

国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

2023 年第 2 季度报告

2023 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：二〇二三年七月二十一日

§ 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 2023 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 2023 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 | 185,642,257.82 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 | 159,103,881.82 份 | 26,538,376.00 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 (2023年4月1日-2023年6月30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 | 1,592,281.33 |
| 2.本期利润 | -12,614,253.98 | -974,779.07 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0846 | -0.0658 |
| 4.期末基金资产净值 | 188,509,593.08 | 31,399,393.98 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1848 | 1.1832 |

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 | -6.93% | 1.07% | -7.30% | 1.06% | 0.37% | 0.01% |
| 过去六个月 | -3.04% | 1.04% | -5.30% | 1.03% | 2.26% | 0.01% |
| 过去一年 | -16.42% | 1.22% | -20.16% | 1.23% | 3.74% | -0.01% |
| 过去三年 | 3.19% | 1.57% | -8.21% | 1.61% | 11.40% | -0.04% |
| 过去五年 | 55.96% | 1.61% | 36.96% | 1.64% | 19.00% | -0.03% |
| 自基金合同 生效起至今 | 18.48% | 1.53% | 4.36% | 1.55% | 14.12% | -0.02% |

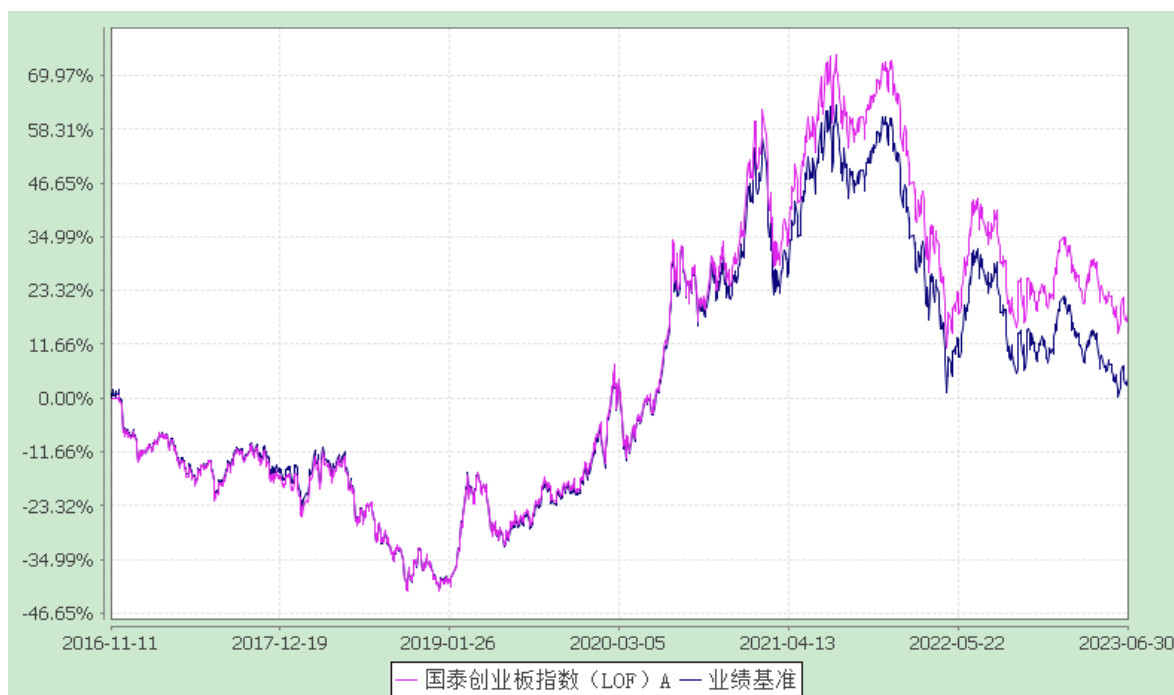
2、国泰创业板指数（LOF）C：

| 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 | -6.97% | 1.07% | -7.30% | 1.06% | 0.33% | 0.01% |
| 过去六个月 | -3.13% | 1.04% | -5.30% | 1.03% | 2.17% | 0.01% |
| 过去一年 | -16.56% | 1.22% | -20.16% | 1.23% | 3.60% | -0.01% |
| 自新增 C 类 份额起至今 | -3.78% | 1.27% | -7.84% | 1.29% | 4.06% | -0.02% |

