

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

2022 年年度报告

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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

为了更好地满足投资者需求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2022 年 12 月 16 日起对本基金调整申购赎回替代金额处理程序，并相应修改招募说明书相关条款。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 12 月 13 日披露的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整申购赎回替代金额处理程序的公告》。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 5 月 9 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 6 |
| 2.5 信息披露方式..... | 6 |
| 2.6 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 10 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 18 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 19 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 20 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 21 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 21 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 22 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 22 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 22 |
| §5 托管人报告 | 22 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 22 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 22 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 23 |
| §6 审计报告 | 23 |
| 6.1 审计意见..... | 23 |
| 6.2 形成审计意见的基础..... | 23 |
| 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任..... | 24 |
| 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任..... | 24 |
| §7 年度财务报表 | 25 |
| 7.1 资产负债表..... | 25 |
| 7.2 利润表..... | 27 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表..... | 28 |
| 7.4 报表附注..... | 29 |
| §8 投资组合报告 | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 51 |
| 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 52 |

| | |
|---|------------|
| 8.3 期末按行业分类的权益投资组合 | 52 |
| 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 | 53 |
| 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 | 97 |
| 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 99 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 | 99 |
| 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 100 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 | 100 |
| 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 | 100 |
| 8.11 投资组合报告附注 | 100 |
| §9 基金份额持有人信息 | 101 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 101 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 101 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 102 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 102 |
| §10 开放式基金份额变动 | 102 |
| §11 重大事件揭示 | 103 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 103 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 103 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 103 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 103 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 103 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 104 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 104 |
| 11.8 其他重大事件 | 105 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 106 |
| §13 备查文件目录 | 107 |
| 13.1 备查文件目录 | 107 |
| 13.2 存放地点 | 107 |
| 13.3 查阅方式 | 107 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|--------------------------------|
| 基金名称 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) |
| 基金简称 | 国泰标普 500ETF |
| 场内简称 | 标普 500ETF |
| 基金主代码 | 159612 |
| 交易代码 | 159612 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 5 月 9 日 |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 85,898,651.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 5 月 20 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、境外市场基金投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 标普 500 指数收益率（经估值汇率调整） |
| 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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，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。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|----------------------------------|------------------------|
| 名称 | | 国泰基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 刘国华 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-31081600转 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | (021) 31089000, 400-888-8688 | 95555 |
| 传真 | | 021-31081800 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 中国(上海)自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室 | 深圳市深南大道7088号招商 银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层 | 深圳市深南大道7088号招商 银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200082 | 518040 |
| 法定代表人 | | 邱军 | 缪建民 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|------|----|---|
| 名称 | 英文 | The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited |
| | 中文 | 香港上海汇丰银行有限公司 |
| 注册地址 | | 香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦 |
| 办公地址 | | 香港九龙深旺道一号, 汇丰中心一座六楼 |
| 邮政编码 | | - |

2.5 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gtfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层及基金托管人住所或办公场所 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------------|---------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) | 上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 1,000,174.17 |
| 本期利润 | -313,759.34 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0036 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.36% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.02% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末 |
| 期末可供分配利润 | -15,592.29 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0002 |
| 期末基金资产净值 | 85,883,058.71 |
| 期末基金份额净值 | 0.9998 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | -0.02% |

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) 本基金合同生效日为 2022 年 5 月 9 日, 截止至 2022 年 12 月 31 日不满一年。

