

# 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 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       | 国泰沪深 300 指数增强   |
| 基金主代码      | 000512  |
| 交易代码       | 000512  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019 年 4 月 2 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 94,017,840.01 份   |
| 投资目标       | 本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略       | 1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、中小企业私募债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、权证投资策略；7、股                |

|                 |  |                 |
|-----------------|--|-----------------|
|                 | 指期货投资策略；8、股票期权投资策略；9、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×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%                                 |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。 |                 |
| 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 指数增强 A  | 国泰沪深 300 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 000512   | 002063          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 87,535,195.34 份  | 6,482,644.67 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<br>(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |                 |
|----------------|---|-----------------|
|                | 国泰沪深 300 指数增强 A                         | 国泰沪深 300 指数增强 C |
| 1.本期已实现收益      | -5,417,361.37                           | -403,962.61     |
| 2.本期利润         | -5,160,290.51                           | -381,455.58     |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0594                                 | -0.0585         |
| 4.期末基金资产净值     | 98,627,826.62                           | 7,154,050.72    |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1267                                  | 1.1036          |

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 指数增强 A:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -5.04%     | 0.77%         | -4.88%         | 0.79%                 | -0.16% | -0.02% |
| 过去六个月          | -3.74%     | 0.73%         | -0.69%         | 0.80%                 | -3.05% | -0.07% |
| 过去一年           | -14.22%    | 0.84%         | -13.60%        | 0.94%                 | -0.62% | -0.10% |
| 过去三年           | 1.92%      | 1.13%         | -7.07%         | 1.14%                 | 8.99%  | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 13.55%     | 1.17%         | -2.72%         | 1.16%                 | 16.27% | 0.01%  |

##### 2、国泰沪深 300 指数增强 C:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -5.06%     | 0.76%         | -4.88%         | 0.79%                 | -0.18% | -0.03% |
| 过去六个月          | -3.78%     | 0.73%         | -0.69%         | 0.80%                 | -3.09% | -0.07% |
| 过去一年           | -14.30%    | 0.84%         | -13.60%        | 0.94%                 | -0.70% | -0.10% |
| 过去三年           | 1.60%      | 1.13%         | -7.07%         | 1.14%                 | 8.67%  | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 12.98%     | 1.17%         | -2.72%         | 1.16%                 | 15.70% | 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

国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金  
 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  
 (2019 年 4 月 2 日至 2023 年 6 月 30 日)

##### 1. 国泰沪深 300 指数增强 A:



注：本基金合同生效日为 2019 年 4 月 2 日，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 指数增强 C:



注：本基金合同生效日为 2019 年 4 月 2 日，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<br>期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|-----|--|-----------------|------|------------|---|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |            |   |
| 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 300 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 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。 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | 数、国<br>泰房<br>证房<br>地地<br>产产<br>行行<br>业业<br>指指<br>数数、<br>国国<br>泰泰<br>沪沪<br>深深<br>3300<br>增增<br>强强<br>策策<br>略略<br>EETF<br>、<br>国国<br>泰泰<br>中中<br>证证<br>11000<br>增增<br>强强<br>策策<br>略略<br>EETF<br>、<br>国国<br>泰泰<br>中中<br>证证<br>钢钢<br>铁铁<br>EETF<br>、<br>国国<br>泰泰<br>中中<br>证证<br>煤煤<br>炭炭<br>EETF<br>、<br>国国<br>泰泰<br>创创<br>业业<br>板板<br>指指<br>数数<br>(LOF<br>)的基<br>金经<br>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 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 A 类本报告期内的净值增长率为-5.04%，同期业绩比较基准收益率为



-4.88%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-5.06%，同期业绩比较基准收益率为-4.88%。

#### 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     | 96,033,508.99 | 90.29        |
|    | 其中：股票    | 96,033,508.99 | 90.29        |
| 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      | 10,155,644.13  | 9.55   |
| 7 | 其他各项资产            | 176,369.34     | 0.17   |
| 8 | 合计                | 106,365,522.46 | 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              | 1,941,125.00 | 1.84         |
| C  | 制造业              | 7,142,413.31 | 6.75         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | 2,953.20     | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 2,819.76     | 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  | 13,513.04    | 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       | -            | -            |
| 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 | 9,102,824.31 | 8.61 |
|--|----|--------------|------|

### 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              | 1,147,466.00  | 1.08         |
| C  | 制造业              | 42,664,869.14 | 40.33        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,946,080.00  | 4.68         |
| E  | 建筑业              | 2,378,599.00  | 2.25         |
| F  | 批发和零售业           | 1,014,858.00  | 0.96         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,640,954.00  | 4.39         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,864,913.46  | 3.65         |
| J  | 金融业              | 23,116,468.08 | 21.85        |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,105,271.00  | 1.99         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,051,206.00  | 0.99         |
| 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               | 86,930,684.68 | 82.18        |

### 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  | 2,840   | 4,802,440.00 | 4.54 |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 10,080  | 2,306,203.20 | 2.18 |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 39,105  | 1,814,472.00 | 1.72 |
| 4  | 600030 | 中信证券  | 89,100  | 1,762,398.00 | 1.67 |
| 5  | 601012 | 隆基绿能  | 57,960  | 1,661,713.20 | 1.57 |
| 6  | 601398 | 工商银行  | 342,800 | 1,652,296.00 | 1.56 |
| 7  | 000725 | 京东方 A | 389,300 | 1,592,237.00 | 1.51 |
| 8  | 600036 | 招商银行  | 48,183  | 1,578,475.08 | 1.49 |
| 9  | 000001 | 平安银行  | 118,200 | 1,327,386.00 | 1.25 |
| 10 | 600031 | 三一重工  | 77,200  | 1,283,836.00 | 1.21 |

### 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  | 300724 | 捷佳伟创 | 7,800   | 876,330.00 | 0.83          |
| 2  | 603688 | 石英股份 | 7,200   | 819,648.00 | 0.77          |
| 3  | 688516 | 奥特维  | 4,300   | 810,120.00 | 0.77          |
| 4  | 600583 | 海油工程 | 133,800 | 782,730.00 | 0.74          |
| 5  | 000513 | 丽珠集团 | 20,100  | 782,091.00 | 0.74          |

### 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“工商银行”、“平安银行”、“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。

平安银行下属分支机构因违规发放流动资金贷款、个人经营性贷款和个人消费揭贷款，严重违反审慎经营规则；个人汽车消费贷款首付款虚假等问题，受到银保监局罚款等处罚。

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   | 69,559.83  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 106,809.51 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 176,369.34 |

#### 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指数增强<br>A | 国泰沪深300指数增强<br>C |
|----------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 85,544,041.43    | 6,478,642.47     |
| 报告期期间基金总申购份额   | 5,915,933.09     | 1,051,341.94     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,924,779.18     | 1,047,339.74     |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                | -                |
| 本报告期末基金份额总额    | 87,535,195.34    | 6,482,644.67     |

## § 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

单位：份

|                  |           |
|------------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 85,814.81 |
| 报告期期间买入/申购总份额    | -         |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 85,814.81 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.09      |

## 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、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- 2、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- 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

### 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  
二〇二三年七月二十一日