

国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	93,382,012.79 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	86,664,784.85 份	6,717,227.94 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 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	-6,182,916.85	-205,851.54
2.本期利润	3,994,436.44	381,632.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0320	0.0532
4.期末基金资产净值	101,441,749.50	7,704,880.92
5.期末基金份额净值	1.1705	1.1470

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 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	1.86%	1.06%	1.69%	1.23%	0.17%	-0.17%
过去六个月	-10.89%	0.93%	-13.00%	1.05%	2.11%	-0.12%
过去一年	-17.30%	1.13%	-20.58%	1.22%	3.28%	-0.09%
过去三年	12.30%	1.26%	-4.89%	1.24%	17.19%	0.02%
自基金合同 生效起至今	17.96%	1.21%	-2.04%	1.20%	20.00%	0.01%

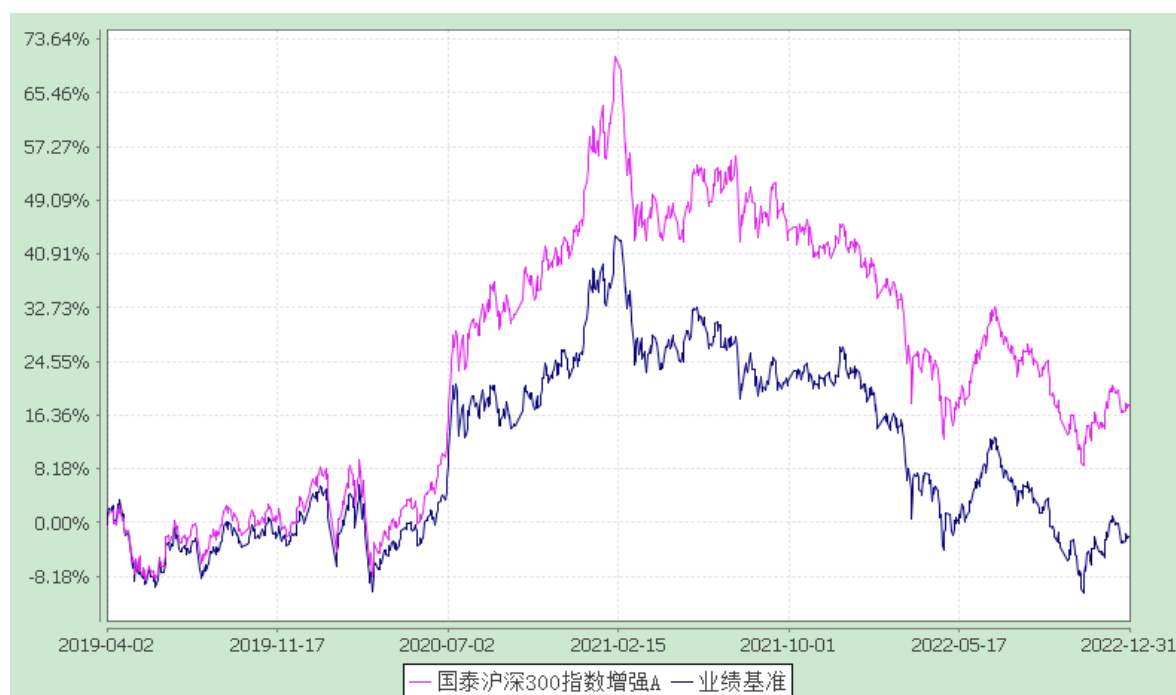
2、国泰沪深 300 指数增强 C:

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	1.83%	1.06%	1.69%	1.23%	0.14%	-0.17%
过去六个月	-10.93%	0.93%	-13.00%	1.05%	2.07%	-0.12%
过去一年	-17.38%	1.13%	-20.58%	1.22%	3.20%	-0.09%
过去三年	11.95%	1.26%	-4.89%	1.24%	16.84%	0.02%
自基金合同 生效起至今	17.42%	1.21%	-2.04%	1.20%	19.46%	0.01%

3.2.2 自基金转型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 2022 年 12 月 31 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 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢东旭	本基金的基金经理	2019-11-01	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	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。

300 指数、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

第四季度大盘整体呈现震荡走势，上证指数上涨 2.14%。大盘蓝筹指数沪深 300 上涨 1.75%，中盘成长指数中证 500 上涨 2.63%，小盘指数中证 1000 上涨 2.56%。从行业板块表现上来看，能源板块经过前三季度的上涨后出现回撤，跌幅为 11.58%，同时医疗保健板块在长时间的下跌后在第四季度迎来回暖，涨幅为 9.88%。金融，可选消费，信息技术也均有上涨，涨幅分别为 6.41%，5.21%，和 3.70%。

