

国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

§ 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 2023 年 7 月 19 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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	1,393,964,969.00 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； 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
	(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	1,690,986.04
2. 本期利润	-35,582,635.32
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0251
4. 期末基金资产净值	1,038,441,563.48
5. 期末基金份额净值	0.7450

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

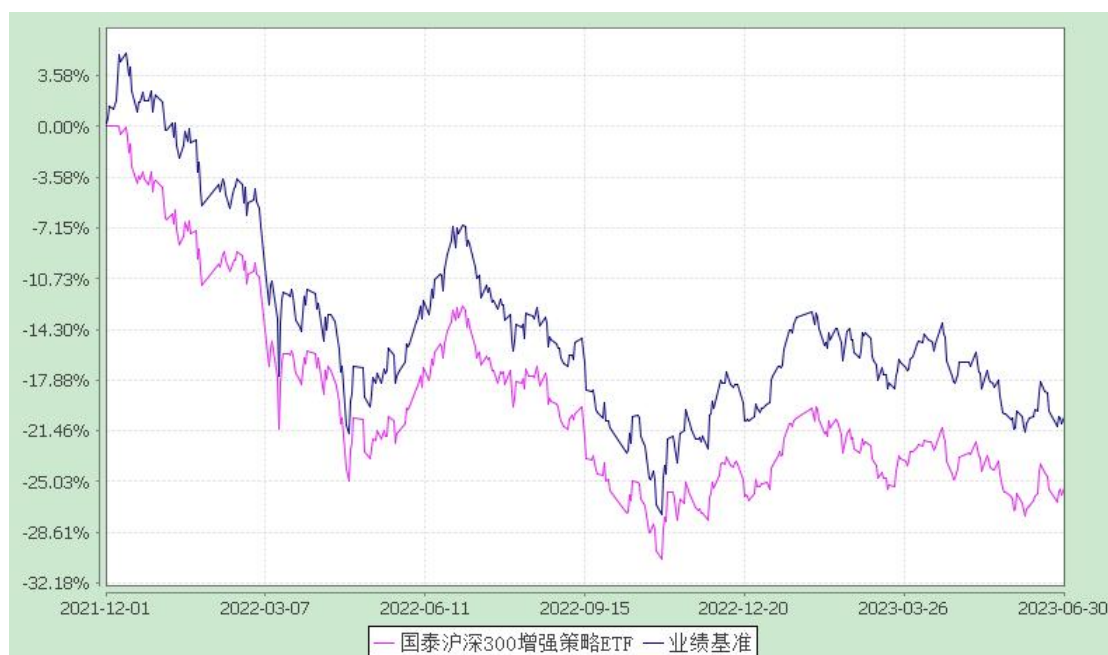
阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	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	-3.35%	0.80%	-5.15%	0.83%	1.80%	-0.03%
过去六个月	-0.43%	0.80%	-0.75%	0.84%	0.32%	-0.04%
过去一年	-14.64%	0.91%	-14.33%	0.99%	-0.31%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	-25.50%	1.05%	-20.48%	1.14%	-5.02%	-0.09%

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 2023 年 6 月 30 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2021-12-01	-	16 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

	<p>泰中证医疗 ETF 联接、国泰中证全指软件 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</p>			<p>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</p>
--	--	--	--	---

	ETF、国泰中证有色金属 ETF 的基金经理，量化投资部总监				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 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。
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	2022-12-30	-	8 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

	数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰房地产行业指数、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) 的基金经理				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。
--	---	--	--	--	--

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，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参与的交易所公开竞价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% 的交易次数为 1 次。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

二季度 A 股呈现震荡下跌的走势，上证跌 2.16%，大盘代表沪深 300 跌 5.15%，中盘中证 500 跌 5.38%，小盘代表中证 1000 下跌 3.98%。由于经济数据承压，预期转弱等等原因，投资人风险偏好下行，市场内部仍然呈现结构性行情。虽然在二季度出现回撤，但数字经济，AI，以及硬科技仍然是市场的相对增长点。相对的，消费，地产等板块则持续走低。

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-3.35%，同期业绩比较基准收益率为-5.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于货币政策效果不及预期，我国经济可能需要更长的修复期。同时，在美国的高息，地缘政治等综合因素的作用下，人民币持续贬值，A 股持续承压。如何提振消费仍然是未来长期需要解决的关键问题。由于整体经济环境的因素，投资人风险偏好降低，A 股在未来可

能会继续呈现结构化行情的特征。

今年以来，我们发现风格对超额收益的解释程度持续上升，选股因子受到拥挤的影响，收益归于风格化。未来一段时间内，如何避免策略拥挤将成为投资成功的重要因素。

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	1,025,994,470.20	98.66
	其中：股票	1,025,994,470.20	98.66
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	13,745,766.92	1.32
7	其他各项资产	226,372.22	0.02
8	合计	1,039,966,609.34	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	17,029,579.82	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	28,561.44	0.00
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	80,548.12	0.01
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,230,570.34	1.66