3.2 基金净值表现

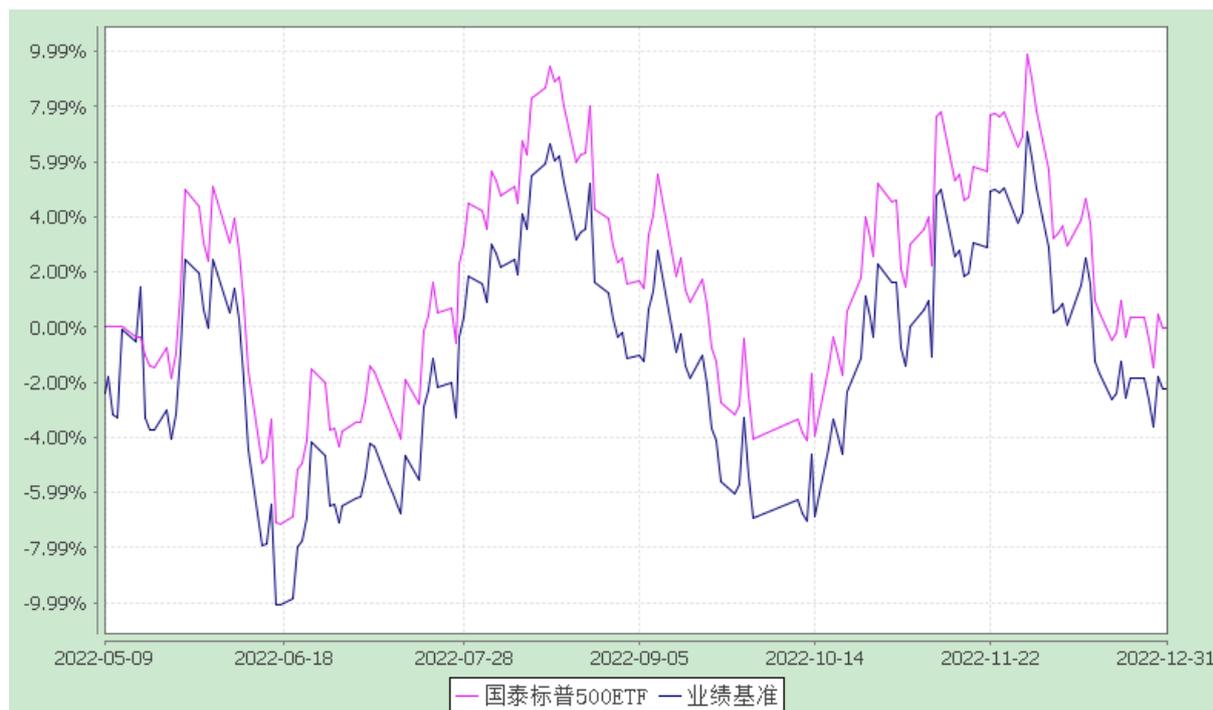
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 4.19% | 1.49% | 5.04% | 1.55% | -0.85% | -0.06% |
| 过去六个月 | 4.52% | 1.39% | 5.26% | 1.44% | -0.74% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.02% | 1.43% | -2.23% | 1.56% | 2.21% | -0.13% |

注: 同期业绩比较基准以人民币计价。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2022 年 5 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：（1）本基金的合同生效日为 2022 年 5 月 9 日，截止至 2022 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年；

