

国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）

2026年第1季度报告

2026年3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：二〇二六年四月二十二日

§ 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 2026 年 04 月 20 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰国证航天军工指数（LOF）
场内简称	军工基金 LOF
基金主代码	501019
交易代码	501019
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 日
报告期末基金份额总额	1,297,103,697.52 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；6、融资与转融通证券

	出借投资策略。	
业绩比较基准	国证航天军工指数收益率×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	国泰国证航天军工指数（LOF）A	国泰国证航天军工指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	501019	015599
报告期末下属分级基金的份额总额	572, 214, 644. 55 份	724, 889, 052. 97 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 (2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日)	
	国泰国证航天军工指数 (LOF) A	国泰国证航天军工指数 (LOF) C
	1.本期已实现收益	16,607,966.62
2.本期利润	-56,903,332.92	-129,460,995.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1043	-0.2168
4.期末基金资产净值	771,159,462.38	969,622,417.24
5.期末基金份额净值	1.3477	1.3376

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、国泰国证航天军工指数（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	-5.54%	2.19%	-5.54%	2.28%	0.00%	-0.09%
过去六个月	-0.37%	1.75%	-1.16%	1.80%	0.79%	-0.05%
过去一年	18.24%	1.66%	16.80%	1.70%	1.44%	-0.04%
过去三年	9.95%	1.62%	7.05%	1.65%	2.90%	-0.03%
过去五年	18.91%	1.62%	11.63%	1.66%	7.28%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	34.77%	1.67%	1.89%	1.70%	32.88%	-0.03%

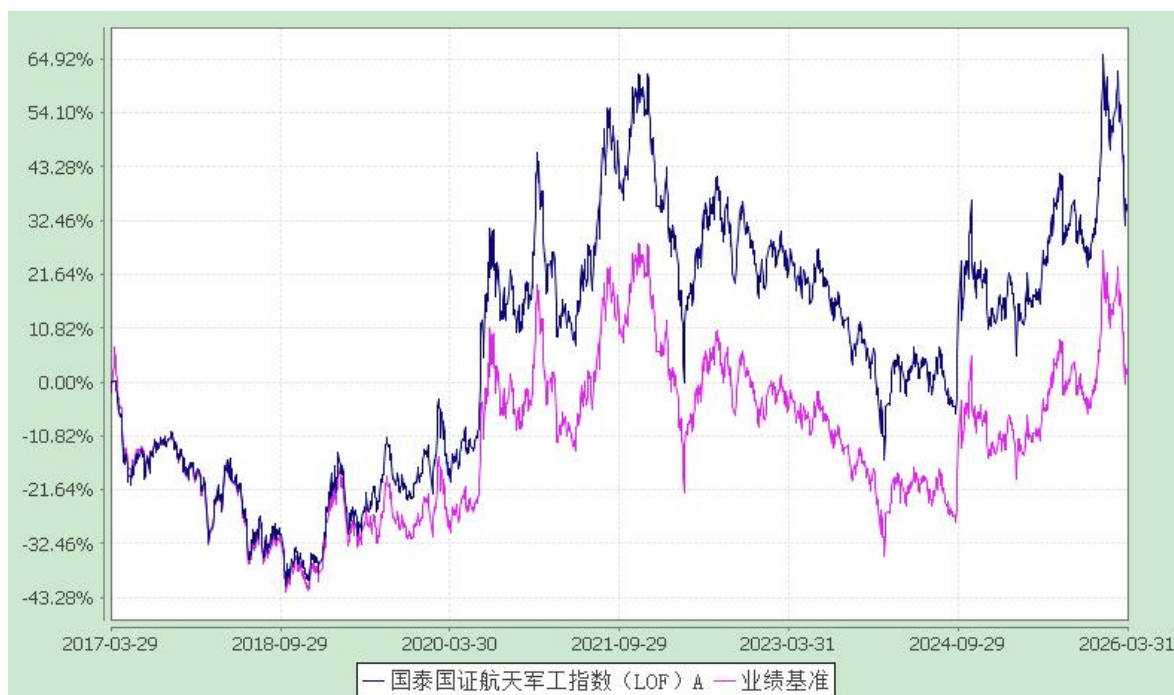
2、国泰国证航天军工指数（LOF）C：

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	-5.60%	2.19%	-5.54%	2.28%	-0.06%	-0.09%
过去六个月	-0.47%	1.75%	-1.16%	1.80%	0.69%	-0.05%
过去一年	18.01%	1.66%	16.80%	1.70%	1.21%	-0.04%
过去三年	9.30%	1.62%	7.05%	1.65%	2.25%	-0.03%
自新增C类 份额起至今	11.69%	1.57%	8.89%	1.60%	2.80%	-0.03%

