

# 国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

**2021 年中期报告**

**2021 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：二〇二一年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 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.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48

8.2	期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	49
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4	基金投资策略的改变.....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	52
<b>11</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
11.1	备查文件目录.....	52
11.2	存放地点.....	52
11.3	查阅方式.....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	国泰中小盘成长混合(LOF)
场内简称	国泰小盘
基金主代码	160211
交易代码	160211
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月19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
报告期末基金份额总额	205,241,020.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年1月7日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、权证投资策略；6、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	李申
	联系电话	021-31081600转	021-60637102
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	021-60637111
传真		021-31081800	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街25号

办公地址	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200082	100033
法定代表人	邱军	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层和本基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	93,063,267.46
本期利润	73,039,980.36
加权平均基金份额本期利润	0.3376
本期加权平均净值利润率	8.33%
本期基金份额净值增长率	8.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	707,842,620.46
期末可供分配基金份额利润	3.4488
期末基金资产净值	920,810,673.06
期末基金份额净值	4.486
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	473.14%

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

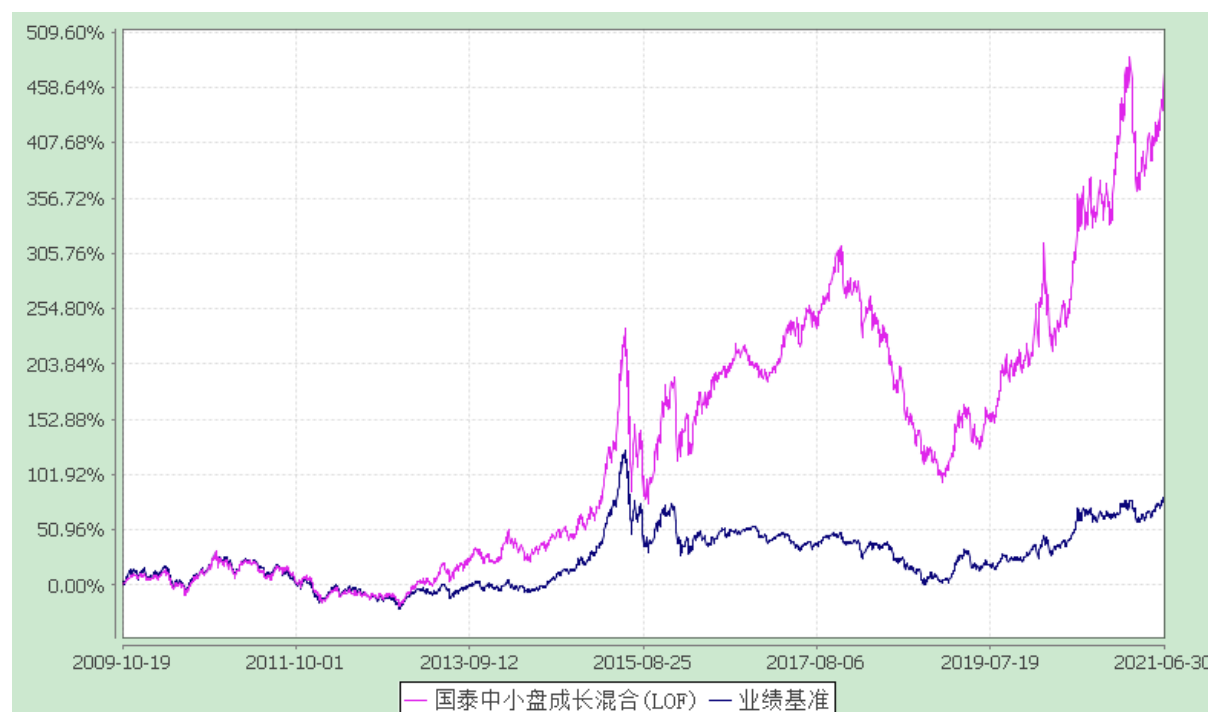
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	9.44%	1.46%	3.43%	0.91%	6.01%	0.55%
过去三个月	17.90%	1.34%	11.88%	0.86%	6.02%	0.48%
过去六个月	8.33%	1.64%	6.79%	1.11%	1.54%	0.53%
过去一年	40.72%	1.68%	19.69%	1.18%	21.03%	0.50%
过去三年	98.41%	1.78%	45.08%	1.23%	53.33%	0.55%
自基金合同生效起至今	473.14%	1.69%	80.66%	1.30%	392.48%	0.39%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2009年10月19日至2021年6月30日)



