

国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）

2022 年第 2 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十一日

§ 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 2022 年 7 月 19 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基金合同的有关约定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定对本基金增加 C 类基金份额并相应修改基金合同的部分条款。自 2022 年 5 月 18 日起，本基金新增 C 类基金份额及修订后基金合同生效。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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
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	1,972,863,902.99 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	1,972,863,200.03 份	702.96 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 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 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	-9,251,356.12	1.40
2.本期利润	46,825,812.97	15.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0237	0.0623
4.期末基金资产净值	2,063,555,386.73	735.75
5.期末基金份额净值	1.0460	1.0466

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	2.07%	1.84%	1.81%	1.88%	0.26%	-0.04%
过去六个月	-15.84%	1.75%	-16.23%	1.77%	0.39%	-0.02%
过去一年	-10.50%	1.59%	-12.19%	1.61%	1.69%	-0.02%
过去三年	1.35%	1.73%	-9.27%	1.77%	10.62%	-0.04%
过去五年	0.40%	1.79%	-13.91%	1.83%	14.31%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	4.60%	1.76%	-13.39%	1.81%	17.99%	-0.05%

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
自新增C类 份额起至今	11.60%	1.77%	11.37%	1.80%	0.23%	-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

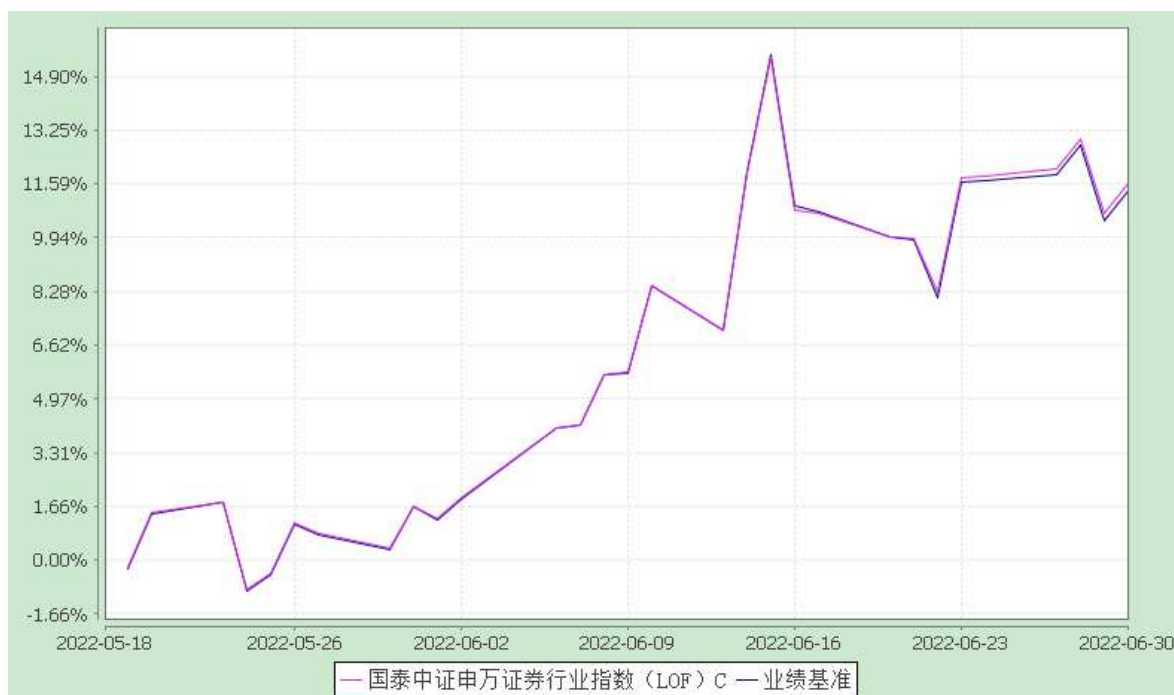
(2017 年 4 月 27 日至 2022 年 6 月 30 日)

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	2017-04-27	-	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

	<p>ETF、 国泰 国证 航天 军工 指数 （LOF ）、国 泰中 证申 万证 券行 业指 数 （LOF ）、国 泰策 略价 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 通信 设备 ETF 联 接、国 泰中</p>			<p>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</p>
--	--	--	--	---

