

国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

§ 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 1 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰上证综合 ETF
场内简称	上证综指 ETF
基金主代码	510760
交易代码	510760
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 21 日
报告期末基金份额总额	314,503,665.00 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的最小化。
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、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

§ 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 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	5,899,431.78
2. 本期利润	18,915,354.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0611
4. 期末基金资产净值	323,352,103.60
5. 期末基金份额净值	1.0281

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

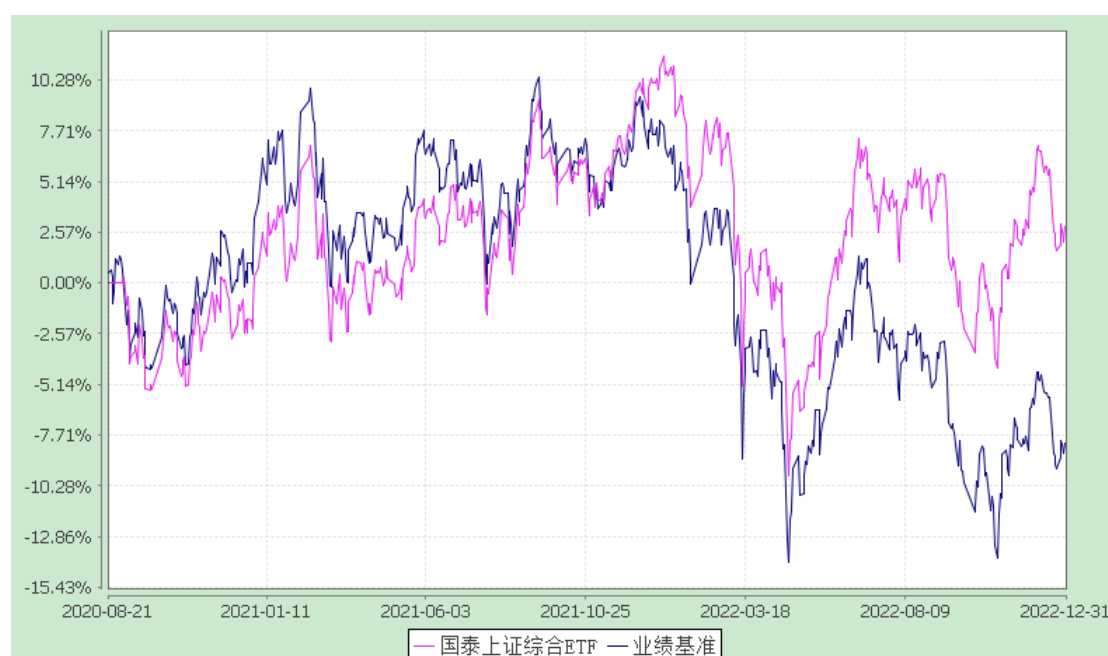
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	5.28%	0.92%	2.14%	1.00%	3.14%	-0.08%
过去六个月	-3.65%	0.89%	-9.10%	0.93%	5.45%	-0.04%
过去一年	-7.27%	1.08%	-15.13%	1.12%	7.86%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	2.81%	0.96%	-8.16%	0.99%	10.97%	-0.03%

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

国泰上证综合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

(2020 年 8 月 21 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：本基金合同生效日为2020年8月21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期限	证券从业年	说明
----	----	-------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
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、国泰中证医疗 ETF 联接、国泰中证全指软	2020-08-21	-	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

	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 的基金经理，量化投资部总监				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。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。
谢东旭	本基金的基金经理	2020-08-21	2022-12-30	12 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 月至 2022 年 12 月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 月至 2022 年 12 月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 月至 2022 年 12 月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 月至 2022 年 12 月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 月至 2022 年 12 月任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
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。

	数、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				
--	---	--	--	--	--

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

2022 年四季度上证综指先抑后扬，涨幅 2.14%。二季报我们曾经判断二季度暴涨后的科技板块三季度可能迎来调整，带来大盘的调整。三季报我们曾经判断四季度表现优于三季度，因为股市在三季度末已进入极度悲观情况。四季度的实际表现稍微弱于预期，一方面大会召开后的股市调整超出了预期，另一方面政策的转向比市场整体预期提前了好几个月，不过市场还是艰难地爬坡，上证综指在四季度获得了正收益。

上证综指 ETF 的管理运作中使用了抽样复制的方法，追求跟踪误差最小化的前提下兼顾超额收益，上证综指四季度净值涨幅 5.28%，明显跑赢标的指数和业绩基准。

作为宽基指数基金，本基金旨在为看好大盘趋势的投资者提供投资工具。本报告期内，我们根据对市场行情、日常申赎情况和成份股停复牌的分析判断，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平，尽量为投资者提供更精准的投资工具。