注：本基金的转型日为2009年10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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，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）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、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）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、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）、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）、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、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）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、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）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、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）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、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，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价

值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、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转型而来）、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、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、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）、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）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、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）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、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）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、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、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、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一

年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益18个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、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)、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、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、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利9个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业50交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、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、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、国泰同益18个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健6个月滚动持有债券型证券投资基金、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、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、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、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优30天滚动持有短债债券型证券投资基金、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、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、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、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、国泰中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金。另外,本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨飞	国泰金龙行业混合、国泰估值优势混合(LOF)、国泰中小盘成长混合(LOF)的基金经理	2015-05-11	-	13 年	硕士研究生。2008 年 7 月至 2009 年 8 月在诺德基金管理有限公司任助理研究员,2009 年 9 月至 2011 年 2 月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011 年 2 月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理,2015 年 3 月起兼任国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(原国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF))的基金经理,2015 年 5 月起兼任国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(原国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF))的基金经理,2015 年 5 月至 2016 年 5 月任国泰成长优选混合型证券投资基金(原国泰成长优选股票型证券投资基金)的基金经理,2016 年 2 月至 2017 年 10 月任国泰大健康股票型证券投资基金的基金经理,2016 年 4 月至 2017 年 5 月任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理,2017 年 3 月至 2021 年 7 月任国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

基金管理人所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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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，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。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场呈现 N 型波动，一季度以茅指数为代表的核心资产经历了先扬后抑的表现，二季度以半导体和新能源为代表的先进制造业大幅反弹。上半年国内宏观经济增速逐季放缓，流动性

边际改善；海外在新冠疫情的背景下，以美国为代表的经济体实行大规模刺激政策，流动性比较充裕，因此一季度后 A 股市场的风险偏好明显上升，上半年以智能制造为核心的新兴产业表现出了明显的超额收益。一季度末的政府工作报告中重点提到我国十四五期间要稳定制造业比重，实现内外双循环，重点完成三个目标：一是重点发展数字经济；二是解决卡脖子问题，重点方向在半导体行业；三是提出了碳中和与碳达峰的时间表。根据政府工作报告的目标，未来 3-5 年智能制造是 A 股市场最核心的投资方向。

本基金在一季度主要集中在科技、医药、消费等核心资产中，布局相对均衡，一季度后半段由于核心资产大幅调整，基金净值回撤比较明显。一季度后我们做了深刻反思，进化了我们的投资理念——坚定做时代投资最好的守护者。基金组合也在二季度做出了相应的调整，以时代投资为根基，选取智能制造作为未来 3-5 年的核心投资主线，基金组合在二季度大幅减持了传统消费品以及传统制造业，大幅增持了以软件为代表的信息技术和以半导体、新能源为代表的先进制造业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 8.33%，同期业绩比较基准收益率为 6.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济逐季放缓，四季度可能是全年经济增速的低点，但国内流动性可能会逐季宽松。以美国为首的海外经济体在疫情得到控制以及大规模刺激后，经济复苏可能在四季度见顶，流动性宽松的顶点可能在三季度，要警惕四季度海外流动性边际收紧的风险；另一方面中美关系有可能会反复，这些都是影响风险偏好的重要因素。经过重点反思与布局后，我们坚定了智能制造作为中长期核心投资主线和方向，基金组合在下半年的配置主要集中在信息技术与先进制造的领域，信息技术主要包括工业控制、工业软件、工业互联网、人工智能等，先进制造主要包括半导体（IC 设计公司、国产设备与材料公司），新能源（光伏与电动车），医药（CXO）等。基金组合未来将根据行业景气度以及公司竞争力的变化，在智能制造领域的内部做微调，逐步降低交易换手率，减少交易环节对净值的影响。下半年基金整体将保持中性偏高的仓位。下半年的风险可能会在四季度出现，主要包括海外流动性边际收紧、新冠疫情的反复、中美关系出现超预期的恶化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基