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

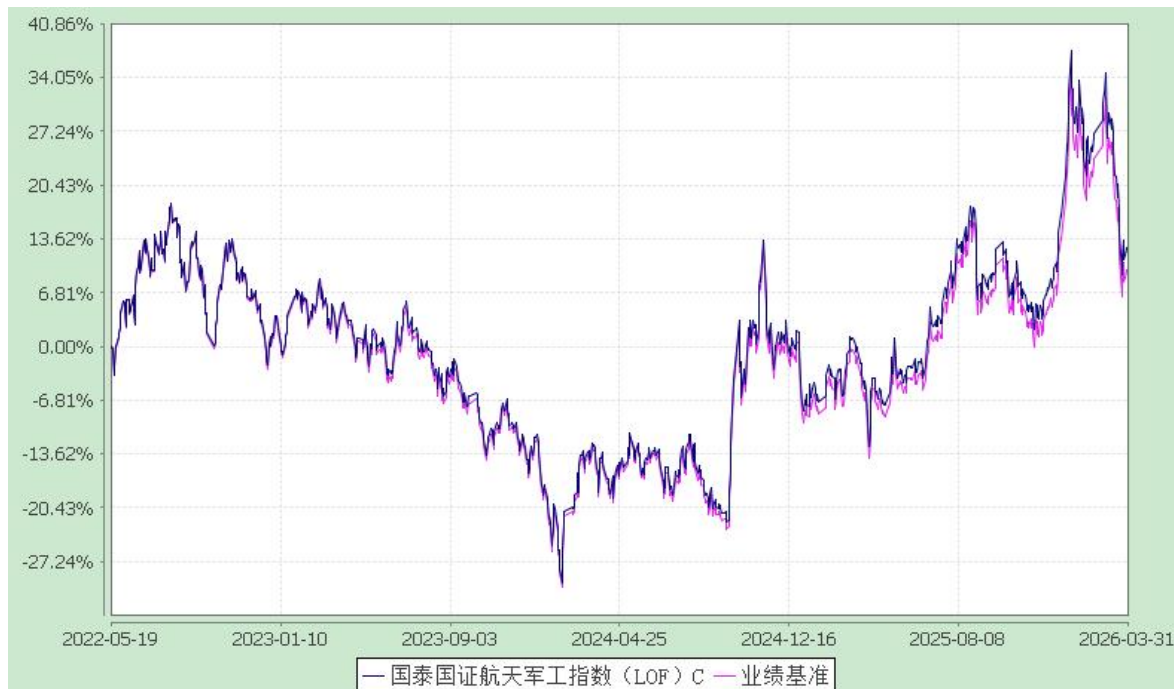
国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年3月29日至2026年3月31日)

1. 国泰国证航天军工指数（LOF）A：



注：本基金的合同生效日为 2017 年 3 月 29 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。

2. 国泰国证航天军工指数（LOF）C:



注：本基金的合同生效日为 2017 年 3 月 29 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。自 2022 年 5 月 19 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。自 2022 年 5 月 23 日起，C 类基金份额净值和基金份额累计净值开始计算。

§ 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		
艾小军	国泰黄金ETF联接、国泰上证180金融ETF联接、国泰上证180金融ETF、国泰中证计算机主题ETF联接、国泰黄金ETF、国泰中证军工ETF、国泰中证全指证券公司ETF、国泰国证	2017-03-29	-	25年	硕士。2001年5月至2006年9月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006年9月至2007年8月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007年9月至2007年10月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007年10月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014年1月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理，2015年3月至2020年12月任国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的基金经理，2015年4月至2021年1月任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理，2016年4月起兼任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，2016年7月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017年3月至2017年5月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017年3月至2018年12月任国泰策略收益灵活配置混合型证

	<p>航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、芯片 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接、国泰中证全指证券公司 ETF 联接、国泰纳斯达克 100</p>			<p>券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月至 2023 年 9 月任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）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 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，2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 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，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任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）的基金经理，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 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变更而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 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）的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰 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</p>
--	---	--	--	---

	(QDI I-ETF)、国泰标普 500ETF、国泰中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监			CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)的基金经理, 2019 年 7 月至 2021 年 1 月任上证 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, 2019 年 7 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 9 月起兼任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的基金经理, 2020 年 12 月起兼任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)的基金经理, 2021 年 5 月起兼任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的基金经理, 2023 年 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理, 2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。
--	---	--	--	---