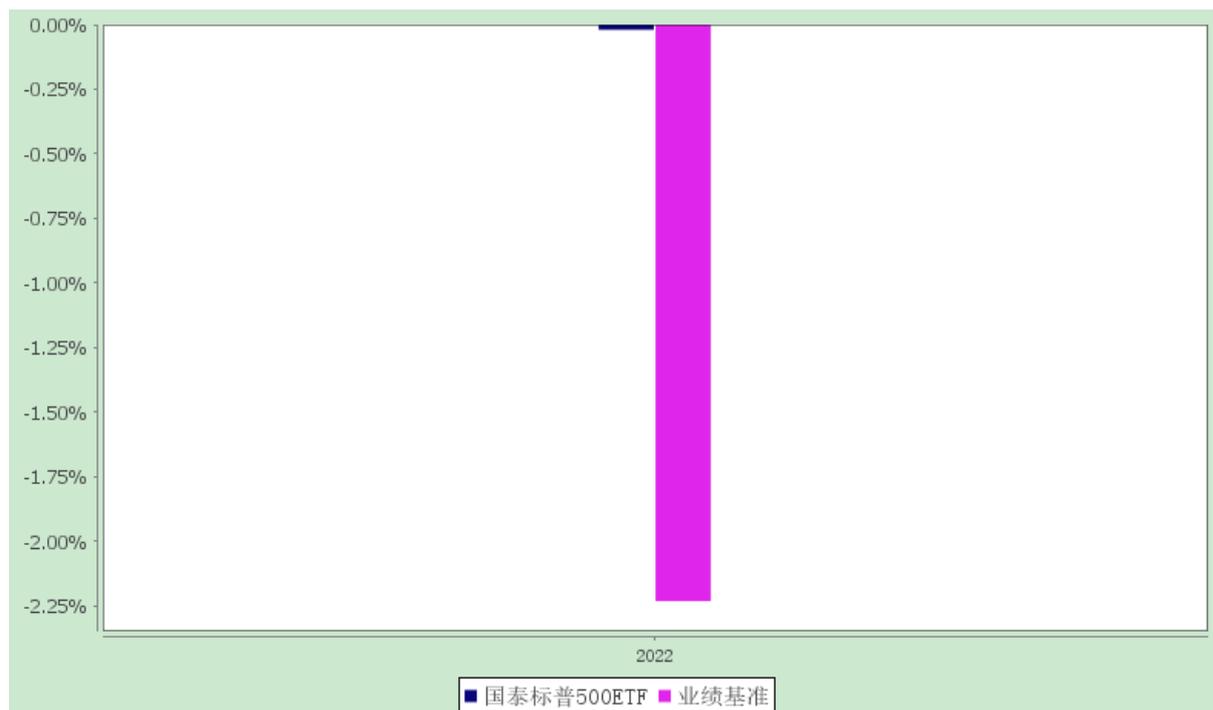
（2）本基金的建仓期为 6 个月，在建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（3）同期业绩比较基准以人民币计价。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：（1）2022 年计算期间为基金合同生效日 2022 年 5 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算。

（2）同期业绩比较基准以人民币计价。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2022 年 5 月 9 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 239 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健

回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型证券投资基金（由国泰民安增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来）、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、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）、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）、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国

泰融信灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金 (LOF)、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金 (LOF)、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)、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金 (由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来)、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金 (LOF)、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、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, 国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (由国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰金鹿混合型证券投资基金 (由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金 (由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来)、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、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转型而来)、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、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、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)、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)、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基

金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、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）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、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、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、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益混合型证券投资基金（原国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金）、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、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）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、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、国泰核心价值两年持

有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、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、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、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金、国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属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 500 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值领航股票型证券投资基金、国泰价值远见两年封闭运作混合型证券投资基金、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、国泰兴泽优选一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证光伏产业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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰惠元混合型证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰景气优选混合型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、国泰中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、国泰致和两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金、国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰睿毅三年持有期混合型证券投资基金、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金 (FOF-LOF)、国泰智享科技

1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金、国泰国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞悦 3 个月持有期债券型基金中基金 (FOF)、国泰睿鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)、国泰信瑞纯债债券型证券投资基金、国泰国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰利盈 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰鑫裕纯债债券型证券投资基金、国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰利安中短债债券型证券投资基金、国泰利享安益短债债券型证券投资基金、国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰国证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金。另外, 本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格, 目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日, 本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日, 本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务 (专户理财) 的基金公司之一, 并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者 (QDII) 资格, 囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 (助理) 期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐成城 | 国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰中证煤炭 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证细分机械设备 | 2022-05-09 | - | 17 年 | 硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金, 历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月至 2021 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 2 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 2021 年 7 月任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和国泰黄 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | <p>产业主题 ETF 联接、国泰中证有色金属 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF 联接、国泰中证光伏产业 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF 发起联接、国泰中证有色金属 ETF 发起联接、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰标普 500ETF、国泰中证有色金属矿业主题 ETF、国泰创业板指数 (LOF) 的基金经理</p> | | | <p>金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理, 2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 4 月至 2020 年 12 月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, 2020 年 1 月起兼任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 1 月至 2021 年 7 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和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的基金经理, 2020 年 2 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放</p> |
|--|---|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月任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 1 月至 2021 年 7 月任国泰国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产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 2 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证动漫游戏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 月起兼任国泰中证光</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2021 年 8 月起兼任国泰中证 800 汽车与零部件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有色金属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 10 月起兼任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月起兼任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 5 月起兼任国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理, 2022 年 10 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的基金经理, 2022 年 12 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</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所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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司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。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 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，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。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1% 数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

