

国泰沪深 300 指数证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§ 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 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰沪深 300 指数
基金主代码	020011
交易代码	020011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 11 月 11 日
报告期末基金份额总额	1,238,053,215.38 份
投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，实现对沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	1、本基金为以完全复制为目标的指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投

	<p>投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。</p> <p>2、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>	
业绩比较基准	90%×沪深 300 指数收益率+10%×银行同业存款收益率	
风险收益特征	本基金属于中高风险的证券投资基金品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	020011	005867
报告期末下属分级基金的份额总额	1,227,351,386.59 份	10,701,828.79 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
1.本期已实现收益	12,325,688.84	101,612.90
2.本期利润	-154,185,709.89	-1,435,435.53

3.加权平均基金份额本期利润	-0.1263	-0.1441
4.期末基金资产净值	1,026,760,171.54	10,150,506.48
5.期末基金份额净值	0.8366	0.9485

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、国泰沪深 300 指数 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	-13.12%	0.83%	-13.73%	0.80%	0.61%	0.03%
过去六个月	-7.14%	1.11%	-8.86%	1.07%	1.72%	0.04%
过去一年	-17.92%	1.10%	-19.71%	1.06%	1.79%	0.04%
过去三年	13.26%	1.19%	0.43%	1.14%	12.83%	0.05%
过去五年	16.42%	1.20%	0.43%	1.15%	15.99%	0.05%
自基金合同 生效起至今	-3.57%	1.53%	-18.00%	1.48%	14.43%	0.05%