	证全指证券公司ETF联接的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监			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

二季度受国内疫情多点散发，尤其是上海疫情封控影响，包括上海在内的长三角地区经济活动受到较大冲击，投资者对国内 2 季度的宏观经济形势预期极度悲观，A 股市场延续一季度下跌趋势，并于 4 月 27 日创下年内新低，上证指数跌穿 3000 点整数关口，最低下探至 2863.65 近两年内低点。在中央和地方各级部门纷纷出台各项稳经济措施的推动下，尤其是 5 月 25 日国务院召开直达区县的稳宏观经济大盘的万人电视电话会议，上海疫情逐步受控，投资者的悲观情绪得到缓解，叠加包括军工在内的主要上市公司出色的一季度业绩提振，军工行业带领市场率先反弹，之后在持续大力推出的刺激汽车消费政策的拉动下，包括新

能源汽车在内的稳经济大盘的政策受益行业持续走强，以比亚迪为代表的新能源汽车产业链相关公司股价纷纷创出新高；受俄乌局势持续影响，全球能源和粮食供应紧张局势加剧，以煤炭为代表的国内主要能源类公司叠加储能业务推进表现亮眼，受猪价上涨预期影响的养殖行业表现不俗。

全季度来看，上证指数震荡上涨 4.5%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 上涨 5.5%，沪深 300 指数上涨 6.21%，成长性中盘股表征指数如中证 500 上涨 2.04%，小盘股表征指数中证 1000 上涨 3.3%。板块上新能源汽车、医药医疗科技占比较多的创业板指上涨 5.68%，科创板 50 上涨 1.34%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的为汽车、食品饮料、电力设备，涨幅分别为 23.09%、22.19%和 15.1%，表现落后的为房地产、计算机、综合，分别下跌了 8.94%、8.03%和 4.75%。

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 2.07%，同期业绩比较基准收益率为 1.81%。

本基金 C 类自新增 C 类份额以来的净值增长率为 11.60%，同期业绩比较基准收益率为 11.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 季度受疫情封控影响，国内经济面临近几年最大的压力，3 季度即将迎来党的 20 大的召开，下半年国内经济对于全年经济达到或基本达到今年的目标至关重要，我们预计国内宏观流动性将保持合理充裕，各项稳经济政策将持续发力，经济活动恢复有望加快，整体上有利于投资者信心的修复。

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。

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	1,936,123,262.64	93.30
	其中：股票	1,936,123,262.64	93.30
2	固定收益投资	3,345,249.27	0.16
	其中：债券	3,345,249.27	0.16
	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	131,406,800.35	6.33
7	其他各项资产	4,378,546.83	0.21
8	合计	2,075,253,859.09	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63,387,554.00元，占基金资产净值比例为3.07%。

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	6,384,970.86	0.31
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	21,401.16	0.00
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	140,365.95	0.01
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	30,307.77	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	243,311.08	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,029,977.51	0.34

5.2.2 指数投资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	-	-
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	1,929,093,285.13	93.48
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	1,929,093,285.13	93.48

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	300059	东方财富	11,230,025	285,242,635.00	13.82
2	600030	中信证券	12,112,861	262,364,569.26	12.71
3	600837	海通证券	11,981,321	117,536,759.01	5.70
4	601688	华泰证券	7,304,103	103,718,262.60	5.03
5	601211	国泰君安	5,595,792	85,056,038.40	4.12
6	000776	广发证券	3,673,123	68,687,400.10	3.33
7	600999	招商证券	4,605,988	66,372,287.08	3.22
8	600958	东方证券	6,489,339	66,256,151.19	3.21

9	000166	申万宏源	11,186,765	47,991,221.85	2.33
10	601377	兴业证券	6,648,358	46,870,923.90	2.27

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	688223	晶科能源	201,356	2,913,621.32	0.14
2	688349	三一重能	32,650	1,330,487.50	0.06
3	688072	拓荆科技	5,300	740,834.00	0.04
4	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
5	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01

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	-	-
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）	3,345,249.27	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,345,249.27	0.16

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	113060	浙 22 转债	33,450	3,345,249.27	0.16

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“中信证券”、“国泰君安”、“广发证券”、“兴业证券”、“海通证券”、“招商证券”、“华泰证券”、“东方证券”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。