(二) 扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1% 数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

(三) 基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 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所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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年美股震荡下跌。一季度三大股指下挫，受 2 月俄乌冲突影响，原油等大宗商品的飙升加重美国通胀压力，流动性收缩预期发酵，所幸美股财报季维持亮眼表现，美股市场跌幅有所收窄。二季度三大股指下跌幅度加深，通胀继续冲高，美联储加快紧缩步伐，市场对美国经济即将进入衰退的担忧日渐升温，美股盈利预期也随之走弱。三季度通胀高位盘整，美联储继续追赶通胀曲线，利率的快速上升让美国火热的房地产市场明显降温，也对消费和投资产生了一定挤出效应，所幸美国就业市场仍然稳健，美股仍在下跌，但跌幅较前季度有所收窄。四季度美股呈现震荡分化走势，道琼斯指数率先反弹，但纳斯达克指数继续下跌。美国通胀高位回落，市场对紧缩路径产生乐观转向预期。

纵观全年，美股大盘指数标普 500 下跌 19%，但全年美元表现强势，人民币兑美元有所贬值，对本基金人民币计价净值有一定正面影响。

宏观经济方面，美国全年被高企的通胀所困，美联储不得不采用激进的紧缩力度对抗，从而对需求造成了一定程度的破坏。在持续加息的过程中，美国房地产等利率敏感板块的需求快速走弱，商品消费和制造业投资也已呈现疲软甚至萎缩态势。所幸美国就业市场仍然强韧，失业率维持在历史低位水平，同时居民和金融机构杠杆可控，资产负债表总体健康，在经济下行周期能提供一定缓冲。四季度以来，通胀自高位回落，市场预期美联储的货币紧缩将逐步退坡。然而，美联储对政策

转向呈谨慎态度，声明仍会在一定时间内将利率维持在限制性高位，导致美国金融条件持续紧绷，对美国经济和美国股市造成了负面压力。

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-0.02%，同期业绩比较基准收益率为-2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年一季度，我们认为需关注美联储货币政策变化、美股盈利、地缘政治等风险事项。

美国通胀数据是美联储决定货币政策的核心因素，考虑到一季度通胀数据在基数效应下有望快速回落，我们认为一季度美联储有可能继续放缓加息步伐，这对美股而言将是利好因素。但中长期维度需警惕劳动力供给持续紧张所导致的薪资-通胀螺旋，这或导致未来核心通胀难以迅速降至美联储目标的 2%，从而制约货币政策转向的速度和幅度，美股重现 2020 年 3 月深 V 反弹的可能性较低。

而地缘政治方面，来自于俄乌冲突升级、日本央行货币政策转向等潜在黑天鹅风险不容忽视，可能导致避险交易的升温，对美股形成阶段性压力，但这种压力更多体现在情绪层面。

接下来我们仍将继续利用国泰标普 500 ETF 指数基金，为投资者跟踪美股表现创造便利。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法权益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

- 1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

- 2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

- 3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进

行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 20875 号

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“国泰标普 500ETF”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国泰标普 500ETF2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰标普 500ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

国泰标普 500ETF 的基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰标普 500ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰标普 500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督国泰标普 500ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰标普 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰标普 500ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张炯 张晓阳

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|---------------------------------|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 3,133,371.84 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 83,837,669.05 |
| 其中: 股票投资 | | 80,907,218.18 |
| 基金投资 | | 2,930,450.87 |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 应收清算款 | | 6,581.55 |
| 应收股利 | | 57,070.83 |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 87,034,693.27 |
| 负债和净资产 | | |
| | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | 978,495.80 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 42,511.00 |
| 应付托管费 | | 10,627.76 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 120,000.00 |
| 负债合计 | | 1,151,634.56 |
| 净资产: | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 85,898,651.00 |
| 其他综合收益 | | - |

| | | |
|----------|---------|---------------|
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | -15,592.29 |
| 净资产合计 | | 85,883,058.71 |
| 负债和净资产总计 | | 87,034,693.27 |

