

上证 180 金融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 | 3,410,808,035.00 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 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | -49,166,455.75 |
| 2.本期利润 | 154,430,277.53 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0448 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,388,935,232.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9936 |

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 | 4.71% | 0.91% | 4.89% | 0.91% | -0.18% | 0.00% |
| 过去六个月 | -3.36% | 0.82% | -3.29% | 0.82% | -0.07% | 0.00% |
| 过去一年 | 5.07% | 1.05% | 0.80% | 1.06% | 4.27% | -0.01% |
| 过去三年 | -14.94% | 1.17% | -24.36% | 1.18% | 9.42% | -0.01% |
| 过去五年 | -8.13% | 1.25% | -22.89% | 1.26% | 14.76% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 72.38% | 1.49% | 26.68% | 1.50% | 45.70% | -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 2024 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）、芯片 | 2014-01-13 | - | 23 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 |

| | | | | |
|--|---|--|--|---|
| | <p>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 (QDII-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</p> | | | <p>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</p> |
|--|---|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>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。</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

今年一季度，A 股市场在国内外多重因素的影响下，呈现出了较大的波动性。国内经济在新冠疫情常态化管理后逐步恢复，但复苏过程中仍面临一些挑战。经历了短期流动性风险的释放，上证指数一度跌到 2635 点低点，在中央汇金持续大力增持场内宽基 ETF 并将增持标的扩大到包括中证 1000 等中小盘成长性标的 ETF，市场流动性危机逐步缓解。国内外在

人工智能技术领域的大规模投入和进步，对相关板块带来持续的提振。

全季度来看，上证指数宽幅震荡小幅收涨 2.23%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数上涨 3.82%，沪深 300 指数上涨 3.1%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 2.64%，小盘股表征指数中证 1000 下跌 7.58%。板块上新能源汽车、医药医疗科技占比较多的创业板指下跌 3.87%，硬科技占比较高的科创板 50 大幅下挫 10.48%。

在行业表现上，申万一级行业中表现靠前的为银行、石油石化、煤炭等高分红高股息防御板块，表现落后的为医药生物、计算机、电子等成长性板块。

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 4.71%，同期业绩比较基准收益率为 4.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为国内经济将继续稳步恢复，政策层面的支持和市场信心的逐步修复将为 A 股市场提供支撑。同时，科技创新仍然是推动经济发展的关键力量，特别是在人工智能、半导体等前沿技术领域，预计将持续吸引投资者的关注。

在全球层面，地缘政治的不确定性仍然是影响市场的重要因素。我们将持续关注全球政治经济形势的变化，以及其对 A 股市场的潜在影响。

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 | 3,387,148,301.70 | 99.88 |
| | 其中：股票 | 3,387,148,301.70 | 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 | 4,129,911.13 | 0.12 |
| 7 | 其他各项资产 | 17,432.17 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 3,391,295,645.00 | 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18,374,216.00元，占基金资产净值比例为0.54%。

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 | 111,884.15 | 0.00 |
| 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 | - | - |
| 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 | 148,325.68 | 0.00 |

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 | - | - |
| 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 | 3,386,999,976.02 | 99.94 |
| 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 | 3,386,999,976.02 | 99.94 |

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 | 11,605,313 | 473,612,823.53 | 13.98 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 13,346,841 | 429,768,280.20 | 12.68 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 15,681,096 | 247,447,694.88 | 7.30 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 10,523,469 | 202,050,604.80 | 5.96 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 37,789,927 | 199,530,814.56 | 5.89 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 29,624,498 | 187,819,317.32 | 5.54 |
| 7 | 600919 | 江苏银行 | 19,787,935 | 156,324,686.50 | 4.61 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 34,422,673 | 145,607,906.79 | 4.30 |
| 9 | 600016 | 民生银行 | 26,766,681 | 108,405,058.05 | 3.20 |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 22,727,012 | 99,998,852.80 | 2.95 |

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 | 688709 | 成都华微 | 1,045 | 20,273.00 | 0.00 |
| 2 | 688652 | 京仪装备 | 416 | 17,621.76 | 0.00 |
| 3 | 601033 | 永兴股份 | 1,258 | 15,863.38 | 0.00 |
| 4 | 603341 | 龙旗科技 | 298 | 12,432.56 | 0.00 |
| 5 | 601083 | 锦江航运 | 1,263 | 11,556.45 | 0.00 |

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“交通银行”、“中国银行”、“农业银行”、“工商银行”、“兴业银行”、“民生银行”、“招商银行”、“中信证券”、“江苏银行”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。

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。

中国银行及下属分支机构因贷款三查不到位；信用卡汽车分期业务管理不审慎；员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则；员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则；违规报送统计报表；贷前调查不审慎、未对押品权证的真实性认真审核；违规实施贷款展期等原因，受到监管机构公开处罚。

农业银行及其下属分支机构因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；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料个人贷款管理不到位，信贷资金流入限制性领域；贷前调查不到位，未发现客户资金交易流水造假；固定资产贷款发放不审慎；贷款五级分类不准确；贷款资金未按约定用途使用；信贷业务管理不到位，严重违反审慎经营规则等原因，受到监管机构公开处罚。

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。

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。

民生银行及其下属分支机构因贷后管理不到位；金融许可证保管不善导致遗失；违规收取信贷资金受托支付划拨费；未与小微企业合理分担保险费用；与非名单内交易对手开展票据业务；票据代理回购中存在清单交易；未按监管规定分担小微企业抵押物财产保险费；金融产品销售管理监督不到位，严重违反审慎经营规则；采取浮利分费的方式将部分贷款利息转作中间业务收入、个人住房按揭贷款借款人收入状况真实性调查核实不到位、虚假轮岗等原因，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。

中信证券因对员工证券经纪业务营销活动管理不到位，未严格规范从业人员执业行为，合规管理存在不足；机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题；对关联方及关联交易现场检查不到位，未保持应有的职业审慎并开展审慎核查，未能督导发行人有效防止关联方违规占用发行人资金等原因，受到监管机构公开处罚。

江苏银行及下属分支机构因员工行为管理不到位；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；对金融产品作出虚假或者引人误解的宣传；违反账户管理规定；违反流通人民币管理规定；违反人民币反假有关规定；占压财政存款或者资金；违反国库科目设置和使用规定；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等原因，受到监管机构公开处罚。

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 | 97.05 |
| 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 | 17,335.12 |
| 9 | 合计 | 17,432.17 |

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 | 601318 | 中国平安 | 8,162,000.00 | 0.24 | 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 | 688709 | 成都华微 | 20,273.00 | 0.00 | 新股锁定 |
| 2 | 688652 | 京仪装备 | 17,621.76 | 0.00 | 新股锁定 |
| 3 | 601033 | 永兴股份 | 15,863.38 | 0.00 | 新股锁定 |
| 4 | 603341 | 龙旗科技 | 12,432.56 | 0.00 | 新股锁定 |
| 5 | 601083 | 锦江航运 | 11,556.45 | 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 | 3,439,808,035.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 482,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 511,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 3,410,808,035.00 |

§ 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 | 2024年01月01日至2024年03月31日 | 2,563,560.00 | - | - | 2,563,560.00 | 75.16% |
| 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、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 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