

国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接 基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 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。

为了更好地满足投资人的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和本基金基金合同的有关约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定自 2024 年 6 月 13 日起对本基金增加 E 类基金份额，并据此相应修改基金合同和托管协议的部分条款。具体可查阅本基金管理人于 2024 年 6 月 13 日发布的《关于国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	国泰中证医疗 ETF 联接
基金主代码	012634
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 23 日
报告期末基金份额总额	461,626,239.48 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	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、可转换债券和可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、股指期货投资策略；9、融资与转融通证券出借投资策略。		
业绩比较基准	中证医疗指数收益率*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，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。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	华夏银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	国泰中证医疗 ETF 联接 A	国泰中证医疗 ETF 联接 C	国泰中证医疗 ETF 联接 E
下属分级基金的交易代码	012634	012635	021681
报告期末下属分级基金的份额总额	124,291,089.89 份	296,000,888.42 份	41,334,261.17 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159828
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 24 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 12 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	华夏银行股份有限公司

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：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、存托凭证投资策略； 3、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	中证医疗指数收益率
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。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证医疗指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	国泰中证医疗 ETF 联接 A	国泰中证医疗 ETF 联接 C	国泰中证医疗 ETF 联接 E
	1.本期已实现收益	-5,912,028.24	-13,871,797.88
2.本期利润	-5,713,098.82	-11,811,547.48	-722,909.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0457	-0.0445	-0.0151
4.期末基金资产净值	47,163,987.43	111,321,497.40	15,679,394.11

5.期末基金份额净值	0.3795	0.3761	0.3793
------------	--------	--------	--------

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、国泰中证医疗 ETF 联接 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	-10.56%	1.21%	-11.17%	1.23%	0.61%	-0.02%
过去六个月	-22.85%	1.51%	-23.47%	1.53%	0.62%	-0.02%
过去一年	-28.60%	1.37%	-29.06%	1.40%	0.46%	-0.03%
过去三年	-62.03%	1.52%	-67.21%	1.66%	5.18%	-0.14%
自基金合同 生效起至今	-62.05%	1.52%	-66.50%	1.66%	4.45%	-0.14%

2、国泰中证医疗 ETF 联接 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	-10.64%	1.21%	-11.17%	1.23%	0.53%	-0.02%
过去六个月	-22.96%	1.51%	-23.47%	1.53%	0.51%	-0.02%
过去一年	-28.81%	1.37%	-29.06%	1.40%	0.25%	-0.03%
过去三年	-62.37%	1.52%	-67.21%	1.66%	4.84%	-0.14%
自基金合同 生效起至今	-62.39%	1.52%	-66.50%	1.66%	4.11%	-0.14%

3、国泰中证医疗 ETF 联接 E：

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
自新增 E 类 份额起至今	-7.01%	1.07%	-7.13%	1.02%	0.12%	0.05%

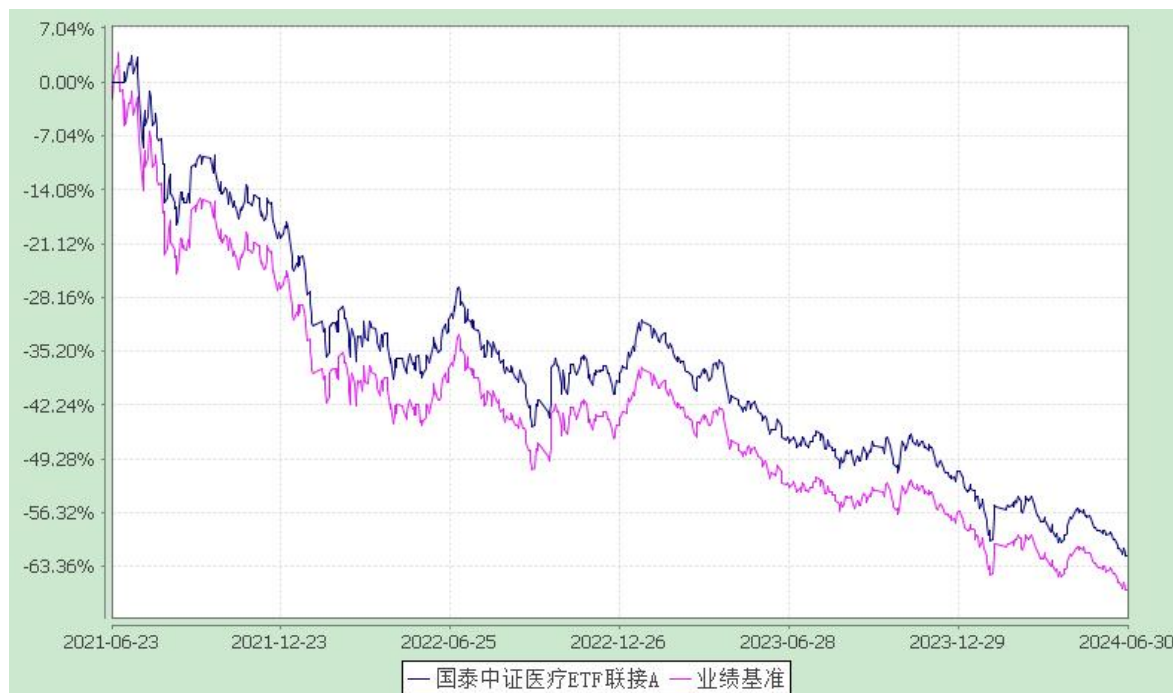
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
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