注：(1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9998 元，基金份额总额 85,898,651.00 份；

(2) 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | 247,270.11 |
| 1.利息收入 | | 48,539.64 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 48,108.85 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | 430.79 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 4,387,269.61 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | 3,436,888.24 |
| 基金投资收益 | 7.4.7.11 | 216,475.13 |
| 债券投资收益 | 7.4.7.12 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.13 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.14 | 733,906.24 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.15 | -1,313,933.51 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -2,194,323.94 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -680,281.69 |
| 减：二、营业总支出 | | 561,029.45 |
| 1. 管理人报酬 | | 329,915.98 |
| 2. 托管费 | | 82,479.08 |
| 3. 销售服务费 | | - |

| | | |
|----------------------------|----------|--------------------|
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 信用减值损失 | | - |
| 7. 税金及附加 | | 794.39 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.17 | 147,840.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -313,759.34 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -313,759.34 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -313,759.34 |

注：本基金合同生效日为 2022 年 5 月 9 日，无上年度可比期间数据。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 | | |
|-------------------------------------|---|---------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 247,898,651.00 | - | 247,898,651.00 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -162,000,000.00 | -15,592.29 | -162,015,592.29 |
| （一）、综合收益总额 | - | -313,759.34 | -313,759.34 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -162,000,000.00 | 298,167.05 | -161,701,832.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 65,000,000.00 | 1,567,280.50 | 66,567,280.50 |
| 2.基金赎回款 | -227,000,000.00 | -1,269,113.45 | -228,269,113.45 |

| | | | |
|--|---------------|------------|---------------|
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 85,898,651.00 | -15,592.29 | 85,883,058.71 |

注：本基金合同生效日为 2022 年 5 月 9 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇 主管会计工作负责人：倪莹 会计机构负责人：吴洪涛

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3692 号《关于准予国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 247,885,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2022 年 5 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 247,898,651.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 13,651.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]476 号文审批同意，本基金于 2022 年 5 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记的公募基金(包括交易型开放式基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换

及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以进行境外证券借贷交易及境外正回购交易、逆回购交易。境内市场投资工具包括银行存款、债券回购、货币市场工具(含同业存单)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：标普 500 指数收益率(经估值汇率调整)。本基金的标的指数为标普 500 指数。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (以下简称“国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII)”)。国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII) 为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率（经估值汇率调整）达到 1% 以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率（经估值汇率调整）为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组

成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款 | 3,133,371.84 |
| 等于：本金 | 3,133,108.86 |
| 加：应计利息 | 262.98 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 3,133,371.84 |

注：于 2022 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 1,676,653.66 元，美元活期存款 209,160.35 元(折合人民币 1,456,718.18 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | | | |
|-------------------|-------------------------|------|---------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 82,084,798.61 | - | 80,907,218.18 | -1,177,580.43 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | 3,066,803.95 | - | 2,930,450.87 | -136,353.08 |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 85,151,602.56 | - | 83,837,669.05 | -1,313,933.51 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|
| | 应付券商交易单元保证金 |

| | |
|-----------|------------|
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 120,000.00 |
| 合计 | 120,000.00 |

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 247,898,651.00 | 247,898,651.00 |
| 本期申购 | 65,000,000.00 | 65,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -227,000,000.00 | -227,000,000.00 |
| 本期末 | 85,898,651.00 | 85,898,651.00 |

注：1. 本基金自 2022 年 4 月 18 日至 2022 年 4 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 247,885,000.00 元，折合为 247,885,000.00 基金份额。根据《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 13,651.00 元，在本基金成立后，折算为 13,651.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》、《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 招募说明书》及《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 开放日常申购与赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 5 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2022 年 5 月 20 日起开始办理。