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

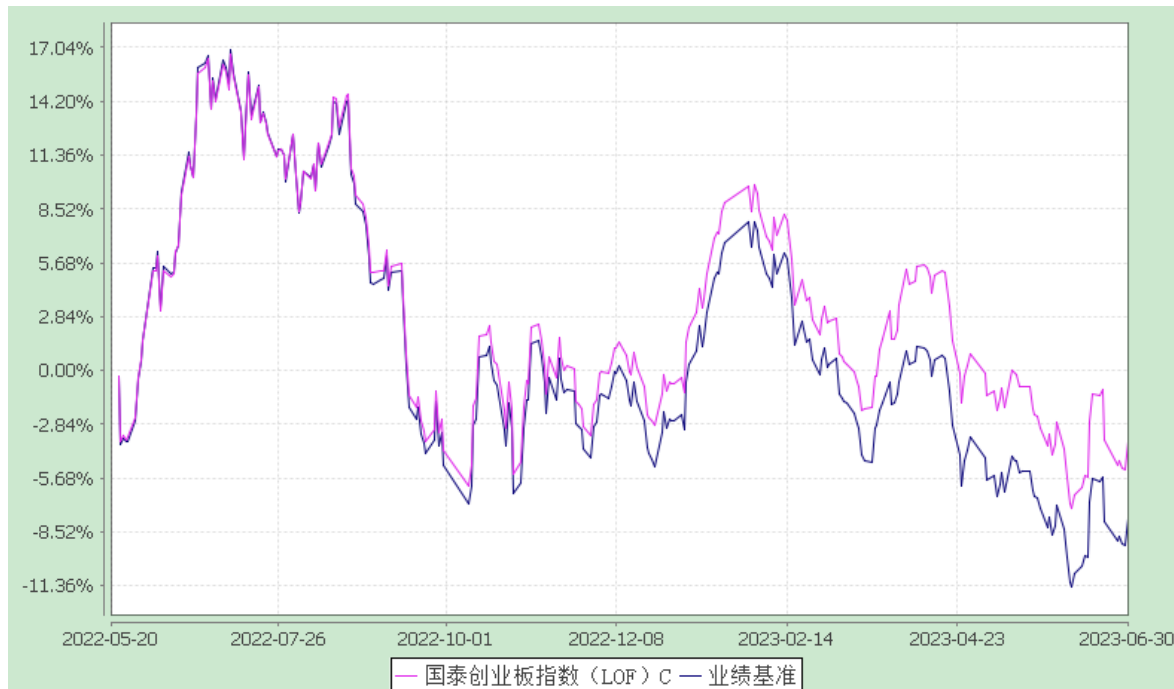
国泰创业板指数证券投资基金（LOF）
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2016 年 11 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日)

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 | | |
| 徐成城 | 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 | 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月至2023年5月任纳斯达克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药交易型开放 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月至 2023 年 5 月任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭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 月至 2023 年 5 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的基金经理，2020 年 3 月至 2023 年 5 月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 月至 2023 年 4 月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 月至 2023 年 5 月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 月至 2023 年 5 月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</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 6 月至 2023 年 6 月任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至 2023 年 5 月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 月至 2023 年 5 月任国泰中证 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 月至 2023 年 4 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 4 月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 月至 2023 年 5 月任国泰标普 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> |
| 吴中昊 | <p>国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、</p> | 2023-06-14 | - | 8 年 | <p>硕士研究生。曾任职于 Arrowstreet Capital(美国)。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深 300 指数证券</p> |

| | | | | |
|--|---|--|--|---|
| | <p>国泰沪深 300 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰中证 1000 增强策略 ETF、国泰</p> | | | <p>投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 2 月起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> |
|--|---|--|--|---|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 中证 钢铁 ETF、 国泰 中证 煤炭 ETF、 国泰 创业 板指 数 (LOF)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

今年上半年 A 股市场波动较大，虽然“数字经济”和“中特估”概念持续表现强势，但在经济复苏预期摇摆和海外风险的扰动下，行业轮动较快，赚钱效应并不显著。二季度以来，国内经济延续了弱势：5 月的出口数据不及预期，出口金额同比下降 7.5%；CPI 和 PPI 同比继续走低；30 个大中城市商品房的销售面积也降至去年同期水平。尽管在政策托底下，经济进一步下行的可能性较低，但短期将处于筑底阶段，市场仍持续关注即将发布的经济数据和全球货币政策的最新变化。因此，当前 A 股的表现也在一定程度上反映了经济复苏的疲态：在 5 月份“数字经济”和“中特估”主题开始调整后，缺乏主线驱动的上证指数至 3200 点附近开始向下震荡整理。

回顾近期的 A 股行情，部分行业尤其是银行、地产、家电等板块确实在二季度出现了一定的指数反弹。而对这些行业做进一步分析的话，我们不难发现它们大多有如下特性：第一，估值处于历史分位数低点，且交易不太拥挤；第二，今年以来的跌幅比较多，部分行业今年以来的最大跌幅已经超过 20%；第三，在政策或者需求的利好下，短期盈利有望改善。而近期 A 股演绎“市场越跌越买”这一趋势的核心逻辑，依然是资金在不确定的市场环境中寻求“低估值”+“业绩改善”这一类安全资产的避险驱动。

