

国泰创业板指数证券投资基金（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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	国泰创业板指数（LOF）
场内简称	创业板 LOF
基金主代码	160223
交易代码	160223
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日
报告期末基金份额总额	131,073,744.11 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	创业板指数收益率×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	国泰创业板指数（LOF）A	国泰创业板指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	160223	015600
报告期末下属分级基金的份额总额	125,062,806.26份	6,010,937.85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)	
	国泰创业板指数（LOF） A	国泰创业板指数（LOF） C
	1.本期已实现收益	-4,609,614.45
2.本期利润	5,421,314.35	-106,266.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0438	-0.0430
4.期末基金资产净值	152,826,379.77	7,341,472.50
5.期末基金份额净值	1.2220	1.2214

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、国泰创业板指数（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	3.71%	1.39%	2.43%	1.41%	1.28%	-0.02%
过去六个月	-13.80%	1.37%	-15.68%	1.40%	1.88%	-0.03%
过去一年	-26.31%	1.63%	-27.99%	1.68%	1.68%	-0.05%
过去三年	42.13%	1.70%	29.61%	1.74%	12.52%	-0.04%
过去五年	50.60%	1.67%	33.30%	1.69%	17.30%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	22.20%	1.56%	10.21%	1.58%	11.99%	-0.02%

##### 2、国泰创业板指数（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	3.66%	1.39%	2.43%	1.41%	1.23%	-0.02%
过去六个月	-13.86%	1.37%	-15.68%	1.40%	1.82%	-0.03%
自新增 C 类 份额起至今	-0.67%	1.43%	-2.68%	1.47%	2.01%	-0.04%

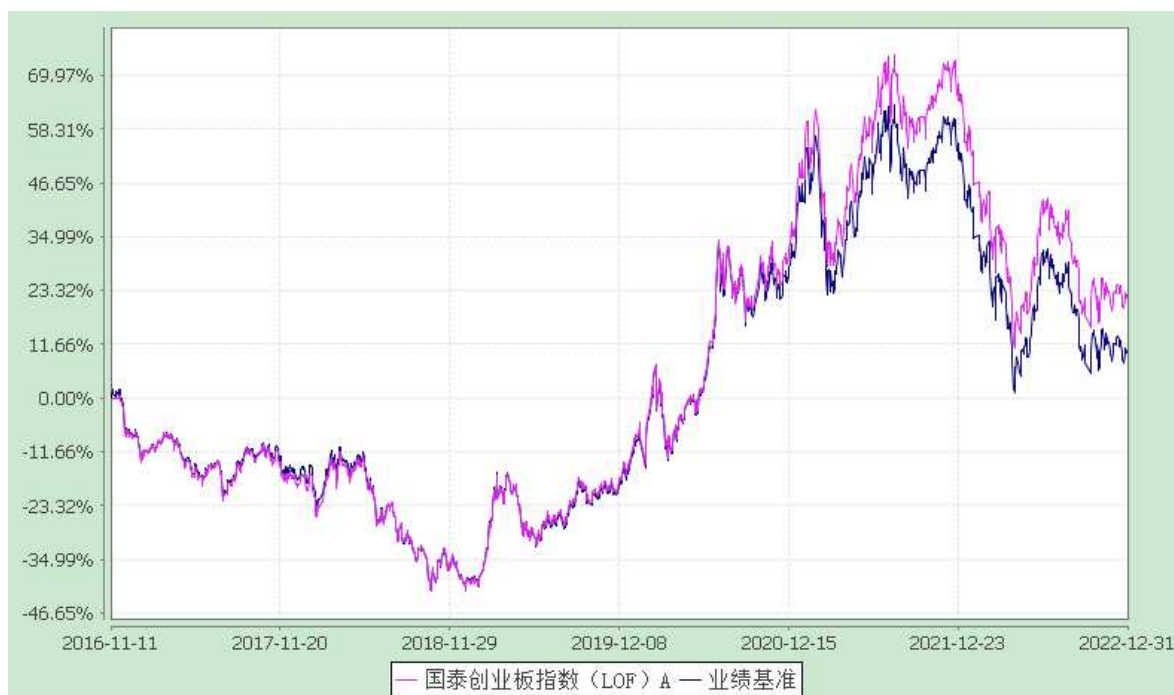
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰创业板指数证券投资基金（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

