业务的股票
2	600958	东方证券	17,400.00	0.00	转融通证券出借业务的股票
3	000776	广发证券	14,290.00	0.00	转融通证券出借业务的股票
4	600837	海通证券	9,370.00	0.00	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	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限 情况说明
1	688347	华虹公司	2,188,886.52	0.12	新股锁定
2	688563	航材股份	88,859.81	0.00	新股锁定
3	688548	广钢气体	51,612.00	0.00	新股锁定
4	603296	华勤技术	46,105.75	0.00	新股锁定
5	301526	国际复材	43,267.35	0.00	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
本报告期期初基金份额总额	1,754,134,989.63	33,097,369.76
报告期期间基金总申购份额	111,050,244.25	51,676,627.38
减：报告期期间基金总赎回份额	85,995,479.91	32,563,823.41
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,779,189,753.97	52,210,173.73

## § 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	103,241.79
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	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

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、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 15-20 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  
二〇二四年一月二十二日