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法律法规及行业协会的相关规定。

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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 5 次，为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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

2026 年第一季度，资本市场在地缘政治与全球宏观周期的交织中演进。从海外环境来看，地缘冲突致使市场不确定性增强，全球主要经济体的政策博弈成为扰动全球风险偏好的核心因素。国内方面，宏观经济在稳增长政策的持续护航

下，呈现出温和复苏、稳中有进的积极态势，经济增长韧性持续加强。

A 股市场在 2026 年第一季度展现出较强的结构性分化与内在韧性，市场流动性保持合理充裕，资金更加聚焦于具备明确产业趋势、业绩支撑以及国家战略导向的核心领域。从行业表现来看，受益于全球宏观定价逻辑的资源品板块是本赛季市场的核心驱动力。而“新质生产力”代表的科技前沿与高端制造板块，则在产业趋势的推动下稳中有进。

科技方面，虽然成长板块存在相对强烈的估值压制，但产业层面的进程并未减速。底层大模型的能力边界不断拓宽，AI 模型端多模态方向更加清晰，并带动了 AI 产业链中，计算芯片、光模块、存储甚至电力等细分领域的阶段性行情。

但是，随着 AI 估值的不断抬升，市场开始担忧估值泡沫，并对 AI 未来浪潮的发展可持续性趋于谨慎。由于北美云巨头资本开支大幅超出预期，虽然业绩超预期，但科技板块并未展示出一如既往的强势，甚至因 AI 忧虑引致 HALO (Heavy Assets, Low Obsolescence, 重资产, 低淘汰) 交易走红，市场交易结构性分化。资源方面，在地缘政治冲突、全球流动性环境变动等催化下，石油、黄金、新能源等板块表现活跃。3 月份，中东美伊冲突扰动全球风险偏好，市场风格剧烈变化，资源板块波动幅度加大。

整体看，2026 年一季度权益市场震荡收跌；截至 3 月 31 日收盘，上证综指一季度累计下跌 1.94%，创业板指一季度跌 0.57%，科创 50 指数一季度跌 6.54%。行业表现方面，周期资源品表现突出，煤炭、石油石化领涨，非银金融、商贸零售、家电、计算机回调较多。

作为被动指数基金的基金经理，我们的工作重点在于紧密跟踪标的指数，力求实现与指数表现相匹配的投资回报。在 2026 年一季度，我们的基金严格按照既定的投资策略，依据标的指数的成分股及其权重构建投资组合，以最小化跟踪误差。

在实际操作中，我们对指数的成分股变化保持密切关注，及时进行相应的调整，确保基金持仓与指数成分的一致性。同时，利用量化分析和风险评估模型，对投资组合进行动态监控，以控制跟踪误差在合理范围内。尽管面临市场的大幅波动和成分股的调整，基金整体较好地实现了对标的指数的跟踪，在多数时间段内，净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年跟踪误差均控制在较

低水平。

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-5.54%，同期业绩比较基准收益率为-5.54%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-5.60%，同期业绩比较基准收益率为-5.54%。

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 2026 年，我们对中国宏观经济的长期向好趋势保持充分信心。在财政政策精准发力、货币政策稳健偏宽的协同配合下，内需潜力或被进一步激发。中国经济正处于新旧动能转换的关键期，传统产业的转型升级与新兴产业的蓬勃发展将共同构筑中国经济高质量发展的坚实底座。宏观基本面的企稳回升与市场微观流动性的改善或将为权益资产提供有力的底层支撑。在投资主线上，“硬科技与新质生产力”、“资源与安全”两大战略方向值得关注。

当前来看，我们认为 AI 产业的革命性浪潮仍处于爆发的早中期。展望 2026 年，AI 有望向更深层次转化，多模态、原生智能等方向或进一步成熟。行业龙头依托软件和硬件的完善生态，在 AI 时代可能有更广阔的发展前景。在需求侧，应用场景和使用人数的双重成长推动算力需求的幂级增长，这为底层算力基础设施建设提供了长期的确定性。从硬件端看，当前供需缺口较大，计算芯片的出货仍可能维持较高增速成长。通信与网络连接环节的技术升级层出不穷，对于光模块而言，Scale Up（纵向扩展）将会成为比 Scale Out（横向扩展）更大的增量市场。同时，在自主可控的时代背景下，国产算力带来先进制程扩产，存力需求带来存储扩产，半导体设备厂商成长道路清晰，估值和业绩或实现共振。