作为完全跟踪标的指数的被动型基金，本基金避免了不必要的主动操作，减

少了交易冲击成本，并通过精细化管理和权重优化，在确保基金跟踪误差较小的情况下，上半年获得了一定的超额收益。

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-6.93%，同期业绩比较基准收益率为-7.30%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-6.97%，同期业绩比较基准收益率为-7.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，市场会再度进入国内和海外的政策博弈期：一方面，国内稳增长政策的政策思路仍然是“以时间换空间”，MLF 降息、发放消费券和特别国债等政策有望陆续推出，但整体目标仍然以延后风险、托底信心为主，以保证“高质量发展”的政策主线。政策约束下的国内经济或将延续缓慢复苏特征，流动性环境仍相对宽裕；另一方面，海外欧美衰退预期反复，通胀持续回落，尽管 7 月美联储加息概率依然较高，但加息终点的临近已经确认无疑，全球估值约束有望在今年下半年持续缓解。在此基础上，若海外重新开启衰退宽松交易，美元利率的回落叠加中美外交释放利好，国内市场风险或有望进一步回升。

中长期来看，尽管经济复苏乏力和中美贸易摩擦等因素对新兴成长企业的发展产生了负面影响，但同时高端制造和国产替代的需求也刺激了政府和企业加大对关键技术和设备国产替代的决心，我国开展制造强国的战略将在十四五规划下继续稳步推进。新能源、新材料和人工智能等战略性新兴产业的发展壮大离不开创业板的企业，政策和市场的倾斜将使得创业板未来具有更大的发展潜力，以创业板指数为代表的创业板优质公司将在国家政策和市场资金的培育和支持下，引领创新科技产业方向。投资者或可利用国泰创业板指数（LOF）基金，积极把握创业板指数阶段性的投资机会。

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 | 206,218,854.58 | 91.77 |
| | 其中：股票 | 206,218,854.58 | 91.77 |
| 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 | 17,728,748.47 | 7.89 |
| 7 | 其他各项资产 | 756,829.83 | 0.34 |
| 8 | 合计 | 224,704,432.88 | 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境内股票投资组合

| 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 | 197,240.33 | 0.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47 | 0.02 |
| 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 | 15,663.82 | 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,887.20 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 12,855.60 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 265,094.42 | 0.12 |

5.2.2 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 6,372,771.50 | 2.90 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 158,495,942.07 | 72.07 |
| 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 | 10,470,750.32 | 4.76 |
| J | 金融业 | 14,578,259.60 | 6.63 |
| 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 | 6,363,624.82 | 2.89 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 622,976.72 | 0.28 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,741,583.12 | 2.61 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,307,852.01 | 1.50 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 205,953,760.16 | 93.65 |

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 | 178,144 | 40,757,565.76 | 18.53 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 812,375 | 11,535,725.00 | 5.25 |
| 3 | 300124 | 汇川技术 | 175,463 | 11,266,479.23 | 5.12 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 31,904 | 9,564,819.20 | 4.35 |
| 5 | 300274 | 阳光电源 | 65,329 | 7,619,321.27 | 3.46 |
| 6 | 300498 | 温氏股份 | 347,290 | 6,372,771.50 | 2.90 |
| 7 | 300308 | 中际旭创 | 39,357 | 5,803,189.65 | 2.64 |
| 8 | 300015 | 爱尔眼科 | 267,283 | 4,958,099.65 | 2.25 |
| 9 | 300014 | 亿纬锂能 | 81,506 | 4,931,113.00 | 2.24 |
| 10 | 300122 | 智飞生物 | 71,935 | 3,179,527.00 | 1.45 |

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 | 301488 | 豪恩汽电 | 1,533 | 60,982.74 | 0.03 |
| 2 | 301261 | 恒工精密 | 1,409 | 51,992.10 | 0.02 |
| 3 | 301202 | 朗威股份 | 1,703 | 43,971.46 | 0.02 |
| 4 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.02 |
| 5 | 301293 | 三博脑科 | 180 | 12,855.60 | 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 | 19,281.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 737,548.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 756,829.83 |

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 | 301488 | 豪恩汽电 | 54,856.62 | 0.02 | 网下中签 |
| 2 | 301261 | 恒工精密 | 51,992.10 | 0.02 | 网下中签 |
| 3 | 301202 | 朗威股份 | 43,971.46 | 0.02 | 网下中签 |
| 4 | 001286 | 陕西能源 | 35,447.47 | 0.02 | 新股锁定 |
| 5 | 301293 | 三博脑科 | 12,855.60 | 0.01 | 新股锁定 |
| 6 | 301488 | 豪恩汽电 | 6,126.12 | 0.00 | 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 | 141,118,416.73 | 9,099,745.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 37,038,367.76 | 37,263,729.50 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 19,052,902.67 | 19,825,099.35 |
| 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 | 159,103,881.82 | 26,538,376.00 |

§ 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 | 80,547.72 |
| 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 | 80,547.72 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.04 |

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 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

二〇二三年七月二十一日