中信证券及其下属分支机构因于 2015 年设立中信证券海外投资有限公司但未按

照当时《证券法》第一百二十九条的规定报监管机构批准、未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达 8 层等问题、存在境外子公司从事房地产基金管理等非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题、对公司总部制度规定落实不到位、未对自行制作的宣传材料提交总部审核、分公司自行制作的宣传材料内部审核流于形式、仅采用口头方式进行，无审核留痕、分公司个别员工向投资者分发的宣传材料存在不当表述且未提示投资风险、信息系统使用不当、增加经营场所未及时向监管部门报告、向风险等级高于其风险承受能力的投资者发送产品推介短信的情形、融资融券合同、股票期权经纪合同、投资者开户文本未采取领用、登记控制，未采取连号控制、作废控制，保管人与使用人未分离、部分柜台业务存在客户开户资料重要信息填写缺失等原因，多次受到监管机构警示函、责令改正处分等处罚。

国泰君安及其下属分支机构因营业部负责人兼任合规风控岗、从事信息技术及合规风控的人员经办客户账户业务、部分客户开户资料存在不完整不准确的情况、未勤勉尽责履行充分的核查程序并合并披露相关信息、涉诉专利涉及产品金额前后披露不一致且差异大、对发行人相关流水核查存在依赖发行人提供资料的情形、对部分符合回访筛选标准的投顾签约投资者未进行回访等原因，多次受到监管机构警示函、责令改正措施等处罚。

广发证券部分分支机构因存在为客户之间的融资提供中介便利的违规行为、未履行特别提醒和通知义务、产品变更的征询期安排不合理、投资者权利保障不到位等原因，受到监管机构警示函处罚。

兴业证券因未按规定履行客户身份识别义务、研究报告观点论证不严密、数据不一致，文字表述不严谨等原因，受到监管机构罚款处分、警示函等处罚。

海通证券作为西南药业股份有限公司（现称“奥瑞德”）重大资产重组并募集配套资金项目独立财务顾问，未对奥瑞德违规对外担保事项保持充分关注导致未能

发现奥瑞德违规对外提供担保事项，未能发现奥瑞德相关信息披露存在遗漏，未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，受到监管机构公开处罚，责令改正。

招商证券因变更管理不完善，应急处置不及时、不到位、集中交易系统发生技术故障，导致大量客户成交回报缓慢、部分客户无法登录系统交易，并且导致部分客户报价回购交易申报未成功等原因，受到监管机构责令改正处分、警示函等处罚。

华泰证券因部分场外期权合约个股挂钩标的超出当期融资融券范围、未对部分期限小于 30 天的场外期权合约出具书面合规意见书、场外期权业务相关内部制度不健全、内部流程执行不规范、未按要求进行衍生品准入管理等原因，受到中国证监会责令改正措施。

东方证券因存在信息系统权限管理未遵循最小权限原则，信息系统的业务参数修改未建立有效复核流程收到上海证监局警示函。

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	86,840.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	13,693.70
4	应收利息	-

5	应收申购款	4,253,764.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	24,248.52
9	合计	4,378,546.83

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 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	601211	国泰君安	1,102,000.00	0.05	转融通证券出借业务的股票
2	600999	招商证券	1,109,570.00	0.05	转融通证券出借业务的股票
3	600958	东方证券	1,123,100.00	0.05	转融通证券出借业务的股票
4	600837	海通证券	245,250.00	0.01	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	688223	晶科能源	2,913,621.32	0.14	新股锁定
2	688072	拓荆科技	740,834.00	0.04	新股锁定
3	688400	凌云光	287,524.23	0.01	网下中签
4	301175	中科环保	243,311.08	0.01	网下中签

§ 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	1,933,009,203.70	-
报告期期间基金总申购份额	261,450,030.37	702.96
减：报告期期间基金总赎回份额	221,596,034.04	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,972,863,200.03	702.96

§ 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

本报告期内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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

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基金合同的有关约定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定对本基金增加 C 类基金份额并相应修改基金合同的部分条款。自 2022 年 5 月 18 日起，本基金新增 C 类基金份额及修订后基金合同生效。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 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

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
二〇二二年七月二十一日