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 5.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年我们预计随着疫情政策的优化，第一驾马车消费即将有望迎来复苏。虽然当前很多人都还阳着或者阳后还在缓慢康复中，不过三亚、云南等热门旅游目的地，又已经人满为患了，北京又开始堵车了。我们看好 23 年消费的复苏，但也认为消费增速的反弹可能高度有限，回不到 2019 年没有疫情以前的增速。我们看好食品饮料、医药行业的反弹，不过食品饮料反弹幅度可能没有医药行业高。受疫情影响的旅游、影视等可选消费品也有望迎来复苏。汽车作为促消费的抓手，预计 2023 年也有阶段性机会。交运板块也会迎来复苏机会。

第二驾马车是投资，投资可以分为房地产、基建和固定资产投资增速。我们认为由于房地产产业链在国民经济中的重要性，2023 年我们可能还会看到房地产供给端和需求端持续松绑政策迭出，房地产、家电、建材等相关细分行业也有阶段性机会。基建在历史上和房地

产会形成跷跷板关系，因此需要密切关注房地产修复程度的进展。固定资产投资增速从 2019 年开始就是持续向上的态势，预计 2023 年国家还将加大固定资产投资增速尤其是高端制造业投资增速的力度，不过考虑到海外重要经济体的经济增速大概率下行，受到第三驾马车出口的拖累，2023 年的固定资产投资增速有可能受到扰动，因此可聚焦在关注内需的自主可控主线，芯片、信创、军工、工业母机等行业，都值得关注。碳中和主线的光伏和新能源车基本面预期仍将维持景气，但受到出口收缩影响，可能波动有所加大。

流动性方面，我们认为 2023 年应该是整体偏宽松的。首先我们没有在 2020 年疫情爆发之时像美联储那样直接将基准利率直接降为了 0，留出了操作的空间。其次，2023 年美联储加息步伐有望放缓，可能年底开始转向降息，给国内宽松留出了一定的空间。不过也需要关注 2023 年通胀变化的情况，一旦通胀起来，就会制约货币宽松的空间。

市场的风险偏好难以准确捕捉和衡量，主要受到盈利、事件和政策的影响。盈利和估值双提升和双下杀被市场称为戴维斯双击和戴维斯双杀。可预期的事件不可怕，突发事件容易对市场情绪造成影响，2022 年就出现了多个压制市场风险偏好的黑天鹅事件。目前来看 2023 年的潜在风险点可能是疫情的反复感染和通胀的爆发，不知道是否还会出现其它大的黑天鹅事件。政策的影响分为宏观政策和产业政策。比如碳中和政策、二十大发展安全可控，属于宏观政策，信创产业政策属于产业政策，在相关政策的驱动下，信创板块四季度表现出色。

因此 2023 年股市大概率优于 2022 年，各个行业和板块的投资机会也会层出不穷，轮动频繁，结构频出。可以适当地增加权益资产的配置，降低债券类资产的配置。

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	314,238,429.59	97.03
	其中：股票	314,238,429.59	97.03
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	9,450,736.73	2.92
7	其他各项资产	153,883.75	0.05
8	合计	323,843,050.07	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	135,557.24	0.04
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	—	—

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	135,557.24	0.04

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	-	-
B	采矿业	15,971,992.00	4.94
C	制造业	152,311,235.57	47.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,546,766.56	5.43
E	建筑业	4,596,924.00	1.42
F	批发和零售业	7,856,555.00	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	23,060,176.00	7.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,512,728.00	1.40
J	金融业	65,110,421.60	20.14
K	房地产业	7,495,256.00	2.32
L	租赁和商务服务业	3,073,260.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	4,751,438.02	1.47
N	水利、环境和公共设施管理业	2,910,555.60	0.90
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	4,905,564.00	1.52
S	综合	-	-

	合计	314,102,872.35	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	7,400	12,779,800.00	3.95
2	601398	工商银行	1,321,900	5,737,046.00	1.77
3	601857	中国石油	1,096,900	5,451,593.00	1.69
4	600036	招商银行	124,600	4,642,596.00	1.44
5	601628	中国人寿	120,580	4,475,929.60	1.38
6	600115	中国东航	735,500	4,067,315.00	1.26
7	601288	农业银行	1,352,300	3,935,193.00	1.22
8	601211	国泰君安	277,400	3,769,866.00	1.17
9	601138	工业富联	402,200	3,692,196.00	1.14
10	601186	中国铁建	477,500	3,691,075.00	1.14

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	688373	盟科药业	10,363	88,500.02	0.03
2	688381	帝奥微	1,239	47,057.22	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”、“国泰君安”、“农业银行”、“招商银行”、“中国人寿”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。

