

国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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	国泰行业轮动股票（FOF-LOF）
场内简称	行业轮动 FOF
基金主代码	501220
基金运作方式	契约型开放式。本基金封闭运作期为一年，为自基金合同生效之日起（含该日）至一年后的年度对日的前一日（含该日）的期间。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务，但本基金 A 类基金份额的持有人可在 A 类基金份额上市交易后通过上海证券交易所转让 A 类基金份额。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称相应变更为“国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-LOF）”，可办理 A 类基金份额的场外、场内申购赎回，以及 C 类基金份额的场外申购赎回，A 类基金份额继续在上海证券交易所上市交易，C 类基金份额不上市交易。
基金合同生效日	2022 年 7 月 19 日
报告期末基金份额总额	66,828,559.85 份
投资目标	在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，追求基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、基金投资策略；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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金中基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、货币型基金中基金（FOF）、

	债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、混合型基金和混合型基金中基金（FOF）。 本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国泰行业轮动股票（FOF-LOF）A	国泰行业轮动股票（FOF-LOF）C
下属两级基金的场内简称	行业轮动	-
下属两级基金的交易代码	501220	014197
报告期末下属两级基金的份额总额	66,398,025.24 份	430,534.61 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)	
	国泰行业轮动股票 (FOF-LOF) A	国泰行业轮动股票 (FOF-LOF) C
1.本期已实现收益	-8,203,310.52	-44,527.63
2.本期利润	-5,358,792.76	-23,264.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0783	-0.0648
4.期末基金资产净值	56,336,347.56	363,132.11
5.期末基金份额净值	0.8485	0.8434

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、国泰行业轮动股票（FOF-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	-8.23%	0.84%	-5.37%	0.63%	-2.86%	0.21%
过去六个月	-14.91%	0.95%	-8.22%	0.68%	-6.69%	0.27%
过去一年	-13.59%	0.87%	-8.22%	0.68%	-5.37%	0.19%

自基金合同生效起至今	-15.15%	0.74%	-15.21%	0.75%	0.06%	-0.01%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

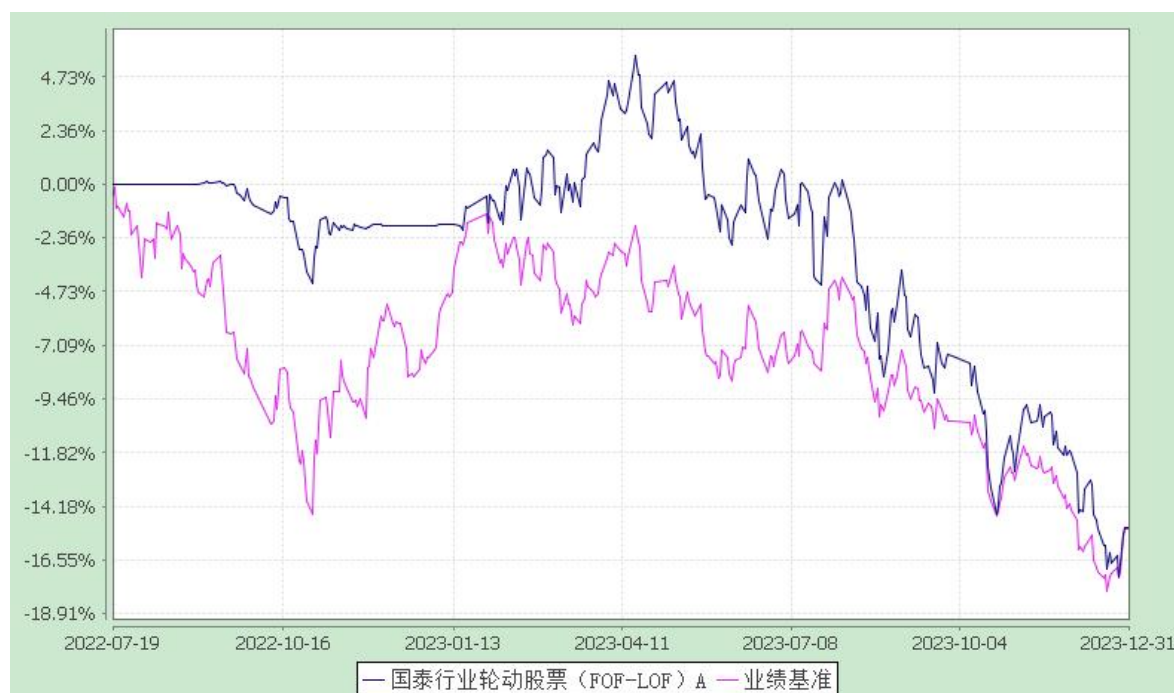
2、国泰行业轮动股票（FOF-LOF）C：

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	-8.34%	0.84%	-5.37%	0.63%	-2.97%	0.21%
过去六个月	-15.10%	0.95%	-8.22%	0.68%	-6.88%	0.27%
过去一年	-13.95%	0.87%	-8.22%	0.68%	-5.73%	0.19%
自基金合同生效起至今	-15.66%	0.74%	-15.21%	0.75%	-0.45%	-0.01%

