

# 国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 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：二〇二四年四月二十日

## § 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 2024 年 04 月 18 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 国泰沪深 300 增强策略 ETF   |
| 场内简称       | 300 增强 ETF  |
| 基金主代码      | 561300  |
| 交易代码       | 561300  |
| 基金运作方式     | 交易型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2021 年 12 月 1 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,350,964,969.00 份  |
| 投资目标       | 本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略       | 1、股票投资策略：本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误                            |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>差，达到对标的指数的跟踪目标。在复制标的指数的基础上，综合运用超额收益模型、风险模型、成本模型选择具有较高投资价值的股票构建投资组合。本基金个股选择范围包括标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与标的指数成份股相关度高的股票等。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度上的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会，力求在有效跟踪标的指数的基础上获取超越标的指数的超额收益。</p> <p>（1）超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值，定价过高的资产应当考虑回避。其中，多因子量化系统基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、成长性因子、技术因子、流动性因子、分析师因子等多类对股票超额收益具有较强解释能力的因子进行构建。</p> <p>（2）风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括行业偏离度、风格偏离度、波动率等，力求将主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。</p> <p>（3）成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等预测本基金的交易成本，以减少交易对业绩造成的负影响。指数基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、存托凭证投资策略；<br/>3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转</p> |
|--|--|

|        |  |
|--------|--|
|        | 换债券和可交换债券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。                     |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，理论上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，属于较高风险、较高收益的基金。 |
| 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   |

### § 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<br>(2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益      | -4,296,849.88                           |
| 2.本期利润         | 76,280,613.60                           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0352                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 1,671,018,185.02                        |
| 5.期末基金份额净值     | 0.7108                                  |

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

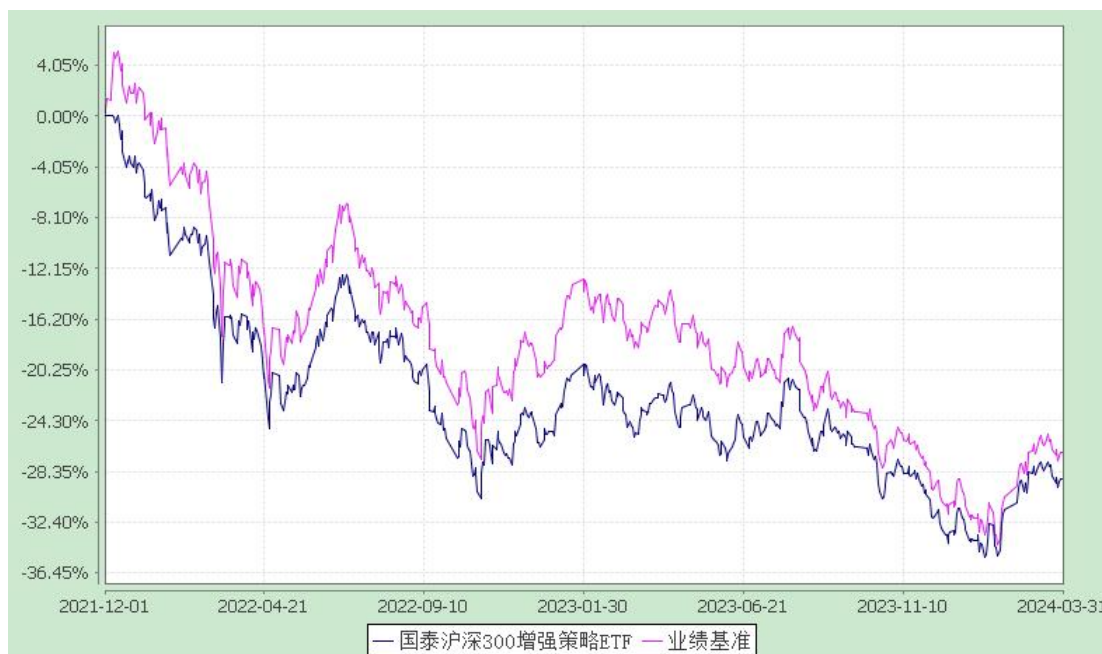
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

|            |         |       |         |       |        |        |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
|            |         |       |         | ④     |        |        |
| 过去三个月      | 3.52%   | 0.97% | 3.10%   | 1.03% | 0.42%  | -0.06% |
| 过去六个月      | -3.50%  | 0.87% | -4.12%  | 0.91% | 0.62%  | -0.04% |
| 过去一年       | -7.78%  | 0.85% | -12.67% | 0.89% | 4.89%  | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -28.92% | 0.99% | -26.79% | 1.07% | -2.13% | -0.08% |

