

# 上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

## 2022 年第 1 季度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年四月二十二日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 4 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。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会纸质投票表决起止时间自 2022 年 2 月 24 日起至 2022 年 3 月 25 日 17:00 止；网络投票起止日期自 2022 年 2 月 24 日起至 2022 年 3 月 25 日，投票时间为交易日 9:15-15:00。本次大会审议了《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金增加转融通证券出借业务有关事项的议案》。本次会议议案于 2022 年 3 月 28 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“为更好地满足投资者需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关约定，同意上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）增加转融通证券出借业务并相应调整投资范围、投资策略、投资限制、估值方法、信息披露等有关事项。为落实本基金增加转融通证券出借业务有关事项，授权基金管理人办理相关具体事宜，并根据《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金增加转融通证券出借业务有关事项的说明》对本基金基金合同等法律文件进行修改。”根据《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金增加转融通证券出借业务有关事项的议案》及相关法律法规的规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，本基金管理人对《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金托管协议》进行了修订，修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2022 年 3 月 29 日起生效。具体可查阅本基金管理人于

2022 年 3 月 29 日披露的《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰上证 180 金融 ETF
场内简称	金融 ETF
基金主代码	510230
交易代码	510230
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 31 日
报告期末基金份额总额	3,616,808,035.00 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最小化。
投资策略	1、股票投资策略：本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，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；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	上证 180 金融股指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### § 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 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-53,756,384.91
2. 本期利润	-185,914,698.47
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0489
4. 期末基金资产净值	3,629,451,221.43
5. 期末基金份额净值	1.0035

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) 本基金于 2011 年 5 月 6 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.28400990。期末还原后基金份额累计净值 = (期末基金份额净值 + 基金份额累计分红金额) × 折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买金融 ETF 后的实际份额净值变动情况。

(4) 本基金于 2020 年 8 月 14 日进行了基金份额折算，折算比例为 5。期末还原后基金份额累计净值 = [(期末基金份额净值 + 基金第二次拆分后份额累计分红金额) × 第二次折算比例 + 第二次拆分前份额累计分红金额] × 第一次折算比例 + 第一次拆分前份额累计分红金额，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买金融 ETF 后的实际份额净值变动情况。

#### 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	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-4.72%	1.55%	-4.64%	1.55%	-0.08%	0.00%
过去六个月	-4.74%	1.26%	-4.74%	1.26%	0.00%	0.00%
过去一年	-14.09%	1.26%	-16.87%	1.27%	2.78%	-0.01%
过去三年	-7.21%	1.34%	-15.25%	1.34%	8.04%	0.00%
过去五年	16.56%	1.32%	2.46%	1.32%	14.10%	0.00%
自基金合同 生效起至今	74.10%	1.55%	39.23%	1.56%	34.87%	-0.01%

### 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

上证 180 金融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

(2011 年 3 月 31 日至 2022 年 3 月 31 日)



注：本基金合同生效日为2011年3月31日，在3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		
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、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、国泰	2014-01-13	-	21 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 月加入国泰基金管理有限公司，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

	<p>策略价值灵活配置混合、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 联接的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监</p>			<p>益灵活配置混合型证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 月起兼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</p>
--	--	--	--	---

				<p>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。2017年7月起任投资总监(量化)、金融工程总监。</p>
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公



平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，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

一季度受国内外多重压力，A股市场震荡下行；国外受乌克兰局势骤然升温，以北约为主的主要西方经济体持续加大对俄罗斯的全方位无限制制裁，主要大宗商品尤其是油气能源以及食品价格大幅攀升，美欧主要经济体通胀持续攀升，美联储货币政策收紧的预期高企；国内受新冠疫情多点散发，尤其是三月份以来包括吉林、上海疫情大面积扩散导致的封城，对于国内本就面临下行压力的经济更是雪上加霜。在国内外多重压力下，市场预期作为传统稳经济的重要手段的房地产政策有望得到阶段性的松动，受地缘政治影响，作为避险资产的黄金震荡上行，受美国为代表的西方主要经济体对俄罗斯的制裁影响，国内主要能源供给煤炭表现出现。