(2016 年 11 月 11 日至 2022 年 12 月 31 日)

##### 1. 国泰创业板指数（LOF）A：



注：本基金的合同生效日为 2016 年 11 月 11 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2. 国泰创业板指数（LOF）C:



注：（1）本基金的合同生效日为 2016 年 11 月 11 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）自 2022 年 5 月 20 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		
谢东旭	本基金的基金经理	2021-07-21	2022-12-30	12年	<p>硕士研究生。曾任职于中信证券、华安基金管理有限公司、创金合信基金管理有限公司。2018年7月加入国泰基金，任基金经理助理。2019年11月至2020年12月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2019年11月至2022年2月任国泰中证500指数增强型证券投资基金的基金经理，2019年11月至2022年12月任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）和国泰沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理，2020年8月至2022年12月任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，2021年1月至2022年12月任国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰沪深300指数证券投资基金和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7月至2022年12月任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、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</p>

					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，2021 年 12 月至 2022 年 12 月任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
徐成城	国泰纳斯达克 100（QDI I-ETF）、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰	2022-12-30	-	17 年	硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金，历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月至 2021 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 2 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 2021 年 7 月任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和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，2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 12 月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

	<p>中证 细分 机械 设备 产业 主题 ETF、 国泰 中证 800 汽 车与 零部 件 ETF、 国泰 中证 细分 机械 设备 产业 主题 ETF 联 接、国 泰中 证有 色金 属 ETF、 国泰 中证 动漫 游戏 ETF 联 接、国 泰中 证光 伏产 业 ETF、 国泰 中证 800 汽 车与 零部</p>			<p>药交易型开放式指数证券投资 基金的基金经理，2020 年 1 月起兼任国泰中证煤炭交易 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 1 月至 2021 年 7 月任国泰中证煤炭交易型开 放式指数证券投资基金发起 式联接基金和国泰中证钢铁 交易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金的基金 经理，2020 年 2 月起兼任国泰 中证全指家用电器交易型开 放式指数证券投资基金的基 金经理，2020 年 3 月起兼任国 泰中证新能源汽车交易型开 放式指数证券投资基金的基 金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月任国泰中证全指家用 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，2021 年 1 月至 2021 年 7 月任国 泰国证房地产行业指数证券 投资基金（由国泰国证房地 产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 2 月起 兼任国泰中证动漫游戏交易 型开放式指数证券投资基金 的基金经理，2021 年 4 月起 兼任国泰中证细分机械设 备产业主题交易型开放式 指数证券投资基金和国泰中 证 800 汽车与零部 件交易型开放式指数证券 投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证细分机 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 证有色金属交易型开 放式指数证券投资基</p>
--	---	--	--	--



	<p>件 ETF 发起联接、国泰中证有色金属 ETF 发起联接、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰标普 500ETF、国泰中证有色金属矿业主题 ETF、国泰创业板指数（LOF）的基金经理</p>			<p>金和国泰中证动漫游戏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 月起兼任国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 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，2021 年 10 月起兼任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 12 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的基金经理，2022 年 5 月起兼任国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理，2022 年 10 月起兼任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理。</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

第四季度大盘整体呈现震荡走势，上证指数上涨 2.14%。大盘蓝筹指数沪深 300 上涨 1.75%，中盘成长指数中证 500 上涨 2.63%，小盘指数中证 1000 上涨 2.56%。从行业板块表现上来看，能源板块经过前三季度的上涨后出现回撤，跌

幅为 11.58%，同时医疗保健板块在长时间的下落后在第四季度迎来回暖，涨幅为 9.88%。金融，可选消费，信息技术也均有上涨，涨幅分别为 6.41%，5.21%，和 3.70%。