军工也是 2026 年的重点方向。从长周期的产业逻辑来看，2026 年是十五五的开局之年，2027 年还有建军百年奋斗目标重要节点。在重大政策节点之前，军工行业的内需可能逐步改善。与此同时，依托中国装备此前展示出强大战力，军贸市场后续也可能缓慢打开。在细分领域中，商业航天无疑是重要的潜力赛道之一，展露出不俗投资价值。太空不仅是科研的边界，更是未来大国博弈的核心战略资源区。我国有千帆星座、国网星座等重大战略工程，中长期有数万亿市场

空间。随着低轨宽带互联网星座的密集组网，2026 年将成为中国商业航天产能释放的关键大年。

在全球多极化趋势与逆全球化并存的时代，上游资源品不仅具备传统的供需定价逻辑，更被赋予了深厚的战略安全属性。黄金方面，我们认为其不仅是短期的避险脉冲，更是基于深刻的宏观范式转变。全球主要经济体债务规模的持续攀升，法定货币体系的隐性贬值压力增大。而地缘政治的长期复杂化促使各国央行加速外汇储备多元化，黄金的战略储备需求持续旺盛，黄金依然具备较高的中长期配置价值。

而石油、煤炭等传统能源在能源转型期依然扮演着不可或缺的“压舱石”角色。全球范围内长期的资本开支不足导致有色金属、石油等上游资源品的供给弹性极具约束力，地缘政治冲突也为能源的供给带来了难以估量的扰动。对于资本市场而言，优质的资源品公司凭借优异的现金流创造能力、较高的分红意愿，在低估值时具备显著的红利配置价值与抗通胀功能，可能是投资组合中优质的防守反击型资产。

此外，证券、金融板块或也可以适当关注。伴随监管政策进入“积极”周期，证券公司投行、公募基金和海外业务或接棒传统业务，有望支持证券行业 2026 年盈利景气度；证券行业合并重组有望稳步推进，带来阶段性投资机会。在历经一季度的回调后，证券板块估值相对较低，大金融板块同样值得关注。

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	1,631,074,937.92	92.42
	其中：股票	1,631,074,937.92	92.42
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	118,213,942.29	6.70
7	其他各项资产	15,489,345.40	0.88
8	合计	1,764,778,225.61	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	209,179.05	0.01
C	制造业	5,509,343.50	0.32
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	1,845.66	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,983.42	0.00
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	46,988.32	0.00
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,823,339.95	0.33

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,547,417,408.20	88.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,455,420.00	0.77
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	64,378,769.77	3.70
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	-	-
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	1,625,251,597.97	93.36

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	600150	中国船舶	5,631,233	173,667,225.72	9.98
2	600893	航发动力	1,878,122	90,262,543.32	5.19
3	002625	光启技术	2,197,993	84,358,971.34	4.85
4	600879	航天电子	3,530,664	78,521,967.36	4.51
5	600118	中国卫星	824,180	67,467,374.80	3.88
6	600760	中航沈飞	1,220,513	59,927,188.30	3.44
7	002049	紫光国微	903,471	59,665,224.84	3.43
8	002179	中航光电	1,593,129	53,847,760.20	3.09
9	300395	菲利华	586,775	53,631,235.00	3.08
10	600482	中国动力	1,487,935	46,617,003.55	2.68

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	688795	摩尔线程	3,987	1,569,203.46	0.09
2	688802	沐曦股份	2,896	1,198,944.00	0.07
3	688765	禾元生物	16,470	1,004,999.40	0.06
4	688783	西安奕材	44,370	888,731.10	0.05
5	688781	视涯科技	6,335	188,149.50	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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，紫光国芯微电子股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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	325,547.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,163,798.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,489,345.40

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	688795	摩尔线程	1,569,203.46	0.09	新股锁定
2	688802	沐曦股份	1,198,944.00	0.07	新股锁定
3	688765	禾元生物	1,004,999.40	0.06	新股锁定
4	688783	西安奕材	888,731.10	0.05	新股锁定
5	688781	视涯科技	188,149.50	0.01	新股锁定

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰国证航天军工指数 (LOF) A	国泰国证航天军工指数 (LOF) C

本报告期期初基金份额总额	525,410,166.44	247,736,075.12
报告期期间基金总申购份额	359,414,233.13	1,300,878,190.11
减：报告期期间基金总赎回份额	312,609,755.02	823,725,212.26
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	572,214,644.55	724,889,052.97

§ 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	80,873.43
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	80,873.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.01

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

本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、国泰国证航天军工指数证券投资基金（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

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 15-20 层。

基金托管人住所或办公场所。

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

二〇二六年四月二十二日