全季度来看，上证指数震荡下跌 10.65%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 11.47%，沪深 300 指数下跌 14.53%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 14.06%，小盘股表征指

数中证 1000 下跌 15.46%。板块上医药医疗科技占比较多的创业板指下跌 19.96%，科创板 50 下跌 21.97%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的为煤炭、房地产、银行，涨幅分别为 22.63%、7.27%和 1.66%，表现落后的为电子、军工、汽车，分别下跌了 25.46%、23.3%和 21.4%。

#### 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-4.72%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年是新冠疫情的第三年，随着新冠疫苗在主要经济体的逐步接种以及抗新冠药物逐步上市，全球经济有望从新冠疫情的阴霾中逐步恢复。后疫情时代，全球地缘政治纷繁复杂，地缘政治危机成为影响全球政治经济的最大的不确定性。另一方面，新冠病毒变种不确定性加大，经济恢复总体上仍然比较脆弱，尤其是在中国经济体量逐步赶超主要发达国家的过程中，主要经济体的博弈和竞争料将带来更多的不确定性。随着基数效应的减弱，出口面临的压力，国内外形势错综复杂，经济下行压力加大，在新冠疫情压力持续加大的情况下，我们预计政策将着力于稳增长为主，传统经济增长的支柱产业在六稳的政策环境下有望迎来阶段性的投资机会。以半导体芯片为代表的科技领域投资价值随着国产替代的渗透而凸显，兼具高景气度以及为我国经济体量相匹配的军工行业是我们中长期坚定看好的方向。随着扩产产能的逐步释放，包括军工、芯片、新能源等制约供给的行业盈利能力有望释放。

### 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	3,627,777,960.62	99.88
	其中：股票	3,627,777,960.62	99.88
2	固定收益投资	1,758,061.65	0.05

	其中：债券	1,758,061.65	0.05
	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	2,425,898.45	0.07
7	其他各项资产	38,377.22	0.00
8	合计	3,632,000,297.94	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920,304.00元，占基金资产净值比例为0.03%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,836,329.26	0.05
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	135,900.00	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	-	-
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	1,972,229.26	0.05

### 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	-	-
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	-	-
J	金融业	3,625,805,731.36	99.90
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	3,625,805,731.36	99.90

### 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	601318	中国平安	11,163,022	540,848,415.90	14.90
2	600036	招商银行	10,803,038	505,582,178.40	13.93
3	601166	兴业银行	14,764,104	305,174,029.68	8.41
4	600030	中信证券	10,082,728	210,729,015.20	5.81
5	601398	工商银行	35,649,927	170,050,151.79	4.69
6	601328	交通银行	28,087,772	143,528,514.92	3.95
7	601288	农业银行	36,012,398	110,918,185.84	3.06
8	600837	海通证券	9,722,671	100,143,511.30	2.76
9	600016	民生银行	25,206,987	96,290,690.34	2.65
10	600000	浦发银行	11,883,316	95,066,528.00	2.62

#### 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	688331	荣昌生物	15,915	614,159.85	0.02
2	688048	长光华芯	6,790	548,632.00	0.02
3	688295	中复神鹰	13,998	410,561.34	0.01
4	688206	概伦电子	6,000	135,900.00	0.00
5	688267	中触媒	3,390	118,887.30	0.00

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,758,061.65	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,758,061.65	0.05

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113057	中银转债	17,580	1,758,061.65	0.05

#### 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（除“工商银行”、“浦发银行”、“兴业银行”、“招商银行”、“民生银行”、“交通银行”、“农业银行”、“中信证券”、“海通证券”公告自身或分支机构违规外）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。

