

# 国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金

## 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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。

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       | 国泰中证环保产业 50ETF   |
| 场内简称       | 环保 ETF   |
| 基金主代码      | 159861   |
| 交易代码       | 159861   |
| 基金运作方式     | 交易型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2021 年 3 月 19 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 357,117,535.00 份   |
| 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 |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证环保产业 50 指数收益率   |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金, 其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金, 主要采用完全复制策略, 跟踪中证环保产业 50 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。</p>  |
| 基金管理人  | 国泰基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 中国民生银行股份有限公司  |

### § 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) |
| 1. 本期已实现收益      | -1,852,623.44                    |
| 2. 本期利润         | 87,957,611.67                    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2348                           |

|             |                |
|-------------|----------------|
| 4. 期末基金资产净值 | 559,192,167.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.5658         |

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

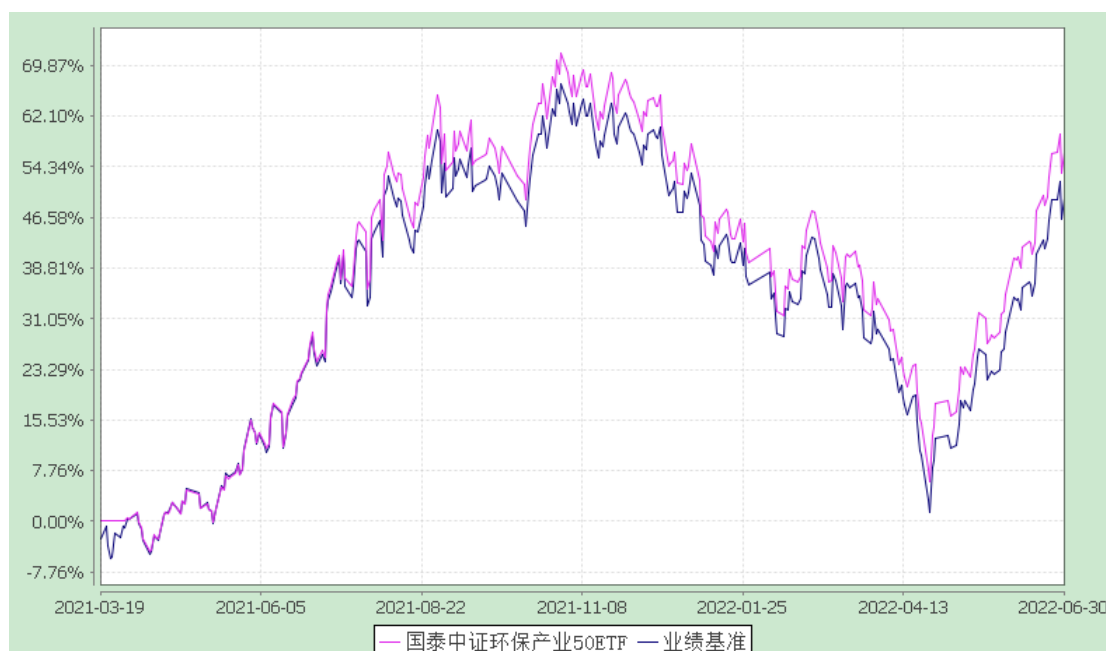
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 17.46% | 2.25%     | 16.15%     | 2.27%         | 1.31% | -0.02% |
| 过去六个月      | -0.78% | 2.15%     | -2.50%     | 2.15%         | 1.72% | 0.00%  |
| 过去一年       | 21.48% | 2.18%     | 16.66%     | 2.17%         | 4.82% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 56.58% | 2.05%     | 49.63%     | 2.09%         | 6.95% | -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

