

# 国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 2022 年第 4 季度报告

### 2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

## §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 1 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 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	508,323,634.86 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	500,449,514.33 份	7,874,120.53 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10月1日-2022年12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	-11,070,441.74	-112,132.73
2.本期利润	-7,663,530.19	-74,094.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0115	-0.0137
4.期末基金资产净值	572,306,429.42	8,970,944.51

5.期末基金份额净值	1.1436	1.1393
------------	--------	--------

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	-0.98%	0.21%	1.16%	0.77%	-2.14%	-0.56%
过去六个月	-1.90%	0.21%	-7.73%	0.66%	5.83%	-0.45%
过去一年	-2.67%	0.26%	-12.04%	0.77%	9.37%	-0.51%
过去三年	28.51%	0.37%	2.68%	0.78%	25.83%	-0.41%
过去五年	21.74%	0.51%	10.05%	0.78%	11.69%	-0.27%
自基金转型 起至今	21.23%	0.51%	9.02%	0.77%	12.21%	-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	-1.08%	0.21%	1.16%	0.77%	-2.24%	-0.56%
过去六个月	-2.11%	0.21%	-7.73%	0.66%	5.62%	-0.45%
自新增 C 类 份额以来	-1.24%	0.26%	-7.92%	0.78%	6.68%	-0.52%

#### 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 2022 年 12 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。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

今年四季度，市场总体呈现振荡寻底的格局。在经历了三季度的大幅调整后，十月上证指数继续探底，在逼近四月低点后开始反弹，最终主要指数小幅上涨。表现较好的是疫情恢复受益的消费类、以及估值处于长期底部的部分 TMT 行业，周期、新能源行业调整幅度较大。最终上证指数上涨 2.14%，深证成指上涨 2.22%，创业板指上涨 2.53%。从申万一级行业来看，社会服务、计算机、传媒行业表现较好，而煤炭、石油石化、电力设备等行业出现一定幅度下跌。

四季度对市场影响较大的主要是以下几个因素，一是美国通胀拐点隐现，美债收益率以及美元指数见顶回落，使得市场对美元持续加息的担忧缓解；二是国内持续出台房地产支持政策，包括保交楼、销售放松、对重点企业融资支持等，这些政策改变了市场对于房地产行业的预期，也改善了银行、家居建材产业链的预期；三是疫情防控政策的变化。四季度以来，各地疫情频发，A 股市场对于防控政策出现较大转变给予了很高预期，最终在十二月上旬，疫情防控“新十条”发布，动态清零政策结束，在此期间，与疫后经济恢复相关的消费食品饮料、商贸零售、社会服务等行业出现较大幅度反弹。

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，四季度增加了银行、保险、消费医药等股票配置，减持了部分成长股，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-0.98%，同期业绩比较基准收益率为 1.16%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-1.08%，同期业绩比较基准收益率为 1.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年，我们认为经济主基调是疫后复苏的过渡之年。从海外来看，预计美元加息周期会在一季度末到二季度终结，但也未必会很快进入降息周期，外需总体偏弱；国内在防疫政策放开后，经济增长恢复到一个正常水平值得期待。二十大后人事落定，经济政策上稳定社会预期和扩大内需是首要任务，基建投资仍将是重要手段，房地产投资在一系列政策的推动下，有望出现比较大的改观；在经历了三年疫情消耗后，我们认为消费会迎来比较大的反弹，虽然不同的变异毒株仍有再次传播的可能，但难以形成大的冲击。

新的一年，我们认为 A 股市场的主要机会来自于预期改善下的估值修复，目前市场主要指数估值均处于历史 10-30%分位，金融、消费、成长、周期均有机会。金融行业我们看好保险股负债

端触底回升、资产端收益率改善，银行股受益于地产风险化解；消费行业主要是疫后消费恢复正常，包括弹性较大的大众线下消费、医疗消费，以及和地产相关的家居建材消费；成长板块过去一年在大部分行业增速放缓的情况下，整体呈现估值收缩的趋势，目前已到达或趋近合理水平，但其中的新技术、新材料领域仍然有很多结构性机会，另外，计算机、传媒行业估值处于近五年底部，将迎来反转；周期板块我们看好贵金属、投资拉动的相关基本金属等。债券方面，整体收益率较去年有所回升，我们维持高评级中短久期信用债策略。