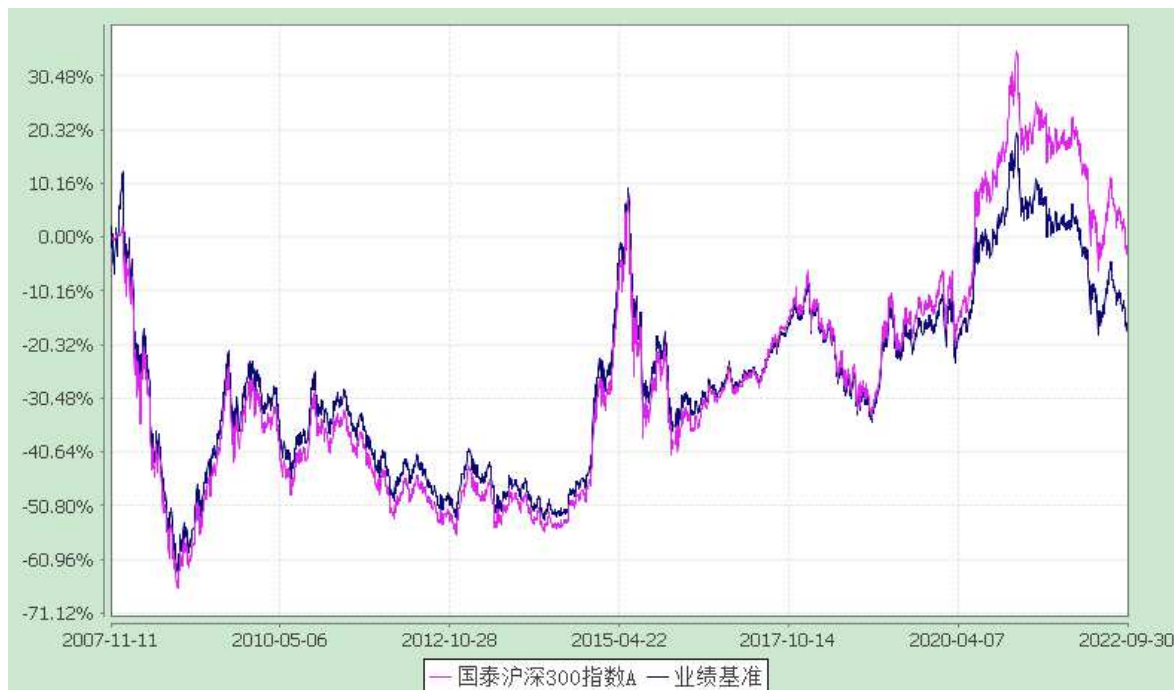
2、国泰沪深 300 指数 C：

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	-13.23%	0.83%	-13.73%	0.80%	0.50%	0.03%
过去六个月	-7.37%	1.11%	-8.86%	1.07%	1.49%	0.04%
过去一年	-18.33%	1.10%	-19.71%	1.06%	1.38%	0.04%
过去三年	11.55%	1.19%	0.43%	1.14%	11.12%	0.05%
自新增 C 类 份额以来	15.91%	1.23%	0.99%	1.18%	14.92%	0.05%

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 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的历史走势对比图
(2007 年 11 月 11 日至 2022 年 9 月 30 日)

1. 国泰沪深 300 指数 A:



注：本基金的合同生效日为 2007 年 11 月 11 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. 国泰沪深 300 指数 C:



注：(1)本基金的合同生效日为 2007 年 11 月 11 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)自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金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		
谢东旭	国泰沪深 300 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰上证综合 ETF、国泰国证有色金属行业指数、国泰沪深 300 指数、国泰上证综合 ETF 联接、	2021-01-08	-	11 年	硕士研究生。曾任职于中信证券、华安基金管理有限公司、创金合信基金管理有限公司。2018 年 7 月加入国泰基金，任基金经理助理。2019 年 11 月至 2020 年 12 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月至 2022 年 2 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月起任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）和国泰沪深 300 指数增强型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基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰沪深 300 指数证券投资基金和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 7 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰中证

	<p>国泰创业板指数 (LOF)、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证钢铁 ETF 联接、国泰中证新能源汽车 ETF 联接、国泰中证全指家用电器 ETF 联接、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略 ETF 的基金经理</p>				<p>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 12 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</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

三季度全球金融市场进入美国强劲加息周期，受持续高企的通胀走势和良好的就业形势影响，美联储全面转向鹰派，连续超出市场预期的 75bp 加息对全球金融市场带来压力，非美货币汇率大幅贬值，全球主要金融资产纷纷下挫；国内

方面，受疫情持续多点发散，投资者对国内宏观经济形势预期较为悲观，A 股市场延续下跌趋势，在美国出台芯片法案并持续对中国半导体芯片、高性能计算更大范围的打压下，包括半导体设备等国产化受益细分行业受到抛压；受俄乌局势持续影响，全球能源和粮食供应紧张局势加剧，以煤炭为代表的国内主要能源类公司叠加储能业务推进表现亮眼，受猪价上涨预期影响的养殖行业表现不俗。

全季度来看，上证指数单边震荡下跌 11.01%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 14.66%，沪深 300 指数下跌 15.16%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 11.47%，小盘股表征指数中证 1000 下跌 2.45%。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 18.56%，科创板 50 下跌 15.04%。

在行业表现上，申万一级行业中表现靠前的为煤炭、公用事业、石油石化，涨跌幅分别为 0.97%、-4.54%和-4.91%，表现落后的为建材、电力设备、电子，分别下跌了 23.98%、18.01%和 17.58%。

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-13.12%，同期业绩比较基准收益率为-13.73%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-13.23%，同期业绩比较基准收益率为-13.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

10 月份党的 20 大的召开以及随后的一系列重要会议将为未来 5 年中国政治经济制定目标和发展方向，投资者有望逐步修正预期，我们预计国内宏观流动性将保持合理充裕，各项稳经济政策将持续发力，经济活动恢复有望加快，整体上有利于投资者信心的修复。

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。

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	963,181,716.80	92.79
	其中：股票	963,181,716.80	92.79
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	73,917,155.87	7.12
7	其他各项资产	913,189.55	0.09
8	合计	1,038,012,062.22	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	13,164,849.96	1.27
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	3,386,884.80	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	704,746.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,586,533.78	0.15
J	金融业	7,382,754.46	0.71
K	房地产业	687,214.80	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	910,202.75	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	31,085.60	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	676,306.54	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,139,148.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	29,669,726.69	2.86