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

国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-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
(2022 年 7 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日)

1. 国泰行业轮动股票（FOF-LOF）A：



注：本基金的合同生效日为2022年7月19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. 国泰行业轮动股票（FOF-LOF）C：



注：本基金的合同生效日为2022年7月19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。

§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		
周珞晏	本基金的基金经理	2022-07-19	2023-12-28	14 年	硕士研究生。先后任职于石油价格信息服务公司（美国）、德意志银行（美国），从事原油、美股等投资品种的交易策略及相关系统的研发。2011 年 8 月至 2014 年 8 月在莫尼塔（上海）投资发展有限公司任宏观研究员，从事宏观经济及全球投资策略的研究工作。2014 年 8 月加入国泰基金，历任高级研究员、投资经理，从事大类资产配置策略的研究以及专户产品的投资工作，任投资经理期

					<p>间，负责研究、管理数只 FOF 策略专户产品。2019 年 8 月起任国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2022 年 7 月至 2023 年 7 月任国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）的基金经理，2022 年 7 月起兼任国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2022 年 9 月起兼任国泰瑞悦 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）的基金经理，2023 年 1 月起兼任国泰民享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理，2023 年 7 月至 2023 年 12 月任国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-LOF）（由国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）转换而来）的基金经理。2019 年 4 月起任投资副总监（FOF）。</p>
晏曦	本基金的基金经理	2022-07-20	2023-12-28	11 年	<p>硕士研究生。曾任职于苏格兰皇家银行、中信证券、华宸未来基金，2015 年 3 月加入国泰基金，历任研究员、投资经理。2022 年 2 月起</p>

				<p>任国泰上证综合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，2022 年 7 月至 2023 年 7 月任国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证新能源汽车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 3 月起兼任国泰国证绿色电力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 月起兼任国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型</p>
--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证有色金属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 7 月至 2023 年 12 月任国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-LOF）（由国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）转换而来）的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证内地运输主题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 9 月起兼任国泰富时中国国企开放共赢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。</p>
曾辉	<p>国泰优选领航一年持有期混合（FOF）、国泰行业轮动股票（FOF-LOF）、国泰民安养老 2040 三年持有混合（FOF）、国泰稳健收益一年持有混合（FOF）的基金经理</p>	2023-12-28	-	11 年	<p>硕士研究生。曾任职于平安人寿、国泰基金和财通证券等。2023 年 9 月再次加入国泰基金，2023 年 11 月起任国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2023 年 12 月起兼任国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金（FOF）和国泰行业轮动股票型基金中基</p>

					金（FOF-LOF）的基金经理。2023 年 9 月起任 FOF 投资部副总监。
--	--	--	--	--	------------------------------------------

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，除 10 月下旬至 11 月上旬、年底两次短暂的反弹之外，股市仍呈持续下跌态势。宏观经济基本面复苏放缓、外资持续流出、机构持仓结构有待优化，是股市持续下跌的主要原因。结构上，大部分行业下跌，仅煤炭、消费电子等少数行业和大类资产的黄金上涨。本报告期末做了较大幅度调仓，主要是基于均值回归基础之上的极端超跌模式，配置以下三类超跌资产：一是逐步布局港股等行业基金，港股互联网和科技公司已经进入历史超跌极值区域，基本面景气明显

回升兼有实质性改革，短期权重个股轮番大跌的同时也意味着外资抛压临近枯竭，南向资金定价权增强，未来有望迎来内地基本面回暖和外资流入的戴维斯双升，价值回归只会迟到但不会缺席；二是逐步买入上游有色基金，有色因美元指数高位回落可能重新定价，除黄金将受益于美联储降息周期外，铝和铜的供给格局好、需求回暖，而上游资源如锂矿也从最高 60 万跌至近期的最低 8 万，有望加速行业产能出清，迎来久违的阶段反弹；三是政策驱动和整合预期的证券行业，下降空间小兼有市场触底后的看涨弹性。上述这些行业分散布局、动态配置，目前的风险收益比非常有吸引力，让本组合有信心逆势布局，为明年打造具备一定弹性的进攻组合。