从国际市场来看，美国虽然明确其限制性利率政策将持续，但是加息幅度放缓。两年期国债收益率在 11 月初触及 4.7% 的局部高点之后，回落至 4.5% 以下区间。伴随加息缓解，全球重要金融资产均出现反弹。国内方面，20 大顺利召开，并提出“高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务”，12 月的中央经济工作中同时强调“加强各类政策协调配合，形成共促高质量发展合力”，相关的利好政策也提升了对应板块的投资热情。四季度疫情管控逐步放开，受到放开和过年的双重预期影响，航空，酒店，消费类板块纷纷在年尾走强。

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 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 1.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

推动高质量发展的核心依赖经济结构的转型和升级，我国当前的经济调整主要仍体现在告别房地产，拥抱制造业，因此产业政策可能在未来成为驱动结构转型升级的主线。2023 年是新的一届领导班子的开局之年，随着疫情管控的开放，以及短期的冲击过去，国内经济有望得到恢复，投资人的悲观预期也有望逐步修正。

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	98,079,623.26	89.06
	其中：股票	98,079,623.26	89.06
2	固定收益投资	5,950,173.24	5.40
	其中：债券	5,950,173.24	5.40
	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	5,507,079.78	5.00
7	其他各项资产	588,606.00	0.53
8	合计	110,125,482.28	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	421,664.00	0.39
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	25,282.63	0.02
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	446,946.63	0.41

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	5,273,778.00	4.83

C	制造业	52,807,003.39	48.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,725,279.00	2.50
E	建筑业	3,483,084.00	3.19
F	批发和零售业	322,920.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	3,129,920.00	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,484,956.94	3.19
J	金融业	23,491,606.30	21.52
K	房地产业	192,151.00	0.18
L	租赁和商务服务业	2,721,978.00	2.49
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	97,632,676.63	89.45

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	4,340	7,495,180.00	6.87
2	300750	宁德时代	11,600	4,563,672.00	4.18
3	601318	中国平安	92,005	4,324,235.00	3.96
4	601888	中国中免	12,600	2,721,978.00	2.49
5	002594	比亚迪	9,800	2,518,306.00	2.31
6	601012	隆基绿能	58,660	2,478,971.60	2.27
7	600036	招商银行	61,583	2,294,582.58	2.10

8	600809	山西汾酒	8,000	2,279,920.00	2.09
9	601328	交通银行	461,358	2,186,836.92	2.00
10	300760	迈瑞医疗	6,700	2,116,999.00	1.94

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	688428	诺诚健华	17,533	224,948.39	0.21
2	688041	海光信息	3,221	126,102.15	0.12
3	688498	源杰科技	492	55,659.96	0.05
4	301095	广立微	138	11,935.62	0.01
5	301270	汉仪股份	177	5,021.49	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,950,173.24	5.45
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,950,173.24	5.45

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例(%)
1	019679	22 国债 14	43,000	4,329,481.51	3.97
2	019638	20 国债 09	16,000	1,620,691.73	1.48

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2301	IF2301	2.00	2,331,600.00	-14,460.00	套保
公允价值变动总额合计(元)					-14,460.00
股指期货投资本期收益(元)					-102,905.40
股指期货投资本期公允价值变动(元)					153,660.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、合约选择,谨慎地进行投资,旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

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“招商银行”、“交通银行”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。

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。交通银行股份有限公司及下属分支机构因虚报金融统计资料；未按规定履行客户身份识别义务；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；案防管理不到位，发生员工诈骗案件；编制虚假财务资料；浮利分费；贷后管理不到位、贷款“三查”不尽职，贷款资金被挪用；内控制度及执行严重违反审慎经营规则；受托支付不合规；违规发放固定资产贷款，违规发放个人商用房按揭贷款；向关系人发放信用贷款；未按规定对保险代理机构从业人员进行执业登记和管理；保险代理业务档案不完整；违反规定开展互联网保险业务；违规向小微企业转嫁保险成本；信贷资金未按约定用途使用，信贷资金流入第三方存管账户；转让不良资产严重违反审慎经营规则等原因，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	316,337.90
2	应收证券清算款	100,241.71
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	172,026.39
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	588,606.00

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

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	688428	诺诚健华	224,948.39	0.21	新股锁定
2	688041	海光信息	126,102.15	0.12	新股锁定
3	688498	源杰科技	55,659.96	0.05	新股锁定
4	301095	广立微	11,935.62	0.01	新股锁定
5	301270	汉仪股份	5,021.49	0.00	新股锁定

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰沪深300指数增强A	国泰沪深300指数增强C
本报告期期初基金份额总额	136,006,858.79	5,652,020.75

报告期期间基金总申购份额	9,721,155.83	4,410,438.38
减：报告期期间基金总赎回份额	59,063,229.77	3,345,231.19
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	86,664,784.85	6,717,227.94

§ 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

项目	国泰沪深300指数增强A	国泰沪深300指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	85,814.81
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

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2022-12-16	85,814.81	100,000.00	-
合计			85,814.81	100,000.00	

注：本基金管理人于本报告期内申购本基金的适用费用为0.00元。

§ 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	2022年10月01日至2022年12月13日	53,656,616.83	-	53,656,616.83	-	-

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、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

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

二〇二三年一月二十日