金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	60,093,340.84	69,219,372.93
结算备付金		1,567,103.48	2,436,851.99
存出保证金		309,711.56	367,677.23
交易性金融资产	6.4.7.2	863,081,925.93	936,956,896.95
其中：股票投资		863,081,925.93	936,956,896.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		15,026,721.45	6,453,456.69
应收利息	6.4.7.5	6,551.85	8,897.98
应收股利		-	-
应收申购款		448,055.35	804,890.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>940,533,410.46</b>	<b>1,016,248,044.31</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,515,532.40	2,477,257.62
应付赎回款		3,438,892.93	4,665,460.55
应付管理人报酬		1,063,388.01	1,205,044.83
应付托管费		177,231.35	200,840.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,086,122.23	1,493,046.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		279,108.68	279,108.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	162,461.80	249,594.08
<b>负债合计</b>		<b>19,722,737.40</b>	<b>10,570,353.48</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	171,914,103.55	203,414,878.79



未分配利润	6.4.7.10	748,896,569.51	802,262,812.04
<b>所有者权益合计</b>		<b>920,810,673.06</b>	<b>1,005,677,690.83</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>940,533,410.46</b>	<b>1,016,248,044.31</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.486 元，基金份额总额 205,241,020.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>85,715,989.77</b>	<b>332,094,061.86</b>
1.利息收入		155,867.02	471,388.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	155,867.02	254,252.44
债券利息收入		-	217,136.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		105,212,907.77	237,857,053.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	100,846,224.45	232,001,827.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	100,059.21
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,366,683.32	5,755,166.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-20,023,287.10	92,764,232.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	370,502.08	1,001,387.55
<b>减：二、费用</b>		<b>12,676,009.41</b>	<b>16,360,680.17</b>
1. 管理人报酬		6,558,325.14	8,116,346.82
2. 托管费		1,093,054.24	1,352,724.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,859,958.98	6,723,360.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	0.07
7. 其他费用	6.4.7.19	164,671.05	168,248.77

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>73,039,980.36</b>	<b>315,733,381.69</b>
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>73,039,980.36</b>	<b>315,733,381.69</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	203,414,878.79	802,262,812.04	1,005,677,690.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	73,039,980.36	73,039,980.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-31,500,775.24	-126,406,222.89	-157,906,998.13
其中：1.基金申购款	25,355,081.88	98,319,097.39	123,674,179.27
2.基金赎回款	-56,855,857.12	-224,725,320.28	-281,581,177.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	171,914,103.55	748,896,569.51	920,810,673.06
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	400,030,021.20	746,500,022.32	1,146,530,043.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	315,733,381.69	315,733,381.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-115,866,538.48	-264,807,783.39	-380,674,321.87
其中：1.基金申购款	103,523,879.79	238,736,824.89	342,260,704.68
2.基金赎回款	-219,390,418.27	-503,544,608.28	-722,935,026.55
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	284,163,482.72	797,425,620.62	1,081,589,103.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)是根据原金盛证券投资基金(以下简称“基金金盛”)基金份额持有人大会 2009 年 8 月 20 日决议通过的《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009] 925 号《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》，由原金盛证券投资基金转型而来。原基金金盛为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限至 2009 年 11 月 30 日止。根据深交所深证复[2009] 35 号《关于同意金盛证券投资基金终止上市的批复》，原基金金盛于 2009 年 10 月 16 日进行终止上市权利登记。自 2009 年 10 月 19 日起，原基金金盛终止上市，原基金金盛更名为国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)，《金盛证券投资基金基金合同》失效的同时《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金金盛于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 549,926,313.74 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《关于原金盛证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2009 年 11 月 23 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 1.193840063，并于 2009 年 11 月 24 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 18 日期间内开放集中申购，共募集 4,514,369,288.09 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 1,379,695.40 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 252 号审验报告予以验证。上述集中申购

募集资金已按 2009 年 11 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 4,514,369,288.09 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 1,379,695.40 份基金份额，并于 2009 年 11 月 24 日进行了确认登记。

经深交所深证上字[2009]第 204 号文审核同意，本基金 825,721,408.00 份基金份额于 2011 年 1 月 7 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)自 2015 年 8 月 8 日起更名为国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有高成长性和良好基本面的中小盘成长股票。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数 X 35% + 天相小盘成长指数 X 45% + 中证全债指数 X 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监

会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	60,093,340.84
定期存款	-
其他存款	-
合计	60,093,340.84

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	676,883,840.72	863,081,925.93	186,198,085.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券   交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		676,883,840.72	863,081,925.93	186,198,085.21

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	5,706.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	705.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.22
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	139.40
合计	6,551.85