中国工商银行股份有限公司及下属分支机构因超过期限或未向人民银行报送账户开立、撤销等资料；存在占压财政资金行为；对外支付残缺、污损的人民币；未准确、完整、及时报送个人信用信息；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；信息安全和员工行为管理严重违反审慎经营规则；贷后管理不到位，个人经营贷款违规流入房地产市场；信用卡资金违规流入房地产市场；转嫁经营成本，费用收取不当；单位银行结算账户未按时向人民币结算账户管理系统备案；个人银行结算账户未向或未在规定时间内向账户管理系统中备案；“账户管家”产品（多层账户）中的子账户实际对外发生结算业务未经人民银行核准；“账户管家”违反金融消费者权益保护制度建设、消费者金融信息保护、金融营销宣传等相关管理规定；未按规定报送单位银行结算账户撤销等资料；未按规定履行假币收缴程序；案防管理不到位；迟报案件信息；保理融资业务管理不到位，致使信贷资金被挪用；贷款“三查”不到位，以贷收息，员工行为管理不到位；收取常年财务顾问费，质价不符；以贷收费；内控管理不到位，导致员工诈骗客户资金形成损失；向不符合放款条件的楼盘发放个人住房按揭贷款等原因，多次受到监管机构公开处罚。

国泰君安证券股份有限公司及下属分支机构因营业部负责人兼任合规风控岗；从事信息技术、合规风控的人员经办客户账户业务；部分客户开户资料存在不完整、不准确；未勤勉尽责对发行人主要客户的关联关系履行充分的核查程序并合并披露相关信息，涉诉专利涉及产品金额前后披露不一致且差异大，对发行人相关流水核查存在依赖发行人提供资料；对部分符合回访筛选标准的投顾签约投资者未进行回访；投资顾问在提供证券投资顾问服务过程中，存在通过微信及微信群向投资者发布误导性陈述的行为等原因，多次受到监管机构公开处罚。

中国农业银行股份有限公司及下属分支机构因对外支付不宜流通人民币；将经收税款转入“待结算财政款项”以外其他科目或账户；延缓、占压税款；企业流动资金贷款审批、管理规定执行不到位；个人经营性贷款管理尽职不足，信贷资金被挪用客户；信息被不当使用，侵害消费者个人信息依法得到保护的权利；违反账户管理规定；未按照规定履行客户身份识别义务；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易；违反国库科目设置和使用规定；实际承担的义务低于在营销宣传活动中通过广告、资料或者说明等形式对金融消费者所承诺的标准；未经金融消费者明示同意，收集、使用消费者金融信息；未明示收集、使用消费者金融信息的目的、方式和范围；投诉分类错误；漏报投诉数据；未及时、准确地向金融消费者披露与金融产品和服务有关的重要内容；部分单位银行结算账户撤销存在超期备案；部分单位银行结算账户撤销未经人民银行核准；虚报、瞒报金融统计资料；未按规定向人民银行报送销户资料；城市更新贷款三查不尽职，贷款资金被挪用；个人经营性贷款三查不到位，贷款资金被挪用；发放“假按揭”贷款；大额贷款未采用受托支付方式，支付不及时造成以贷转存；用贴现资金做承兑汇票保证金；违规开立银行承兑汇票；妨碍依法监督检查；管理不善导致金融许可证遗失等原因，多次受到监管机构公开处罚。

招商银行及其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，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；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，贷后管理不到位，贷款“三查”不尽职，监管标准化数据质量问题未整改到位，未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送可疑交易报告，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等原因，受到中国人民银行、银保监局、证监局公开处罚、公开批评、罚款、警告、责令改正等处罚。

中国人寿及下属分支机构因保险代理人存在给予客户保险合同以外利益行为、保单保险人信

息被篡改和违反限定范围使用客户信息、虚挂代理人业务套取手续费、内部控制管理不规范，未经监管部门批准擅自变更营业场所、未真实记录销售人员学历信息、财务数据不真实，管理不善导致许可证遗失、故意编造未曾发生的保险事故进行虚假理赔，骗取保险金、编制虚假业务资料、人身保险新型产品超犹豫期回访，保险合同超期送达，未按照规定使用经备案的保险条款，违规跨区域经营保险业务、未有效规范保险销售从业人员行为、大病保险理赔支付不及时、产品说明会管理不到位，存在销售误导行为等原因，受到银保监会、地方银保监局责令改正、警告、罚款等处罚。

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	44,802.76
2	应收证券清算款	109,080.99
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	153,883.75

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	688373	盟科药业	88,500.02	0.03	新股锁定
2	688381	帝奥微	47,057.22	0.01	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	281,503,665.00
报告期期间基金总申购份额	132,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	99,000,000.00
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	314,503,665.00

§ 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复

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

二〇二三年一月二十日