3. 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,000,174.17 | -1,313,933.51 | -313,759.34 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,478,497.16 | -1,180,330.11 | 298,167.05 |
| 其中：基金申购款 | 1,325,547.53 | 241,732.97 | 1,567,280.50 |
| 基金赎回款 | 152,949.63 | -1,422,063.08 | -1,269,113.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,478,671.33 | -2,494,263.62 | -15,592.29 |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入 | 48,108.85 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 48,108.85 |

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 3,436,888.24 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 3,436,888.24 |

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---|
| 卖出股票成交总额 | 194,621,822.05 |
| 减：卖出股票成本总额 | 191,095,897.39 |
| 减：交易费用 | 89,036.42 |
| 买卖股票差价收入 | 3,436,888.24 |

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|
| 赎回基金份额对价总额 | 228,269,113.45 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 228,269,113.45 |
| 减：赎回股票成本总额 | - |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | - |

7.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|---|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 3,339,324.32 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 3,112,041.58 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额 | 6,619.89 |
| 减：交易费用 | 4,187.72 |
| 基金投资收益 | 216,475.13 |

7.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|--------------------------------|
| | 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 723,128.89 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 10,777.35 |
| 合计 | 733,906.24 |

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|--------------------------------|
| | 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 1.交易性金融资产 | -1,313,933.51 |
| ——股票投资 | -1,177,580.43 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | -136,353.08 |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -1,313,933.51 |

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
| | |

| | 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|---------|--------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | -680,281.69 |
| 合计 | -680,281.69 |

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|--------------------------------|
| | 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
| 审计费用 | 40,000.00 |
| 信息披露费 | 80,000.00 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 27,840.00 |
| 合计 | 147,840.00 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--|------------------|
| 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (“国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII) ”) | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |
| 国泰基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构 |
| 国泰全球投资管理有限公司 | 基金管理人的控股子公司 |
| 国泰元鑫资产管理有限公司 | 基金管理人的控股子公司 |
| 香港上海汇丰银行有限公司 (The Hongkong and | 境外资产托管人 |

| | |
|---|------------|
| Shanghai Banking Corporation Limited, “汇丰银行”) | |
| 意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.) | 基金管理人的股东 |
| 招商银行股份有限公司 (“招商银行”) | 基金托管人 |
| 中国电力财务有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国建银投资有限责任公司(“中国建投”) | 基金管理人的控股股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 329,915.98 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 82,479.08 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|-------|--------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 1,676,802.64 | 36,477.16 |
| 汇丰银行 | 1,456,569.20 | 11,631.69 |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，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。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的

银行存款存放在本基金的托管人招商银行及境外资产托管人汇丰银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以通过有资格的经纪商进行为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，持有境外基金的市值合计不得超过基金资产的 10%（持有货币市场基金可以不受前述限制），且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一只境外基金不得超过该基金总份额的 20%。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产

净值的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | |
|----------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|-------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 3,133,371.84 | - | - | - | 3,133,371.84 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 83,837,669.05 | 83,837,669.05 |
| 应收清算款 | - | - | - | 6,581.55 | 6,581.55 |
| 应收股利 | - | - | - | 57,070.83 | 57,070.83 |
| 资产总计 | 3,133,371.84 | - | - | 83,901,321.43 | 87,034,693.27 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 978,495.80 | 978,495.80 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 42,511.00 | 42,511.00 |
| 应付托管费 | - | - | - | 10,627.76 | 10,627.76 |
| 其他负债 | - | - | - | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,151,634.56 | 1,151,634.56 |
| 利率敏感度缺口 | 3,133,371.84 | - | - | 82,749,686.87 | 85,883,058.71 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | |
|----|--------------------|----|
| | 美元 折合人民币 | 合计 |
| | | |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 以外币计价的资产 | | |
| 银行存款 | 1,456,718.18 | 1,456,718.18 |
| 交易性金融资产 | 83,837,669.05 | 83,837,669.05 |
| 应收股利 | 57,070.83 | 57,070.83 |
| 应收证券清算款 | 6,581.55 | 6,581.55 |
| 资产合计 | 85,358,039.61 | 85,358,039.61 |
| 以外币计价的负债 | | |
| 负债合计 | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 85,358,039.61 | 85,358,039.61 |