国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 3 月 19 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为2021年3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 |        |   |
| 王玉 | 国泰上证5年期国债ETF、上证10年期国债ETF、国泰金龙债券、国泰信用互利债券、国泰中 | 2021-03-19  | -    | 6年     | 硕士研究生。曾任职于光大银行上海分行。2016年1月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。2019年12月起任上证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，2020年3月起兼任国泰金龙债券证券投资基金和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 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | <p>债 1-3 年国开债、国泰中证细分化工产业主题 ETF、国泰中证环保产业 50ETF、国泰中证环保产业 50ETF 联接、国泰中证细分化工产业主题 ETF 联接、国泰中证光伏产业 ETF 发起联接、国泰中证影视主题 ETF、国泰中证新材料主题 ETF、国泰中证港股通 50ETF 发起联接、国泰中证新材料主题</p> |  |  |  | <p>基金转型而来) 的基金经理, 2020 年 4 月至 2021 年 7 月任国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2020 年 6 月至 2021 年 7 月任国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2020 年 8 月起兼任国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 8 月至 2021 年 8 月任国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金和国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2021 年 3 月起兼任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和国泰中证环保产业 50 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和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的基金经理, 2021 年 10 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发起式联接基金和国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2021 年 11 月起兼任国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月起兼任国泰中证港股通 50 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, 2022 年 2 月起兼任国泰中证新材料主题交易型</p> |
|--|---|--|--|--|--|

|  |               |  |  |  |                          |
|--|---------------|--|--|--|--------------------------|
|  | ETF 发起联接的基金经理 |  |  |  | 开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 |
|--|---------------|--|--|--|--------------------------|

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

2022 年二季度，权益市场受俄乌战争升级和上海疫情封锁等影响，四月经历了一轮较

为猛烈的急跌。五月开始，随着疫情防护工作企稳，市场在经历政策底和市场底之后，迎来了一波触底反弹行情，上证指数在大跌至 2863 点后，二季度收获了 4.5% 的涨幅。沪深 300 指数上涨 6.21%，以大盘蓝筹为代表的上证 50 指数二季度反弹 5.5%，而以科技成长为代表的创业板指数和科创 50 指数的涨幅分别为 5.68% 和 1.34%。

国内方面，二季度触底反弹的核心因素还是疫情防护工作企稳，在实现常态化核酸背景下，加快复工复产，市场经历一轮明显的消费修复和生产重启。与此同时，5 月中旬，央行下调 5 年 LPR，货币政策维持宽松态势，国常会等持续释放维稳信号，财政发力，稳增长措施也陆续落地。海外方面，随着美联储持续加息，打压市场通胀预期，美国通胀略有企稳，美债收益率下行至 3.0% 以下。

二季度，北上资金累计净流入超过 700 亿元，助力市场触底反弹。分行业来看，申万一级行业来看，表现最好的行业分别是汽车，食品饮料和电力设备行业。汽车消费政策的推出，新能源汽车补贴政策延续，疫后消费修复和能源需求复苏，推升了上述行业在二季度的靓丽表现。

作为跟踪标的指数的被动型基金，本基金紧密跟踪标的指数，在追求跟踪偏离度和跟踪误差的同时，也会精细化操作以更好的跟踪市场。

#### 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 17.46%，同期业绩比较基准收益率为 16.15%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，政策方面明显呈现“外紧内松”，随着疫后消费修复和生产重启，经济进入环比改善的加速阶段。常态化核酸下疫情得到有效控制，随着稳增长政策不断出台，市场预期震荡上行。在成本、疫情等不利因素影响下，新能源产业链依然展现了强大的韧性。下半年新能源产品技术迭代加快，海内外需求保持强劲，长期看好碳中和背景下新型电力体系的投资机会。

上半年国内双控政策纠偏，保供控价机制初见成效。由于国内煤炭电力供需持续偏紧，进一步推动电价的市场化改革的必要性更加突出。在碳中和背景下，加快落实分时电价，支持新型电力系统建设，服务能源绿色低碳转型，持续看好新能源板块及相关板块的长期增长空间。



#### 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              | 555,274,415.17 | 99.04        |
|    | 其中：股票             | 555,274,415.17 | 99.04        |
| 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      | 4,903,899.52   | 0.87         |
| 7  | 其他各项资产            | 453,660.93     | 0.08         |
| 8  | 合计                | 560,631,975.62 | 100.00       |

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）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19,222,108.00元，占基金资产净值比例为3.44%。