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,086,122.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,086,122.23

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,930.40
应付证券出借违约金	-
其他应付款	12,170.50
预提费用	137,360.90
合计	162,461.80

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	242,848,765.22	203,414,878.79
本期申购	30,270,399.08	25,355,081.88
本期赎回（以“-”号填列）	-67,878,143.37	-56,855,857.12
本期末	205,241,020.93	171,914,103.55

注：1、截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 25,008,164.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 180,232,856.93 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

2、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	737,581,993.77	64,680,818.27	802,262,812.04
本期利润	93,063,267.46	-20,023,287.10	73,039,980.36
本期基金份额交易产生的	-122,802,640.77	-3,603,582.12	-126,406,222.89



变动数			
其中：基金申购款	101,244,113.49	-2,925,016.10	98,319,097.39
基金赎回款	-224,046,754.26	-678,566.02	-224,725,320.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	707,842,620.46	41,053,949.05	748,896,569.51

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	133,848.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,105.31
其他	2,913.16
合计	155,867.02

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,747,821,425.90
减：卖出股票成本总额	1,646,975,201.45
买卖股票差价收入	100,846,224.45

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,366,683.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	4,366,683.32
----	--------------

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-20,023,287.10
——股票投资	-20,023,287.10
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-20,023,287.10

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	370,502.08
合计	370,502.08

注：本基金的赎回费率按持有时间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,859,958.98
银行间市场交易费用	-
合计	4,859,958.98

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	48,100.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上市费	29,752.78
上交所查询费	600.00
银行汇划费用	8,710.15
银行间账户维护费	18,000.00
合计	164,671.05

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

###### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,558,325.14	8,116,346.82
其中：支付销售机构的客户维护费	2,459,230.28	2,138,307.65

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率

计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,093,054.24	1,352,724.48

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	60,093,340.84	133,848.55	85,370,881.31	222,158.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688606	奥泰生物	2021-03-17	2021-09-27	新股锁定	133.67	139.31	2,703.00	361,310.01	376,554.93	-
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	新股锁定	18.98	27.98	5,354.00	101,618.92	149,804.92	-
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	新股锁定	25.91	55.53	2,332.00	60,422.12	129,495.96	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	新股锁定	63.70	65.00	1,428.00	90,963.60	92,820.00	-
688329	艾隆科技	2021-03-16	2021-09-29	新股锁定	16.81	50.04	1,846.00	31,031.26	92,373.84	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	新股锁定	19.11	32.62	2,789.00	53,297.79	90,977.18	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	47.33	251.96	334.00	15,808.22	84,154.64	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股锁定	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	新股锁定	18.42	58.40	1,040.00	19,156.80	60,736.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下中签	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	606.00	20,131.32	53,025.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	网下中签	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
30102	密封	2021-0	2021-0	网下	10.64	10.64	3,789.	40,314	40,314	-

0	科技	6-28	7-06	中签			00	.96	.96	
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	新股锁定	6.50	10.46	3,671.00	23,861.50	38,398.66	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股锁定	19.11	33.21	1,137.00	21,728.07	37,759.77	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	48.59	90.39	275.00	13,362.25	24,857.25	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股锁定	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
30095	英力	2021-0	2021-0	新股	12.85	25.80	371.00	4,767.	9,571.	-

6	股份	3-16	9-27	锁定				35	80	
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	网下中签	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股锁定	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股锁定	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
30094	冠中	2021-0	2021-0	新股	13.00	27.42	216.00	2,808.	5,922.	-

8	生态	6-04	8-25	锁定				00	72	
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
300948	冠中生态	2021-06-04	2021-08-25	送股	-	27.42	108.00	-	2,961.36	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

注：1.根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

2.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。



#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金”。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金