### 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

国泰沪深 300 增强策略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 12 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日)



注：本基金合同生效日为2021年12月1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 | 说明 |
|----|----|-------------|-------|----|
|----|----|-------------|-------|----|

|    |  | 任职日期       | 离任日期 | 限    |   |
|----|--|------------|------|------|---|
| 梁杏 | 国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰国证医药卫生行业指数、国泰国证食品饮料行业指数、国泰量化收益灵活配置混合、国泰中证生物医药 ETF、国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接、国泰上证综合 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证畜牧养殖 ETF、国泰中证医疗 ETF 联接、国泰中证全指软 | 2021-12-01 | -    | 17 年 | 学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 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 2019 年 4 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 7 月起兼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，2019 年 4 月起兼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式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 11 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）的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 1 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、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和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  | <p>件 ETF 联接、国泰中证畜牧养殖 ETF 联接、国泰中证沪港深创新药产业 ETF、国泰中证沪港深创新药产业 ETF 发起联接、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF 的基金经理、国泰中证港股通科技 ETF、国泰中证有色金属矿业主题 ETF、国泰中证有色金属 ETF 的基金经理，</p> |  |  |  | <p>基金的基金经理，2020 年 12 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任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）的基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 2 月任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的基金经理，2021 年 2 月至 2022 年 2 月任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月起兼任国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证医疗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的基金经理，2021 年 7 月起兼任国泰中证畜牧养殖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 9 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业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 12 月起兼任国泰沪深</p> |
|--|--|--|--|--|---|

|     |  |            |   |     |  |
|-----|--|------------|---|-----|--|
|     | 总经理助理、量化投资部总监  |            |   |     | 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金和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 1 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资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的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资部副总监，2018 年 7 月起任量化投资部总监，2023 年 11 月起任总经理助理。   |
| 吴中昊 | 国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、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 | 2022-12-30 | - | 9 年 | 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 |



|  |   |  |  |  |   |
|--|---|--|--|--|---|
|  | 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、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证煤炭 ETF、国泰创业板指数 (LOF)、国泰中证香港内地国有企业 ETF (QDII)、国泰中证机器人 ETF 的基金经理 |  |  |  | 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,2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理,2023 年 11 月起兼任国泰中证机器人交易型开放式指数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 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

2024 年第一季度 A 股出现大幅波动。一月末二月初股市出现急跌行情，上证指数达到 2635 低点。小盘，微盘股都在不同程度上出现了流动性危机，小票发生踩踏，也螺旋式的加剧了下跌的趋势。春节前，宽基指数 ETF 迎来巨额申购，市场流动性危机逐步缓解，信心逐渐恢复。A 股节后大幅反弹，上证指数迅速收复 3000 点大关。

一季度上证指数震荡上涨 2.23%，大、中、小盘的代表，沪深 300，中证 500 和中证 1000 指数分别上涨 3.10%，下跌-2.64%和-7.58%。资源性质和红利性质的有色，煤炭，银行板块分别上涨 9.46%，10.23%和 10.78%，表现靠前。而以医药，电子，军工为代表的成长性板块则表现较为落后。

#### 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 3.52%，同期业绩比较基准收益率为 3.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度出口以及制造业投资带动了整体的经济复苏，消费数据也出现明确的好转，三月份，制造业 PMI 指标已经站上了荣枯线，可以说，2024 年国内经济复苏的态势是比较明确的。但是，对于复苏的强度以及中间可能遇到的曲折与挑战，投资者应该做好足够的思想准备。股市在二、三季度可能出现整体震荡，结构性机会的结构市。这或许是较好的经济数据与稳健的财政政策对冲后的理想结果。随着经济进入高质量增长的阶段，具备完善的治理结构，优秀的管理层的核心资产仍具有良好的投资机会，同时，对于大量的核心资产而言，现在的估值水平也已经比较合适。

#### 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              | 1,670,857,054.93 | 99.88        |
|    | 其中：股票             | 1,670,857,054.93 | 99.88        |
| 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 | 1,921,988.26     | 0.11   |
| 7 | 其他各项资产       | 165,440.03       | 0.01   |
| 8 | 合计           | 1,672,944,483.22 | 100.00 |