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | |
|----|------------------|-------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元) |
| | | 本期末 2022年12月31日 |
| | 美元相对人民币升值 5% | 4,267,901.98 |
| | 美元相对人民币贬值 5% | -4,267,901.98 |

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险, 严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | |
|--------------|-------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 80,907,218.18 | 94.21 |
| 交易性金融资产—基金投资 | 2,930,450.87 | 3.41 |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 合计 | 83,837,669.05 | 97.62 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日, 本基金成立尚未满一年, 无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|
| 第一层次 | 83,837,669.05 |
| 第二层次 | - |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 83,837,669.05 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 66,567,280.50 元，其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 66,567,280.50 元。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|---------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 80,907,218.18 | 92.96 |
| | 其中：普通股 | 79,262,187.26 | 91.07 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | 1,645,030.92 | 1.89 |
| 2 | 基金投资 | 2,930,450.87 | 3.37 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,133,371.84 | 3.60 |
| 8 | 其他各项资产 | 63,652.38 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 87,034,693.27 | 100.00 |

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 美国 | 80,907,218.18 | 94.21 |
| 合计 | 80,907,218.18 | 94.21 |

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 信息技术 | 20,844,490.65 | 24.27 |
| 保健 | 12,882,229.70 | 15.00 |
| 金融 | 9,430,723.10 | 10.98 |
| 非必需消费品 | 8,278,830.51 | 9.64 |
| 工业 | 7,056,118.59 | 8.22 |
| 通信服务 | 5,912,560.44 | 6.88 |
| 必需消费品 | 5,614,352.53 | 6.54 |
| 能源 | 4,219,811.60 | 4.91 |
| 公用事业 | 2,406,286.21 | 2.80 |
| 材料 | 2,178,834.35 | 2.54 |
| 房地产 | 2,011,554.49 | 2.34 |
| 合计 | 80,835,792.17 | 94.12 |

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|------------|--------------|
|------|------------|--------------|

| | | |
|--------|-----------|------|
| 信息技术 | 14,505.45 | 0.02 |
| 保健 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 非必需消费品 | 56,920.56 | 0.07 |
| 工业 | - | - |
| 通信服务 | - | - |
| 必需消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 材料 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 71,426.01 | 0.08 |