的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金及结算备付金等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	60,093,340.84	-	-	-	60,093,340.84
结算备付金	1,567,103.48	-	-	-	1,567,103.48
存出保证金	309,711.56	-	-	-	309,711.56
交易性金融资产	-	-	-	863,081,925.93	863,081,925.93
应收证券清算款	-	-	-	15,026,721.45	15,026,721.45
应收利息	-	-	-	6,551.85	6,551.85
应收申购款	1,099.79	-	-	446,955.56	448,055.35
资产总计	61,971,255.67	-	-	878,562,154.79	940,533,410.46
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,515,532.40	13,515,532.40
应付赎回款	-	-	-	3,438,892.93	3,438,892.93
应付管理人报酬	-	-	-	1,063,388.01	1,063,388.01
应付托管费	-	-	-	177,231.35	177,231.35
应付交易费用	-	-	-	1,086,122.23	1,086,122.23
应付利润	-	-	-	279,108.68	279,108.68
其他负债	-	-	-	162,461.80	162,461.80
负债总计	-	-	-	19,722,737.40	19,722,737.40
利率敏感度缺口	61,971,255.67	-	-	858,839,417.39	920,810,673.06
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	69,219,372.93	-	-	-	69,219,372.93
结算备付金	2,436,851.99	-	-	-	2,436,851.99
存出保证金	367,677.23	-	-	-	367,677.23
交易性金融资产	-	-	-	936,956,896.95	936,956,896.95

应收证券清算款	-	-	-	6,453,456.69	6,453,456.69
应收利息	-	-	-	8,897.98	8,897.98
应收申购款	1,931.40	-	-	802,959.14	804,890.54
资产总计	72,025,833.55	-	-	944,222,210.76	1,016,248,044.31
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,477,257.62	2,477,257.62
应付赎回款	-	-	-	4,665,460.55	4,665,460.55
应付管理人报酬	-	-	-	1,205,044.83	1,205,044.83
应付托管费	-	-	-	200,840.81	200,840.81
应付交易费用	-	-	-	1,493,046.91	1,493,046.91
应交利润	-	-	-	279,108.68	279,108.68
其他负债	-	-	-	249,594.08	249,594.08
负债总计	-	-	-	10,570,353.48	10,570,353.48
利率敏感度缺口	72,025,833.55	-	-	933,651,857.28	1,005,677,690.83

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2020 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有高成长性和良好基本面的中小盘成长股票。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	863,081,925.93	93.73	936,956,896.95	93.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	863,081,925.93	93.73	936,956,896.95	93.17

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基准指数外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	45%天相中盘+55%天相 小盘上升 5%	增加约 5,975	增加约 5,269
	45%天相中盘+55%天相 小盘下降 5%	减少约 5,975	减少约 5,269

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 861,009,607.70 元，属于第二层次的余额为 2,072,318.23 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 925,772,807.99 元，第二层次 11,184,088.96 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	863,081,925.93	91.77
	其中：股票	863,081,925.93	91.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	61,660,444.32	6.56
8	其他各项资产	15,791,040.21	1.68



9	合计	940,533,410.46	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 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	153,213.98	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	528,182,375.51	57.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	184,996.72	0.02
F	批发和零售业	614,968.06	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	284,543.10	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	236,300,301.44	25.66
J	金融业	1,631,805.90	0.18
K	房地产业	39,692.10	0.00
L	租赁和商务服务业	25,314,335.30	2.75
M	科学研究和技术服务业	44,173,797.40	4.80
N	水利、环境和公共设施管理业	25,928,694.23	2.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	260,181.80	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	863,081,925.93	93.73

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600845	宝信软件	1,637,952	83,371,756.80	9.05
2	002415	海康威视	1,188,755	76,674,697.50	8.33
3	688188	柏楚电子	171,505	74,776,180.00	8.12