(2021 年 6 月 23 日至 2024 年 6 月 30 日)

1. 国泰中证医疗 ETF 联接 A:



注：本基金合同生效日为 2021 年 6 月 23 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. 国泰中证医疗 ETF 联接 C:



注：本基金合同生效日为 2021 年 6 月 23 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。

3. 国泰中证医疗 ETF 联接 E:



注：（1）本基金合同生效日为 2021 年 6 月 23 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）自 2024 年 6 月 13 日起，本基金新增 E 类基金份额并设置对应的基金代码。自 2024 年

6 月 14 日起，E 类基金开始有份额并计算净值。

§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		
梁杏	国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰国证医药卫生行业指数、国泰国证食品饮料行业指数、国泰量化收益灵活配置混合、国泰中证生物医药 ETF、国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接、国泰上证综合 ETF、国泰中证医疗 ETF、国	2021-06-23	-	17 年	学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 月至 2020 年 12 月任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2019 年 4 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 7 月起兼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，2019 年 4 月起兼任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 11 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发起式联接基金（由国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 1 月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、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任

	<p>泰中证畜牧养殖 ETF、国泰中证医疗 ETF 联接、国泰中证全指软件 ETF 联接、国泰中证畜牧养殖 ETF 联接、国泰中证沪港深创新药产业 ETF、国泰中证沪港深创新药产业 ETF 发起联接、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF 的基金经理、国泰中证港股通科技 ETF、国</p>			<p>国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）的基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 2 月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，2021 年 2 月至 2022 年 2 月任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月起兼任国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证医疗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全指软件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，2021 年 7 月起兼任国泰中证畜牧养殖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，2021 年 9 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业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，2021 年 12 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰中证有色金属矿业主题交</p>
--	--	--	--	---

	泰中证 有色金 属矿业 主题 ETF、国 泰中证 有色金 属 ETF 的基金 经理， 总经理 助理、 量化投 资部总 监			易型开放式指数证券投资基金和 国泰中证有色金属交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量 化投资部副总监，2018 年 7 月起 任量化投资部总监，2023 年 11 月 起任总经理助理。
--	--	--	--	---

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

今年一季度医药医疗板块大幅下跌超 10%，相比于沪深 300 指数 3.1% 的涨幅，属于大幅超跌，期间受到了 CXO 龙头公司可能被美国众议院草案波及的影响，行业整体跟随下行。二季度医药指数先反弹后下跌，沪深 300 指数下跌 2.14%，中证医疗指数下跌 11.75%，医药医疗板块继续超跌。二季度并未出现如一季度般的负面事件，但疑云犹在，市场信心较为脆弱。即便国家大会提及新质生产力、生物医药、创新药，以及各地政府陆续出台生物医药、创新药产业的支持政策，亦有药企持续出海，获取不错的授权收入，医药行业表现依然远逊于大盘。医疗 ETF 联接 A 和 C 分别下跌 10.56% 和 10.64%，较好地实现了对标的指数的跟踪。

作为行业指数基金，本基金旨在为看好医药行业的投资者提供投资工具。本报告期内，我们根据对市场行情、日常申赎情况和成份股停复牌的分析判断，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平，尽量为投资者提供更精准的投资工具。

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-10.56%，同期业绩比较基准收益率为-11.17%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-10.64%，同期业绩比较基准收益率为-11.17%。

本基金 E 类自新增 E 类份额以来的净值增长率为-7.01%，同期业绩比较基准收益率为-7.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

医药医疗行业当前处在四重底部区域，分别是估值的相对底部区域、基本面的底部区域、政策的底部区域和创新爆发的底部区域。行业指数持续横盘震荡已超过一年，按照医药医疗行业过往牛长熊短的特征，伴随医疗消费需求复苏、政策持续推进、新技术新产品加快上市放量、业绩有望回暖和资金加仓等多重驱动之下，当下或已处于下一轮医药医疗新周期的起点。

中国创新药对全球创新药贡献度提升，未来将扮演关键角色。近几年，中国创新药开始进入国际舞台，创新大单品待爆发。国内创新药研发能力在出海中得到验证，交易对价之最近年来不断被刷新。从 2023 年度交易额 top10 来看，ADC 项目占 7 个，其余为小分子、双抗/多抗、CAR-T。凭借研发端与海外药企合作以降低研发风险、销售端借助对方成熟商业化团队以实现快