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 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              | 40,514,670.34 | 2.42         |
| 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      | 11,556.45     | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,924.10      | 0.00         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,097.60      | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,750.21     | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 15,863.38     | 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          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 40,566,862.08 | 2.43         |

### 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         | 7,135,763.00     | 0.43   |
| B | 采矿业              | 68,262,222.83    | 4.09   |
| C | 制造业              | 920,993,027.17   | 55.12  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 39,661,619.00    | 2.37   |
| E | 建筑业              | 44,625,303.70    | 2.67   |
| F | 批发和零售业           | 20,388,431.00    | 1.22   |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 65,431,241.50    | 3.92   |
| H | 住宿和餐饮业           | -                | -      |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 77,086,994.47    | 4.61   |
| J | 金融业              | 366,207,750.48   | 21.92  |
| K | 房地产业             | 3,329,100.00     | 0.20   |
| L | 租赁和商务服务业         | 3,592,338.10     | 0.21   |
| M | 科学研究和技术服务业       | 13,576,401.60    | 0.81   |
| 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               | 1,630,290,192.85 | 97.56  |

### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 55,718    | 94,882,182.20 | 5.68         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 1,425,123 | 45,888,960.60 | 2.75         |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 592,600   | 38,056,772.00 | 2.28         |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 195,930   | 37,258,048.80 | 2.23         |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 238,908   | 36,674,767.08 | 2.19         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 819,043   | 33,425,144.83 | 2.00         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 1,889,095 | 29,809,919.10 | 1.78 |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 4,886,800 | 25,802,304.00 | 1.54 |
| 9  | 601328 | 交通银行 | 3,910,900 | 24,795,106.00 | 1.48 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 878,200   | 24,501,780.00 | 1.47 |

### 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  | 002064 | 华峰化学 | 1,243,000 | 8,352,960.00 | 0.50         |
| 2  | 002600 | 领益智造 | 1,505,500 | 8,265,195.00 | 0.49         |
| 3  | 601216 | 君正集团 | 2,171,200 | 8,011,728.00 | 0.48         |
| 4  | 002414 | 高德红外 | 1,080,800 | 7,814,184.00 | 0.47         |
| 5  | 300207 | 欣旺达  | 327,500   | 4,539,150.00 | 0.27         |

### 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（除“工商银行、交通银行、兴业银行、招商银行”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。

工商银行及其下属分支机构由于未严格审核银行承兑汇票业务贸易背景，严重违反审慎经营规则；迟报案件确认报告；贷款三查不到位，未发现借款人按揭首付款未实际缴付；贷前调查不尽职、贷后管理不到位未注册取得基金从业资格的人员销售基金；小微企业划型不准确；主承销的多期债务融资工具发行定价严重偏离市场合理水平，干扰了市场秩序等原因，受到监管机构公开处罚。

交通银行及下属分支机构因超授权为金融机构开办表外融资；未按规定办理经常项目外汇业务；贷前调查不审慎，超过实际资金需求发放贷款，导致信贷资金回流至借款人；票据业务办理不审慎，严重违反审慎经营规则；未严格执行受托支付管理、贷后管理不到位；个人信用消费贷款管理不到位；违规发放个人贷款；违规转嫁经营成本等原因，受到监管机构公开处罚。

兴业银行及下属分支机构因通过不正当方式虚增存贷款；贷后管理不到位，个人经营性贷款违规用于购买理财产品；贷前调查未尽职，未发现个人收入流水造假；流动贷款资金偿还委托贷款；衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；债券交易超授权；通过资产管理产品开展不正当交易；债券投资五级分类不准确；债券投资风险管理未独立于当地分支行，受到监管机构公开处罚。

招商银行及其下属分支机构因未按规定承担小微企业押品评估费；未按规定承担房屋抵押登记费；未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费；小微企业规模划型依据不足；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、

违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为等受到金管局分支机构、外管局分支机构、央行分支机构罚款、警告、没收违法所得、整改通知。

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   | 165,440.03 |
| 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      | 165,440.03 |

### 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

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。



## § 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   | 1,663,964,969.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 948,000,000.00   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 261,000,000.00   |
| 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   | 2,350,964,969.00 |

## § 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              | 2024年01月25日至2024年03月31日 | -              | 581,262,100.00 | -    | 581,262,100.00 | 24.72% |
|   | 2              | 2024年01月01日至2024年03月31日 | 534,092,000.00 | -              | -    | 534,092,000.00 | 22.72% |
| 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、关于准予国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 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。

### 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

二〇二四年四月二十日