#### 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              | 1,332,303.44 | 0.24         |
| C  | 制造业              | 462,086.15   | 0.08         |
| 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  | 71,618.18    | 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    | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 200,729.54   | 0.04         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 194,633.62   | 0.03         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 2,313,079.86 | 0.41         |

### 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              | 462,929,126.24 | 82.79        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 82,581,451.07  | 14.77        |
| 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             | -              | -     |
| 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      | 1,737,360.00   | 0.31  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 5,713,398.00   | 1.02  |
| 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              | 552,961,335.31 | 98.89 |

### 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   | 57,460  | 30,683,640.00 | 5.49         |
| 2  | 002129 | TCL 中环 | 512,900 | 30,204,681.00 | 5.40         |
| 3  | 600438 | 通威股份   | 478,771 | 28,659,232.06 | 5.13         |
| 4  | 601012 | 隆基绿能   | 410,069 | 27,322,897.47 | 4.89         |
| 5  | 300014 | 亿纬锂能   | 273,581 | 26,674,147.50 | 4.77         |
| 6  | 002812 | 恩捷股份   | 102,693 | 25,719,461.85 | 4.60         |
| 7  | 300274 | 阳光电源   | 239,459 | 23,526,846.75 | 4.21         |
| 8  | 600900 | 长江电力   | 991,300 | 22,918,856.00 | 4.10         |
| 9  | 002709 | 天赐材料   | 307,580 | 19,088,414.80 | 3.41         |
| 10 | 300751 | 迈为股份   | 34,454  | 16,913,468.60 | 3.02         |

#### 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  | 600938 | 中国海油 | 84,004 | 1,332,303.44 | 0.24         |

|   |        |      |        |            |      |
|---|--------|------|--------|------------|------|
| 2 | 301175 | 中科环保 | 52,547 | 200,729.54 | 0.04 |
| 3 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,412  | 182,113.80 | 0.03 |
| 4 | 688400 | 凌云光  | 8,273  | 181,426.89 | 0.03 |
| 5 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,204  | 38,612.28  | 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   | 67,431.72  |
| 2  | 应收证券清算款 | 381,719.75 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | 4,509.46   |
| 9  | 合计      | 453,660.93 |

### 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 报告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  | 002709 | 天赐材料 | 3,971,840.00   | 0.71         | 转融通证券出借业务的股票 |
| 2  | 002812 | 恩捷股份 | 3,055,490.00   | 0.55         | 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  | 600938 | 中国海油 | 1,332,303.44   | 0.24         | 新股锁定     |
| 2  | 301175 | 中科环保 | 200,729.54     | 0.04         | 网下中签     |
| 3  | 688400 | 凌云光  | 181,426.89     | 0.03         | 网下中签     |
| 4  | 301239 | 普瑞眼科 | 163,875.50     | 0.03         | 网下中签     |

|   |        |      |           |      |      |
|---|--------|------|-----------|------|------|
| 5 | 301238 | 瑞泰新材 | 38,612.28 | 0.01 | 新股锁定 |
| 6 | 301239 | 普瑞眼科 | 18,238.30 | 0.00 | 新股锁定 |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |                |
|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 358,117,535.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 55,000,000.00  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 56,000,000.00  |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期末基金份额总额    | 357,117,535.00 |

## § 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         | 48,999,952.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             |
| 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         | 48,999,952.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 13.72         |

### 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 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |        |        |          | 报告期末持有基金情况  |        |
|-------|----------------|------------------------|--------|--------|----------|-------------|--------|
|       | 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   |
| 国泰中   | 1              | 2022年04月01             | 196,28 | 19,000 | 17,250,6 | 198,031,578 | 55.45% |

|  |  |                        |               |               |        |      |  |
|--|--|------------------------|---------------|---------------|--------|------|--|
| 证 环 保<br>产 业 50<br>交 易 型<br>开 放 式<br>指 数 证<br>券 投 资<br>基 金 发<br>起 式 联<br>接 基 金 |  | 日至 2022 年 06 月<br>30 日 | 2, 200.<br>00 | , 000. 0<br>0 | 22. 00 | . 00 |  |
| 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、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数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  
二〇二二年七月二十一日