

# 上证 180 金融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	3,814,808,035.00 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
	(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-14, 466, 527. 10
2. 本期利润	93, 573, 094. 56
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0251
4. 期末基金资产净值	3, 710, 081, 295. 33
5. 期末基金份额净值	0. 9725

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	2.83%	1.27%	1.41%	1.29%	1.42%	-0.02%
过去六个月	1.78%	1.11%	0.49%	1.12%	1.29%	-0.01%
过去一年	-2.07%	1.17%	-6.24%	1.19%	4.17%	-0.02%
过去三年	-4.37%	1.32%	-14.44%	1.33%	10.07%	-0.01%
过去五年	11.21%	1.35%	-5.31%	1.36%	16.52%	-0.01%
自基金合同生效起至今	68.72%	1.51%	27.46%	1.52%	41.26%	-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 2023 年 6 月 30 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	2014-01-13	-	22 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

	<p>行业指数 (LOF)、国泰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、国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰标普 500ETF 的基金经理、投资总监 (量化)、金融工程总监</p>			<p>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</p>
--	---	--	--	---

				<p>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。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 and 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

二季度国内经济复苏不及预期，一方面进出口数据走弱，消费低于预期，显示在三年新冠疫情影响下经济修复并非一帆风顺，叠加美国及其西方盟友推动的脱钩断链都对国内经济复苏带来一定的压力；另一方面，以 ChatGPT 为代表的各种人工智能大模型的持续推进，围绕算力所带来的包括光模块、PCB、液冷等受益细分领域受到投资者的追捧，人工智能主题



投资也由早期的概念炒作转向业绩支撑，包括计算机、通信、传媒、电子在内的 TMT 板块受到了投资者的追捧，在美国出台芯片法案并裹挟日本荷兰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、材料等国产化受益细分行业国产化替代份额持续攀升，经过产业链的协同合作，半导体制造的突破预计也将迎来曙光。面对错综复杂的国内外政治经济形势，投资者普遍降低了预期，操作上采取及时获利了结的策略，市场表现上体现出行业风格轮动较快的特征。

全季度来看，上证指数震荡下跌 2.16%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数下跌 6.38%，沪深 300 指数下跌 5.15%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 5.38%，小盘股表征指数中证 1000 下跌 3.98%，微盘股指数逆市上涨 6.17%。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 7.69%，硬科技占比较高的科创板 50 下跌 7.06%。

在行业表现上，申万一级行业中表现靠前的为通信、传媒、家电，涨幅分别为 16.33%、6.34%和 5.15%，表现落后的为商贸零售、食品饮料、建筑材料，分别下跌了 19.32%、12.91%和 12.21%，细分板块上包括航海装备、通信设备、电机等细分领域领涨，涨幅超过 20%。

#### 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 2.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

面对纷繁复杂的国内外形势，尤其是弱于预期的国内经济复苏态势，我们预计下半年国内宏观流动性将保持合理充裕，各项政策将持续发力，下半年经济活动恢复有望加快，整体上有利于投资者信心的修复。随着国内大型科技公司纷纷推出大语言模型，以及行业大语言模型的纷纷落地，GPT 引燃的人工智能技术及应用的又一次科技创新浪潮有望改变并赋能千行百业，TMT 板块的投资机会有望持续并扩散到更多板块。

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，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	3,696,573,934.11	99.56
	其中：股票	3,696,573,934.11	99.56
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	15,740,820.49	0.42
7	其他各项资产	496,980.59	0.01
8	合计	3,712,811,735.19	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55,339,295.00元，占基金资产净值比例为1.49%。

### 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	632,764.98	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	30,441.28	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	53,096.16	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	14,394.48	0.00
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	741,213.05	0.02

### 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	3,695,830,880.69	99.62

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		3,695,830,880.69	99.62

### 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	11,810,605	548,012,072.00	14.77
2	600036	招商银行	14,635,962	479,474,115.12	12.92
3	601166	兴业银行	17,191,009	269,039,290.85	7.25
4	600030	中信证券	11,530,586	228,074,991.08	6.15
5	601398	工商银行	41,436,527	199,724,060.14	5.38
6	601328	交通银行	32,483,288	188,403,070.40	5.08
7	601288	农业银行	37,736,085	133,208,380.05	3.59
8	600016	民生银行	29,342,649	110,034,933.75	2.97
9	600837	海通证券	11,394,299	105,055,436.78	2.83
10	601601	中国太保	4,042,317	105,019,395.66	2.83