4	603659	璞泰来	417,677	57,054,678.20	6.20
5	300661	圣邦股份	203,511	51,433,335.03	5.59
6	688200	华峰测控	79,587	37,670,914.71	4.09
7	300911	亿田智能	542,209	37,564,239.52	4.08
8	688099	晶晨股份	330,651	37,099,042.20	4.03
9	603588	高能环境	1,761,638	25,508,518.24	2.77
10	601888	中国中免	84,353	25,314,335.30	2.75
11	300327	中颖电子	274,600	23,404,158.00	2.54
12	603259	药明康德	148,040	23,181,583.60	2.52
13	300458	全志科技	243,200	21,318,912.00	2.32
14	002459	晶澳科技	427,310	20,938,190.00	2.27
15	300759	康龙化成	95,100	20,635,749.00	2.24
16	300496	中科创达	129,000	20,260,740.00	2.20
17	300653	正海生物	243,507	19,066,598.10	2.07
18	688169	石头科技	14,671	18,500,131.00	2.01
19	300035	中科电气	743,600	18,181,020.00	1.97
20	300077	国民技术	1,132,000	18,089,360.00	1.96
21	002409	雅克科技	222,600	18,030,600.00	1.96
22	688208	道通科技	207,152	18,020,152.48	1.96
23	688083	中望软件	32,574	17,990,620.20	1.95
24	300363	博腾股份	210,925	17,743,011.00	1.93
25	600563	法拉电子	61,200	9,691,632.00	1.05
26	603893	瑞芯微	66,900	9,329,874.00	1.01
27	300750	宁德时代	17,400	9,305,520.00	1.01
28	603290	斯达半导	28,800	9,216,000.00	1.00
29	688037	芯源微	60,441	9,005,709.00	0.98
30	300037	新宙邦	88,700	8,878,870.00	0.96
31	300638	广和通	109,867	5,130,788.90	0.56
32	688139	海尔生物	43,302	4,551,040.20	0.49
33	600570	恒生电子	23,923	2,230,819.75	0.24
34	601995	中金公司	24,951	1,534,486.50	0.17
35	688390	固德威	2,585	863,390.00	0.09
36	600702	舍得酒业	2,400	513,072.00	0.06
37	300760	迈瑞医疗	1,000	480,050.00	0.05
38	002236	大华股份	22,120	466,732.00	0.05
39	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.04
40	002916	深南电路	3,475	386,176.75	0.04
41	688606	奥泰生物	2,703	376,554.93	0.04
42	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.04
43	300896	爱美客	452	356,573.76	0.04
44	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.04
45	300981	中红医疗	2,744	303,508.59	0.03
46	002352	顺丰控股	4,203	284,543.10	0.03
47	300347	泰格医药	1,346	260,181.80	0.03

48	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.03
49	688202	美迪西	432	224,596.80	0.02
50	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.02
51	300941	创识科技	3,989	204,452.06	0.02
52	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.02
53	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.02
54	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
55	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.02
56	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
57	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.02
58	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.02
59	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.01
60	300937	药易购	2,434	133,599.04	0.01
61	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
62	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.01
63	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01
64	300942	易瑞生物	4,428	131,028.71	0.01
65	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
66	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.01
67	300933	中辰股份	11,117	117,462.18	0.01
68	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
69	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.01
70	300918	南山智尚	10,626	110,616.66	0.01
71	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.01
72	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.01
73	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
74	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.01
75	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.01
76	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.01
77	300948	冠中生态	3,230	92,896.54	0.01
78	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
79	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.01
80	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.01
81	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
82	300931	通用电梯	6,713	89,880.14	0.01
83	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.01
84	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.01
85	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.01
86	300957	贝泰妮	334	84,154.64	0.01
87	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
88	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
89	300930	屹通新材	3,220	80,013.78	0.01
90	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
91	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.01

92	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
93	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
94	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
95	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
96	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.01
97	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
98	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
99	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
100	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
101	000858	五粮液	185	55,109.65	0.01
102	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.01
103	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
104	300979	华利集团	606	53,025.00	0.01
105	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
106	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.01
107	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
108	600031	三一重工	1,626	47,267.82	0.01
109	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
110	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
111	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
112	300917	特发服务	1,435	39,692.10	0.00
113	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
114	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
115	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
116	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
117	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
118	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
119	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
120	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
121	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
122	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
123	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
124	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
125	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
126	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
127	300922	天秦装备	363	12,643.29	0.00
128	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
129	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
130	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
131	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
132	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
133	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
134	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
135	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00

136	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
137	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
138	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
139	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
140	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	66,560,164.00	6.62
2	688188	柏楚电子	53,457,139.97	5.32
3	600089	特变电工	51,903,641.28	5.16
4	002607	中公教育	50,613,006.34	5.03
5	603659	璞泰来	48,636,867.78	4.84
6	300661	圣邦股份	48,231,464.51	4.80
7	002236	大华股份	43,031,790.83	4.28
8	300529	健帆生物	40,892,553.38	4.07
9	688200	华峰测控	36,363,073.82	3.62
10	300911	亿田智能	36,200,893.51	3.60
11	300613	富瀚微	35,737,438.40	3.55
12	688099	晶晨股份	35,446,009.73	3.52
13	601636	旗滨集团	34,514,417.00	3.43
14	603588	高能环境	34,090,443.24	3.39
15	300496	中科创达	31,728,287.00	3.15
16	002372	伟星新材	30,716,649.51	3.05
17	300726	宏达电子	30,610,991.97	3.04
18	688169	石头科技	29,907,239.45	2.97
19	603259	药明康德	22,039,643.24	2.19
20	002444	巨星科技	21,396,922.70	2.13
21	688686	奥普特	21,317,861.42	2.12
22	002791	坚朗五金	20,651,547.00	2.05