工商银行及其分支行因内部制度不完善；内部制度不完善, 涉嫌违反法律法规；内部制度不完善, 违规经营；涉嫌违反法律法规；提供虚假资料证明文件；违反反洗钱法；未依法履行职责；信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，多次受到监管机构处罚。

浦发银行及其分支行因贷款五级分类不准确；并购贷款管理不审慎；监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送不规范；贷前调查不充分，多笔贷款的贷前调查资料雷同，贷款资金被挪用；银行承兑汇票未严格审查贸易背景真实性；违规发放流动资金贷款；个人按揭贷款管理不到位；流动资金贷款贷后管理未尽职等原因，多次受到监管机构处罚。

兴业银行及其分支行因办理信用证业务未尽职审查贸易背景真实性；贷后管理未尽职，个人综合消费贷款未按约定用途使用；未按规定进行贷款资金监控；涉嫌违反法律法规；违规经营；未依法履行职责等原因，多次受到监管机构处罚。

招商银行及其分支行因涉嫌违反法律法规；违反反洗钱法；违反反洗钱法, 违规经营；违规经营；未依法履行职责；信息披露虚假或严重误导性陈述等原因，多次受到监管机构处罚。

民生银行及其分支行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送涉及违法违规行为；贷款用途审查不严，贷款资金被挪用；未经总行授权开展兜底承诺业务；未按照会计原则进行财务核算；违反人民币银行结算账户管理、征信业管理、客户身份识别相关规定等原因，多次受到监管机构处罚。

交通银行及其分支行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送涉及违法违规行为；发放小微企业贷款附加不合理条件；违反账户管理相关规定；贷款“三查”不尽职，贷款资

金被挪用；信息披露虚假等原因，多次受到监管机构处罚。

农业银行及其分支行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送涉及违法违规行为；内控管理失效、信贷管理不力,严重违反审慎经营规则；违反审慎经营规则导致发生借款人虚假抵押骗取贷款等原因，多次受到监管机构处罚。

中信证券及分支机构未依法履行职责、内部制度不完善，受到地方外管局、地方证监局罚款，责令改正,警告，监管关注。

海通证券及分支机构未依法履行职责，受到地方证监局罚款,责令改正,没收违法所得。

该情况发生后，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	38,377.22
2	应收证券清算款	-
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	-
9	合计	38,377.22

### 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处于转股期的可转换债券。

### 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

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	688331	荣昌生物	614,159.85	0.02	新股锁定
2	688048	长光华芯	548,632.00	0.02	网下中签
3	688295	中复神鹰	410,561.34	0.01	新股锁定
4	688206	概伦电子	135,900.00	0.00	新股锁定
5	688267	中触媒	118,887.30	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	3,887,808,035.00
报告期期间基金总申购份额	330,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	601,000,000.00
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	3,616,808,035.00

## § 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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 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
机构	1	2022年01月01日至2022年03月31日	2,563,560.00	-	-	2,563,560.00	70.88%
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。							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会纸质投票表决起止时间自 2022 年 2 月 24 日起至 2022 年 3 月 25 日 17:00 止；网络投票起止日期自 2022 年 2 月 24 日起至 2022 年 3 月 25 日，投票时间为交易日 9:15-15:00。本次大会审议了《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金增加转融通证券出借业务有关事项的议案》。本次会议议案于 2022 年 3 月 28 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“为更好地满足投资者需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关约定，同意上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）增加转融通证券出借业务并相应调整投资范围、投资策略、投资限制、估值方法、信息披露等有关事项。为落实本基金增加转融通证券出借业务有关事项，授权基金管理人办理相关具体事宜，并根据《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金增加转融通证券出借业务有关事项的说明》对本基金基金合同等法律文件进行修改。”根据《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金增加转融通证券出借业务有关事项的议案》及相关法律法规的规定，经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，本基金管理人对《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金托管协议》进行了修订，修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2022 年 3 月 29 日起生效。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 3 月 29 日披露的《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大

会表决结果暨决议生效的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于核准上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金募集的批复
- 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  
二〇二二年四月二十二日