#### 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	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
2	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
3	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
4	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
5	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	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“民生银行”、“农业银行”、“兴业银行”、“招商银行”、“交通银行”、“海通证券”、“工商银行”、“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。

民生银行下属分支机构因间接增加小微企业融资成本；流动资金贷款管理不到位，严重违反

审慎经营规则；个人贷款业务严重违反审慎经营规则；贷前调查不尽职；贷款调查、资金支付管理、贷后管理严重不尽职，贷款形成风险，发生涉刑案件等原因，受到监管机构公开处罚。

农业银行下属分支机构因未按规定换领金融许可证；贷后管理不到位；贷前调查不尽职；收取顾问费，质价不符；以贷吸存；信贷管理不审慎，员工管理不到位；员工行为排查不到位，未发现员工异常行为；管理不善、导致金融许可证遗失；辖属金融服务点未经批准暂停营业；贷款资金被挪用；员工行为管理不到位；贷款“三查”不到位，对公信贷资金违规流入限制性领域；贷款“三查”不到位，个人信贷资金违规流入限制性领域；发放虚假二手房按揭贷款，严重违反审慎经营规则；信用卡汽车分期业务管理不审慎；服务收费质价不符；虚增存贷款；因管理不善导致许可证遗失；违反规定办理结汇业务；内控制度执行严重不到位；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，违反外汇登记管理规定等原因，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个人经营贷款挪用至房地产市场；个人经营贷款“三查”不到位；总行对分支机构管控不力承担管理责任；因管理不善导致金融许可证遗失；信贷资金违规回流借款人开立存单；不当销售；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；理财资金违规变相用于置换土地出让金；国内信用证项下福费廷转卖业务逆时序操作；违规通过保理业务向房地产项目提供融资等原因，受到监管机构公开处罚。

交通银行因违规办理虚假银行承兑汇票业务、违规办理虚假保理融资业务、销售理财及保险产品存在违规代客操作行为、发放流动资金贷款未尽贷前调查和贷后管理职责；贷款业务管理不到位，严重违反审慎经营规则；案件迟报，严重违反审慎经营规则；办理承兑汇票贴现业务贸易背景审查不严，严重违反审慎经营规则；遗失金融许可证；贷后管理不到位；国内信用证贸易背景审查不严，严重违反审慎经营规则；未按规定报送监管数据；国内信用证贸易背景审查不严，严重违反审慎经营规则；未按规定报送监管数据；流动资金贷款发放不审慎等原因，受到监管机构公开处罚。

海通证券因内部制度不完善、未依法履行职责等，受到上交所、地方证监局警示、责令改正等。

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。

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	13,124.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	443,046.03
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	40,810.12
9	合计	496,980.59

### 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	600016	民生银行	4,483,500.00	0.12	转融通证券 出借业务的 股票
2	601601	中国太保	3,234,510.00	0.09	转融通证券 出借业务的 股票
3	601288	农业银行	1,590,971.00	0.04	转融通证券 出借业务的 股票
4	600036	招商银行	1,090,908.00	0.03	转融通证券 出借业务的 股票



5	601318	中国平安	1,081,120.00	0.03	转融通证券出借业务的股票
6	601166	兴业银行	818,495.00	0.02	转融通证券出借业务的股票
7	601398	工商银行	573,098.00	0.02	转融通证券出借业务的股票
8	601328	交通银行	317,840.00	0.01	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	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定
2	688472	阿特斯	106,687.44	0.00	新股锁定
3	688469	中芯集成	74,658.00	0.00	新股锁定
4	688361	中科飞测	53,740.77	0.00	新股锁定
5	688484	南芯科技	37,003.68	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	3,636,808,035.00
报告期期间基金总申购份额	765,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	587,000,000.00
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	3,814,808,035.00

## § 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	2023年04月01日至2023年06月30日	2,563,560,500.00	-	-	2,563,560,500.00	67.20%
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 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