速进入海外市场并获得现金流。创新出海进入全新阶段（license out 项目与金额增加、FDA 批准国产创新药上市、已上市创新药销售创新高），同时叠加研发端在疾病领域（GLP-1 等）与新技术平台（ADC 等）的不断突破。临床数据读出、医保谈判、潜在的海外授权等都有望催化创新药板块的行情。

基本面来看，国内医药上市公司收入增长有望见底反转，过去 3 年整体收入增长受集采、疫情等多因素交织影响，2024 年疫情、行业整顿等影响减小。从生物医药行业 23 年一季报、中报、三季报来看，业绩也呈现逐季改善的情况。细分板块业绩来看，生物制药的业绩韧性较强。23 年第三季度医药板块各子行业（按申万三级行业分类）的表现，收入增速为生物制药>中成药>医药商业>化学制剂>原料药>医疗服务>医疗器械；扣非归母净利润增速为：生物制药>中成药>化学制剂>医药商业>医疗服务>原料药>医疗器械。2024 年在刚需驱动和创新催化的推动下，医药行业景气度有望向上。

医保政策也处在优化阶段。随着可集采品种的减少和集采规则的温和，医药行业内部衍生出政策集采为代表的药品调整也进入了尾声。近期高值耗材集采规则更加完善，企业中选率高，产品需求量大，且整体降价幅度温和。除了影响深远的集采，医疗反腐在近期也成为了一个影响较大的政策因子。但国家卫健委提出不得随意打击正规学术会议后，医疗反腐最艰难时刻或已过。尽管新一轮医疗反腐重启，相较上一次影响有望减轻。

中长期维度来看，医药医疗行业创新驱动、人口老龄化和消费升级的逻辑长期贯穿，政策也会促进企业在格局优化、动能切换中迎来更好地高质量发展。展望 2024 年，医药板块政策预期和业绩低点或已过，2024 年有望迎来业绩和政策面双重改善。低基数环境下，营收利润增长的复苏和创新管线的逐步兑现，有望带来医药医疗板块的系统性景气度改善。

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	24,897,951.00	11.56
	其中：股票	24,897,951.00	11.56
2	基金投资	156,697,637.58	72.75
3	固定收益投资	3,216,789.26	1.49
	其中：债券	3,216,789.26	1.49
	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	19,758,508.72	9.17
8	其他各项资产	10,817,199.48	5.02
9	合计	215,388,086.04	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	国泰基金管理有限公司	156,697,637.58	89.97

5.3 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	-	-
C	制造业	16,280,082.00	9.35
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	621,270.00	0.36
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	3,202,407.00	1.84
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	4,794,192.00	2.75
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,897,951.00	14.30

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

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	300760	迈瑞医疗	11,700	3,403,647.00	1.95
2	300015	爱尔眼科	304,200	3,139,344.00	1.80
3	300896	爱美客	11,700	2,013,570.00	1.16
4	300347	泰格医药	35,100	1,705,860.00	0.98
5	300832	新产业	23,400	1,578,096.00	0.91
6	002223	鱼跃医疗	35,100	1,319,760.00	0.76
7	300003	乐普医疗	81,900	1,215,396.00	0.70
8	300759	康龙化成	58,500	1,086,930.00	0.62
9	300529	健帆生物	35,100	955,071.00	0.55
10	002432	九安医疗	23,400	948,636.00	0.54

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	3,216,789.26	1.85
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	3,216,789.26	1.85

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	019740	24 国债 09	24,000	2,408,204.71	1.38
2	019733	24 国债 02	8,000	808,584.55	0.46

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（除“乐普医疗”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。

乐普(北京)医疗器械股份有限公司因未在预计触发转股价格修正条件的 5 个交易日前及时披露提示性公告，未在触发转股价格修正条件当日履行相应审议程序并披露相关提示性公告，未及时披露公司重大事项，重大事项未履行审议程序，受到深圳证券交易所监管关注的监督管理措施。

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。

5.12.2 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	45,708.42
2	应收证券清算款	9,587,892.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	285,789.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	897,809.16
9	合计	10,817,199.48

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	国泰中证医疗 ETF联接A	国泰中证医疗 ETF联接C	国泰中证医疗 ETF联接E
本报告期初基金份额总额	121,968,999.19	258,094,256.67	-
报告期期间基金总申购份额	19,710,688.66	129,585,178.96	106,244,405.41
减：报告期期间基金总赎回份额	17,388,597.96	91,678,547.21	64,910,144.24
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	124,291,089.89	296,000,888.42	41,334,261.17

§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	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	492,499.21
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	10,492,499.21
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.27

7.2 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	2024-06-14	492,499.21	200,000.00	-
合计			492,499.21	200,000.00	

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。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份 额比例	发起份 额总 数	发 起 份 额 占 基 金 总 份 额 比 例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,492,49 9.21	2.27%	10,000,00 0.00	2.17%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,492,49 9.21	2.27%	10,000,00 0.00	2.17%	-

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复
- 2、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同
- 3、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议
- 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。

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

二〇二四年七月十九日