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	12,891,551.11	1.24
B	采矿业	29,265,778.39	2.82
C	制造业	531,635,414.10	51.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,430,037.35	2.65
E	建筑业	18,520,780.15	1.79
F	批发和零售业	2,567,950.56	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	27,768,907.99	2.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,358,373.87	2.54
J	金融业	201,237,102.41	19.41
K	房地产业	20,198,818.56	1.95

L	租赁和商务服务业	13,810,085.40	1.33
M	科学研究和技术服务业	12,129,868.36	1.17
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	411,480.00	0.04
Q	卫生和社会工作	8,182,440.06	0.79
R	文化、体育和娱乐业	1,103,401.80	0.11
S	综合	-	-
	合计	933,511,990.11	90.03

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	600519	贵州茅台	34,671	64,921,447.50	6.26
2	300750	宁德时代	77,600	31,109,064.00	3.00
3	601318	中国平安	601,238	24,999,476.04	2.41
4	600036	招商银行	687,985	23,150,695.25	2.23
5	000858	五粮液	108,023	18,280,732.29	1.76
6	601012	隆基绿能	335,432	16,070,547.12	1.55
7	600900	长江电力	627,298	14,264,756.52	1.38
8	601166	兴业银行	805,412	13,410,109.80	1.29
9	000333	美的集团	270,818	13,354,035.58	1.29
10	002594	比亚迪	50,102	12,626,205.02	1.22

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	601108	财通证券	179,770	1,215,245.20	0.12
2	300144	宋城演艺	94,929	1,139,148.00	0.11
3	601607	上海医药	68,828	1,136,350.28	0.11

4	000783	长江证券	213,686	1,113,304.06	0.11
5	603939	益丰药房	22,060	1,097,705.60	0.11

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（除“兴业银行”、“招商银行”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。

兴业银行股份有限公司及下属分支机构因代理销售保险业务过程中严重违反审

慎经营规则行为；错报投诉数据；未按规定履行客户身份识别义务；超过期限或未向人民银行报送账户开立资料；占压财政存款或资金；存在夸大保险责任等销售误导行为；贷后管理不到位，贷款用途不合规；贷款“三查”不尽职，严重违反审慎经营规则；托管业务内控不审慎，对划款指令形式审核、定期交易复核不到位；违规发放虚假商用房按揭贷款；同业投资严重不审慎，资金违规投向土地收储；违规向资本金未真实到位的棚改项目提供融资；因管理不善导致金融许可证遗失；越权审批授信承接问题贷款、越权审批授信额度规避集团授信管理等原因，多次受到监管机构公开处罚。

中国招商银行股份有限公司及下属分支机构因超过期限向中国人民银行报送账户开立资料；拖延支付票据；未按照规定履行客户身份识别义务；未按照规定处理征信异议；保理业务管理不尽职、资金被挪用；代销保险业务存在误导销售；金融消费者权益保护部门没有足够的人力独立开展工作；未按规定向人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；未按规定履行客户身份识别义务；对外付出残缺、污损人民币 5. 未按规定收缴假币；开立、撤销银行结算账户超期备案；未按规定停止新增不同法人机构间直连处理条码支付业务；违规办理银行承兑汇票；违规向房地产开发企业提供融资、个人经营贷款流入股市、违规发放个人住房按揭贷款；违规审批用于固定资产投资项目的流动资金贷款；贷款受托支付不及时；贷前调查不尽职形成风险；违规发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；贷后管理不尽职，贷款资金被挪用；信贷资产非真实洁净转让等原因，多次受到监管机构公开处罚。

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	19,940.49

2	应收证券清算款	51,778.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	841,470.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	913,189.55

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

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

项目	国泰沪深300指数A	国泰沪深300指数C
本报告期期初基金份额总额	1,219,039,658.35	10,310,454.29
报告期期间基金总申购份额	43,405,546.60	5,022,350.10
减：报告期期间基金总赎回份额	35,093,818.36	4,630,975.60
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,227,351,386.59	10,701,828.79

§ 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、关于核准国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复
- 2、国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰沪深 300 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

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

二〇二二年十月二十六日