从国际市场来看，美国虽然明确其限制性利率政策将持续，但是加息幅度放缓。两年期国债收益率在 11 月初触及 4.7% 的局部高点之后，回落至 4.5% 以下区间。伴随加息缓解，全球重要金融资产均出现反弹。国内方面，20 大顺利召开，并提出“高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务”，12 月的中央经济工作中同时强调“加强各类政策协调配合，形成共促高质量发展合力”，相关的利好政策也提升了对应板块的投资热情。四季度疫情管控逐步放开，受到放开和过年的双重预期影响，航空，酒店，消费类板块纷纷在年尾走强。

#### 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 3.71%，同期业绩比较基准收益率为 2.43%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 3.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

推动高质量发展的核心依赖经济结构的转型和升级，我国当前的经济调整主要仍体现在告别房地产，拥抱制造业，因此产业政策可能在未来成为驱动结构转型升级的主线。2023 年是新的一届领导班子的开局之年，随着疫情管控的开放，以及短期的冲击过去，国内经济有望得到恢复，投资人的悲观预期也有望逐步修正。

#### 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	154,163,956.73	93.45
	其中：股票	154,163,956.73	93.45
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	10,478,754.39	6.35
7	其他各项资产	327,008.86	0.20
8	合计	164,969,719.98	100.00

## 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	143,772.96	0.09
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	45,072.90	0.03
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	12,626.89	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	10,433.36	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	19,667.64	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	231,573.75	0.14

### 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	5,456,943.70	3.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	113,526,243.64	70.88
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	5,882,550.90	3.67
J	金融业	12,739,370.15	7.95
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	6,697,243.40	4.18
N	水利、环境和公共设施管理业	538,401.71	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	6,165,700.18	3.85
R	文化、体育和娱乐业	2,925,929.30	1.83
S	综合	-	-
	合计	153,932,382.98	96.11

### 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	300750	宁德时代	68,702	27,028,740.84	16.88
2	300059	东方财富	597,223	11,586,126.20	7.23
3	300760	迈瑞医疗	24,404	7,710,931.88	4.81
4	300124	汇川技术	103,363	7,183,728.50	4.49
5	300014	亿纬锂能	74,406	6,540,287.40	4.08
6	300274	阳光电源	56,129	6,275,222.20	3.92
7	300015	爱尔眼科	177,603	5,518,125.21	3.45
8	300498	温氏股份	277,990	5,456,943.70	3.41
9	300142	沃森生物	95,427	3,835,211.13	2.39
10	300122	智飞生物	42,190	3,705,547.70	2.31

#### 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	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
2	301239	普瑞眼科	173	12,054.64	0.01
3	301269	华大九天	134	11,783.96	0.01
4	301095	广立微	133	11,503.17	0.01
5	301175	中科环保	1,736	10,433.36	0.01

### 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。

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	5,824.12
2	应收证券清算款	175,030.71

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	146,154.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	327,008.86

#### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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	301239	普瑞眼科	12,054.64	0.01	新股锁定
2	301269	华大九天	11,783.96	0.01	新股锁定
3	301095	广立微	11,503.17	0.01	新股锁定
4	301175	中科环保	10,433.36	0.01	新股锁定

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰创业板指数（LOF）	国泰创业板指数（LOF）
	A	C
本报告期期初基金份额总额	121,892,134.70	506,449.60
报告期期间基金总申购份额	13,359,127.85	11,679,484.20
减：报告期期间基金总赎回份额	10,188,456.29	6,174,995.95



报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	125,062,806.26	6,010,937.85

## § 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	国泰创业板指数（LOF）A	国泰创业板指数（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	-	80,547.72
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	-	80,547.72
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.06

### 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	80,547.72	100,000.00	-
合计			80,547.72	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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰创业板指数证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰创业板指数证券投资基金（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 16 层-19 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

二〇二三年一月二十日