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	11,347,325.00	1.09
B	采矿业	28,446,318.01	2.74
C	制造业	552,824,961.49	53.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,682,031.10	3.34
E	建筑业	20,133,898.40	1.94
F	批发和零售业	7,260,138.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	48,250,864.80	4.65

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,442,649.20	4.66
J	金融业	229,299,211.06	22.08
K	房地产业	8,116,740.00	0.78
L	租赁和商务服务业	9,050,045.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	8,984,376.20	0.87
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	1,925,341.60	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,008,763,899.86	97.14

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	31,318	52,958,738.00	5.10
2	300750	宁德时代	119,830	27,415,905.70	2.64
3	600036	招商银行	684,523	22,424,973.48	2.16
4	601318	中国平安	479,300	22,239,520.00	2.14
5	000333	美的集团	294,700	17,363,724.00	1.67
6	600030	中信证券	787,315	15,573,090.70	1.50
7	601166	兴业银行	965,695	15,113,126.75	1.46
8	601012	隆基绿能	511,800	14,673,306.00	1.41
9	601398	工商银行	2,978,900	14,358,298.00	1.38
10	000725	京东方 A	3,280,100	13,415,609.00	1.29

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	002600	领益智造	772,600	5,338,666.00	0.51

2	601966	玲珑轮胎	240,100	5,335,022.00	0.51
3	002032	苏泊尔	106,622	5,331,100.00	0.51
4	688249	晶合集成	5,887	106,319.22	0.01
5	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	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”、“兴业银行”、“招商银行”、“中信证券”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。

工商银行下属分支机构因违规借贷搭售财产保险、国内保理和国内订单融资业务贷款“三查”不尽职、违规经营、内控管理不严，贷款业务严重违反审慎经营规则，个人贷款资金审查不严致使违规流入限制性领域，贷款“三查”执行不到位违法违规，迟报案件信息、贷款管理不到位，个人信贷资金被违规挪用，存在以贷收费行为，欺骗投保人、被保险人或者受益人，逆程序进行贷款操作，虚增存贷款规模、员工行为管理不到位、车贷分期业务开展不审慎、车贷分期业务整改缓慢、违规发放个人汽车消费贷款并形成不良，票据业务贸易背景真实性审查不严、提供虚假资料证明文件，违反反洗钱法、工作人员贪污、挪用、侵占银行或者客户的资金，内部制度不完善、部分分支行存在基金销售业务部门负责人未取得基金从业资格、负责基金销售业务的部门取得基金从业资格的人员低于该部门员工人数的 1/2 等问题，受到银保监局、央行派出机构、地方证监局责令改正、警告、罚款、没收违法所得等处罚。

兴业银行及下属分支机构因贷款业务严重违反审慎经营规则；未按规定落实重要岗位人员轮岗，严重违反审慎经营规则；违反规定办理结汇、售汇业务；在销售产品准入集中统一管理、基金销售业务数据统计质量等方面存在不足；衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；对实际无贷款利率避险需求的客户提供代客 LPR 利率互换业务；代客 LPR 利率互换业务未按规定进行分类管理；债券交易超授权；通过资产管理产品开展不正当交易；比例投资本行主承销的债券；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；通过金融市场进行电子化交易的同业业务委托分支机构询价和项目发起；市场风险资本计量严重不审慎；流动贷款资金偿还委托贷款等原因，受到监管机构公开处罚。

招商银行及下属分支机构因未按规定对保险销售从业人员进行执业登记和管理、未按照保险公司提供的销售合同条款全面、客观揭示所代销保险产品风险、向未完成竣工验收的商业用房发放按揭贷款、向项目资本金不足的项目发放房地产开发贷款、非标业务管理不尽职、房地产开发贷款放款管理不到位、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、不当销售、贷款业务严重违反审慎经营规则、基金销售业务违规、管理不善导致金融许可证遗失、违反反洗钱管理规定、员工行为管理不到位、涉案账户交易监测不到位、理财销售行为不当、信贷资金回流借款人；未按项目进度放款；房地产供应链业务信贷资金用于垫资房地产开发项目，贷款投向未纳入房地产行业统计等问题，受到银保监会、地方银保监局、地方证监局、央行、央行派出机构公开批评、公开处罚、警告、罚款、责令改正等处罚。

中信证券因组织架构规范整改不力、违反反洗钱法、保荐创业板 IPO 违规、对所保荐 IPO 企业督导不力等问题，受到深交所、上交所、央行、深圳证监局罚款处分、警示函、责令改正等处罚。

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	203,863.67
2	应收证券清算款	22,508.55
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	226,372.22

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	688249	晶合集成	106,319.22	0.01	新股锁定

2	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.01	网下中签
3	301488	豪恩汽电	10,422.36	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	1,459,964,969.00
报告期期间基金总申购份额	150,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	216,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,393,964,969.00

§ 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	2023年04月01日至2023年06月30日	534,092,000.00	-	-	534,092,000.00	38.31%
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 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
二〇二三年七月二十一日