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	688169	石头科技	65,634,636.53	6.53
2	002507	涪陵榨菜	61,502,259.65	6.12
3	002607	中公教育	54,019,369.54	5.37
4	603915	国茂股份	53,086,827.00	5.28
5	600089	特变电工	50,577,236.78	5.03
6	300347	泰格医药	49,757,727.78	4.95
7	600305	恒顺醋业	46,295,427.56	4.60
8	600882	妙可蓝多	44,341,346.12	4.41
9	688002	睿创微纳	44,285,180.87	4.40
10	300274	阳光电源	43,509,571.11	4.33
11	002352	顺丰控股	43,447,606.88	4.32
12	600862	中航高科	42,405,732.75	4.22
13	300529	健帆生物	39,819,090.82	3.96
14	600161	天坛生物	39,233,284.58	3.90
15	601888	中国中免	38,639,229.37	3.84
16	601636	旗滨集团	38,620,423.86	3.84
17	002236	大华股份	38,494,661.27	3.83
18	688029	南微医学	35,591,547.28	3.54
19	300037	新宙邦	33,321,197.69	3.31
20	002372	伟星新材	31,131,250.65	3.10
21	603317	天味食品	31,003,686.91	3.08
22	300726	宏达电子	28,416,311.42	2.83
23	300896	爱美客	27,647,912.48	2.75
24	300613	富瀚微	27,510,399.34	2.74
25	688536	思瑞浦	25,366,479.79	2.52
26	688036	传音控股	25,022,361.53	2.49
27	688686	奥普特	21,934,342.87	2.18
28	600702	舍得酒业	21,500,428.00	2.14
29	300759	康龙化成	21,213,058.00	2.11

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,593,123,517.53
卖出股票的收入（成交）总额	1,747,821,425.90

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

**7.6 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。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 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。

**7.11 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。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“高能环境”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。

高能环境 2017 年收购甘肃中色 51% 股权，披露信息不完善，受到上交所监管关注。

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。

7.12.2 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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	309,711.56
2	应收证券清算款	15,026,721.45
3	应收股利	-

4	应收利息	6,551.85
5	应收申购款	448,055.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,791,040.21

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
37,902	5,415.04	805,619.50	0.39%	204,435,401.43	99.61%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	叶立华	1,184,700.00	5.25%
2	广州市科技进步基金会	730,000.00	3.23%
3	吴芳	537,406.00	2.38%



4	薛宜平	308,139.00	1.36%
5	汪云	295,139.00	1.31%
6	许泽荣	276,377.00	1.22%
7	诸翠兰	249,394.00	1.10%
8	杨文彬	223,100.00	0.99%
9	叶国宏	209,400.00	0.93%
10	黄城	200,000.00	0.89%

注：上述份额均为场内份额，持有人均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	46,652.28	0.02%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年10月19日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	242,848,765.22
本报告期基金总申购份额	30,270,399.08
减：本报告期基金总赎回份额	67,878,143.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	205,241,020.93

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 3 月 31 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过，张玮先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》，经本基金管理人股东会审议通过，对本基金管理人董事会成员进行了调整。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	660,175,032.71	19.82%	469,581.98	16.85%	-
方正证券	1	627,802,344.66	18.84%	459,112.84	16.48%	-
海通证券	2	592,032,393.67	17.77%	551,358.45	19.79%	-
申万宏源	2	558,891,944.31	16.78%	520,499.63	18.68%	-
银河证券	1	279,942,631.51	8.40%	260,709.97	9.36%	-
兴业证券	2	232,214,709.79	6.97%	216,261.84	7.76%	-
国泰君安	2	189,089,035.84	5.68%	172,314.64	6.18%	-
华鑫证券	1	116,048,608.79	3.48%	82,545.26	2.96%	-

招商证券	1	40,137,054.67	1.20%	28,549.69	1.02%	-
安信证券	1	35,175,679.60	1.06%	25,723.70	0.92%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
2	国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》	2021-04-01

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、关于同意国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)募集的批复
- 2、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同
- 3、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(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

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇二一年八月三十一日