#### 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	111,839,737.62	18.88
	其中：股票	111,839,737.62	18.88
2	固定收益投资	442,323,939.87	74.67
	其中：债券	442,323,939.87	74.67
	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	25,006,392.82	4.22
	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	9,933,553.18	1.68
7	其他各项资产	3,297,478.80	0.56
8	合计	592,401,102.29	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	10,227,031.05	1.76
C	制造业	81,601,104.61	14.04
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	6,978,571.41	1.20
J	金融业	9,347,118.00	1.61
K	房地产业	2,233,188.00	0.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,407,178.95	0.24
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	45,545.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	111,839,737.62	19.24

**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	301035	润丰股份	129,744	11,300,702.40	1.94
2	600519	贵州茅台	3,200	5,526,400.00	0.95
3	688518	联赢激光	186,318	5,442,348.78	0.94
4	002353	杰瑞股份	138,198	3,815,646.78	0.66
5	000603	盛达资源	300,600	3,775,536.00	0.65
6	000568	泸州老窖	14,800	3,319,344.00	0.57
7	300633	开立医疗	58,300	3,196,589.00	0.55

8	601628	中国人寿	83,400	3,095,808.00	0.53
9	600521	华海药业	141,000	3,082,260.00	0.53
10	300037	新宙邦	64,700	2,812,509.00	0.48

#### 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	36,596,958.38	6.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	168,739,758.89	29.03
5	企业短期融资券	20,319,083.84	3.50
6	中期票据	137,341,979.18	23.63
7	可转债（可交换债）	93,018.54	0.02
8	同业存单	79,233,141.04	13.63
9	其他	-	-
10	合计	442,323,939.87	76.10

#### 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	400,000	41,190,356.16	7.09
2	175175	20 招证 G5	400,000	40,662,025.20	7.00
3	102001078	20 沪港务 MTN001	400,000	40,531,040.00	6.97
4	019666	22 国债 01	358,720	36,596,958.38	6.30
5	175730	21 银河 G3	300,000	30,782,753.42	5.30

#### 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“江苏银行、国信证券、光大银行、银河证券、招商证券”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。

江苏银行及其下属分支机构因未对基金销售产品实行集中统一准入管理、部分基金销售业务人员未取得基金从业资格、贷款业务严重违反审慎经营规则、贷款“三查”严重不尽职、对公贷款贷后管理不到位和内部控制失效、开立个人银行结算账户未及时备案、未按规定履行客户身份识别义务，受到中国人民银行、银保监分局罚款、责令整改等处罚。

国信证券因未按规定履行客户身份识别义务，与身份不明的客户进行交易，受到中国人民银行深圳市中心支行罚款。

光大银行及其下属分支机构因贷款风险分类不真实，掩盖不良资产、流动资金贷款管理严重不到位、个人贷款管理严重不到位，贷款管理不尽职、贷款资金流入房地产市场、统一授信管理不到位，违反流通人民币管理规定、违反人民币反假有关规定、违反国库科目设置和使用规定、未按规定履行客户身份识别义务等原因，受到人民银行、银保监会公开处罚、责令改正、公开批评等处罚。

银河证券因重点业务领域和关键岗位廉洁风险梳理不全面，未及时识别评估公募基金代销业务廉洁风险，未按要求持续跟踪报告廉洁从业风险事件，在适当性管理和融资融券业务开展中存在员工执业不规范的情况等原因，受到北京监管局警示函等处罚。

招商证券及下属分支机构因信息披露违规，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，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，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，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原因，受到上交所、深交所、中国证监会、上海证监局罚款、责令改正、没收违法所得、立案、警示函等处罚。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	55,368.85
2	应收证券清算款	3,238,893.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,216.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,297,478.80

### 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

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	002353	杰瑞股份	3,815,646.78	0.66	增发中签

## §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
本报告期期初基金份额总额	738,433,532.81	5,208,568.32
报告期期间基金总申购份额	21,000,557.70	5,257,838.46
减：报告期期间基金总赎回份额	258,984,576.18	2,592,286.25
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	500,449,514.33	7,874,120.53

### §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

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	87,320.99
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（%）	-	0.02

#### 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	2022-12-16	87,320.99	100,000.00	-
合计			87,320.99	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。

### §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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------



类别	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	2022 年 12 月 22 日至 2022 年 12 月 31 日	105,686, 079.43	-	-	105,686,079. 43	20.79%
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

二〇二三年一月二十日