4.5 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-8.23%，同期业绩比较基准收益率为-5.37%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-8.34%，同期业绩比较基准收益率为-5.37%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，伴随政策加码，经济基本面复苏预期将好于当下，且美联储降息周期逐步开启、外部流动性将明显改善。但基本面和整体流动性双双改善之外，股市机构持仓仍未充分优化到位，股市近 2 年财富效应不佳，市场情绪仍较低迷，因此预计股市仍将呈现存量博弈特征，但行业分化较大，部分行业见新一轮中长期景气周期起点，有布局机会。在均值回归-超涨超跌的投资框架下，以原则体系和量化体系的方法加强宏观风控和优化行业基金轮动模式，以防御型的行业基金控制最大回撤、以进攻性的卫星基金灵活捕捉股市结构性机会。未来将加大红利风格的煤炭、黄金、有色等配置，逐步建仓中期景气向上或深度超跌的整车、教育等配置，加强组合进攻锐度，同时发挥 ETF-FOF 真正实现跨市场、多资产配置、快速轮动的特色，力争实现最大回撤和年化收益双重投资目标。

4.7 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	52,823,184.61	83.03
3	固定收益投资	3,151,218.80	4.95
	其中：债券	3,151,218.80	4.95
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	411,279.87	0.65
7	其他各项资产	7,230,438.68	11.37
8	合计	63,616,121.96	100.00

5.2 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。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,319,502.80	2.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,831,716.00	3.23
	其中：政策性金融债	1,831,716.00	3.23
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	3,151,218.80	5.56

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	018021	国开 2303	18,000	1,831,716.00	3.23
2	019703	23 国债 10	11,000	1,115,616.99	1.97
3	019694	23 国债 01	2,000	203,885.81	0.36

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“国家开发银行”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。

国家开发银行下属分支机构因贷后管理未尽职，未检查、监督贷款用途，贷款资金回流借款人；向违规项目发放贷款；违规变相发放土地储备贷款；贷款管理不审慎，形成不良；未严格执行受托支付；信贷管理不到位、不审慎；在项目贷前发现重大风险仍发放贷款；向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；未按项目进度放款；贷后管理不尽职，贷款资金回流借款人；贷款风险分类不准确；收取质价不符的银团贷款安排费；贷款发放不规范；个别项目存在超额授信且未落实重要还款来源；贷款发放未执行实贷实付，导致信贷资金滞留账户；未有效监督信贷资金用途，信贷资金被挪用；应急贷款贷后管理不尽职；违规发放贷款；未严格执行内控制度，瞒报案件风险信息；员工管理不到位；项目贷款“三查”不到位；内控制度执行不到位；违规收取小微企业贷款承诺费等原因，受到监管机构公开处罚。

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	177,464.28
2	应收证券清算款	7,001,673.36

3	应收股利	24,365.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,936.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,230,438.68

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 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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515880	国泰中证全指通信设备 ETF	开放式	8,201,165.00	8,480,004.61	14.96%	是
2	513330	华夏恒生互联网科技业 ETF(QD II)	开放式	23,990,000.00	8,348,520.00	14.72%	否
3	159881	有色 60	开放式	9,000,000.00	8,280,000.00	14.60%	是
4	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	开放式	8,240,000.00	7,432,480.00	13.11%	是
5	513130	华泰柏瑞南方东英恒	开放式	14,500,000.00	7,192,000.00	12.68%	否

		生科技 ETF(QD II)					
6	561100	富国中 证消费 电子主 题 ETF	开放式	7,000,00 0.00	4,893,000. 00	8.63%	否
7	159840	锂电池 50	开放式	10,000,0 00.00	4,840,000. 00	8.54%	否
8	512660	国泰中 证军工 ETF	开放式	1,198,70 0.00	1,150,752. 00	2.03%	是
9	516110	国泰中 证 800 汽 车与零 部件 ETF	开放式	1,107,10 0.00	1,122,599. 40	1.98%	是
10	515230	国泰中 证全指 软件 ETF	开放式	1,409,40 0.00	1,083,828. 60	1.91%	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管 理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购 费	-	-
当期交易基金产生的赎回 费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支 付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支 付管理费（元）	71,155.96	42,035.18
当期持有基金产生的应支 付托管费（元）	14,276.80	650.93
当期交易基金产生的交易 费（元）	9,480.34	5,331.18
当期交易基金产生的转换	-	-

费（元）		
------	--	--

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰行业轮动股票 (FOF-LOF) A	国泰行业轮动股票 (FOF-LOF) C
本报告期期初基金份额总额	82,169,151.69	245,359.06
本报告期基金总申购份额	129,172.05	449,642.41
减：本报告期基金总赎回份额	15,900,298.50	264,466.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	66,398,025.24	430,534.61

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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	49,008,711.00
报告期期间买入/申购总份额	111,681.93
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	49,120,392.93
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	73.50

8.2 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	2023-10-18	111,681.93	100,000.00	-
合计			111,681.93	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。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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10月01日至2023年12月31日	49,008,711.00	111,681.93	-	49,120,392.93	73.50%
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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）注册的批复
- 2、国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）基金合同
- 3、国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-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

10.2 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。

10.3 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