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

8.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------------------------|-------------|----------|--------|----------|----------|--------------|---------------|
| 1 | APPLE INC | 苹果公司 | AAPL US | 纳斯达克 | 美国 | 5,552.00 | 5,024,062.97 | 5.85 |
| 2 | MICRO SOFT CORP | 微软公司 | MSFT US | 纳斯达克 | 美国 | 2,681.00 | 4,477,941.25 | 5.21 |
| 3 | AMAZON.COM INC | 亚马逊公司 | AMZN US | 纳斯达克 | 美国 | 3,139.00 | 1,836,397.87 | 2.14 |
| 4 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 伯克希尔哈撒韦公司 | BRK/B US | 纽约 | 美国 | 648.00 | 1,394,084.48 | 1.62 |
| 5 | ALPHABET INC-CL A | Alphabet 公司 | GOOGL US | 纳斯达克 | 美国 | 2,171.00 | 1,334,050.53 | 1.55 |
| 6 | UNITHHEALTH | 联合健康集团 | UNH US | 纽约 | 美国 | 332.00 | 1,225,907.22 | 1.43 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------------|-------------|---------|------|----|----------|--------------|------|
| | TH GROUP INC | | | | | | | |
| 7 | ALPHA BET INC-CL C | Alphabet 公司 | GOOG US | 纳斯达克 | 美国 | 1,970.00 | 1,217,398.85 | 1.42 |
| 8 | EXXON MOBIL CORP | 埃克森美孚石油公司 | XOM US | 纽约 | 美国 | 1,510.00 | 1,159,975.02 | 1.35 |
| 9 | JOHNSON & JOHNSON | 强生 | JNJ US | 纽约 | 美国 | 936.00 | 1,151,557.61 | 1.34 |
| 10 | JPMORGAN CHASE & CO | 摩根大通 | JPM US | 纽约 | 美国 | 1,049.00 | 979,716.55 | 1.14 |
| 11 | NVIDIA CORP | 英伟达 | NVDA US | 纳斯达克 | 美国 | 886.00 | 901,776.69 | 1.05 |
| 12 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 宝洁 | PG US | 纽约 | 美国 | 853.00 | 900,388.22 | 1.05 |
| 13 | CHEVRON CORP | 雪佛龙 | CVX US | 纽约 | 美国 | 682.00 | 852,551.87 | 0.99 |
| 14 | VISA INC-CLASS A SHARES | 维萨公司 | V US | 纽约 | 美国 | 588.00 | 850,815.59 | 0.99 |
| 15 | HOME DEPOT INC | 家得宝 | HD US | 纽约 | 美国 | 366.00 | 805,140.91 | 0.94 |
| 16 | TESLA INC | 特斯拉公司 | TSLA US | 纳斯达克 | 美国 | 890.00 | 763,530.49 | 0.89 |
| 17 | PFIZER INC | 辉瑞制药 | PFE US | 纽约 | 美国 | 2,065.00 | 736,928.50 | 0.86 |
| 18 | MASTERCARD INC - A | 万事达股份有限公司 | MA US | 纽约 | 美国 | 298.00 | 721,696.51 | 0.84 |
| 19 | ELI | 礼来 | LLY US | 纽约 | 美国 | 278.00 | 708,324.34 | 0.82 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------|-----------------------------|---------|------|----|----------|------------|------|
| | LILLY & CO | | | | | | | |
| 20 | ABBVIE INC | 艾伯维公司 | ABBV US | 纽约 | 美国 | 626.00 | 704,593.68 | 0.82 |
| 21 | MERCK & CO. INC. | 默克 | MRK US | 纽约 | 美国 | 899.00 | 694,677.41 | 0.81 |
| 22 | META PLATFORMS INC-CLASS A | Meta 平台股份有限公司 | META US | 纳斯达克 | 美国 | 825.00 | 691,448.97 | 0.81 |
| 23 | COCA-COLA CO/THE | 可口可乐 | KO US | 纽约 | 美国 | 1,389.00 | 615,352.29 | 0.72 |
| 24 | PEPSICO INC | 百事可乐 | PEP US | 纳斯达克 | 美国 | 485.00 | 610,238.95 | 0.71 |
| 25 | BANK OF AMERICA CORP | 美国银行公司 | BAC US | 纽约 | 美国 | 2,541.00 | 586,126.25 | 0.68 |
| 26 | BROADCOM INC | 博通股份有限公司 | AVGO US | 纳斯达克 | 美国 | 144.00 | 560,752.82 | 0.65 |
| 27 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | Thermo Fisher Scientific 公司 | TMO US | 纽约 | 美国 | 139.00 | 533,111.64 | 0.62 |
| 28 | CISCO SYSTEMS INC | 思科系统股份有限公司 | CSCO US | 纳斯达克 | 美国 | 1,507.00 | 500,012.87 | 0.58 |
| 29 | WALMART INC | 沃尔玛股份有限公司 | WMT US | 纽约 | 美国 | 501.00 | 494,742.83 | 0.58 |
| 30 | ABBOTT LABORATORIES | 雅培制药 | ABT US | 纽约 | 美国 | 626.00 | 478,666.79 | 0.56 |
| 31 | MCDONALD'S | 麦当劳 | MCD US | 纽约 | 美国 | 258.00 | 473,528.31 | 0.55 |

| | | | | | | | | |
|----|----------------------------------|----------------------|-------------|------|----|----------|------------|------|
| | CORP | | | | | | | |
| 32 | COSTCO WHOLESALE CORP | 开市客 | COST US | 纳斯达克 | 美国 | 148.00 | 470,542.31 | 0.55 |
| 33 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | Verizon 通信股份有限公司 | VZ US | 纽约 | 美国 | 1,497.00 | 410,784.64 | 0.48 |
| 34 | ACCENTURE PLC-CLASS A | 埃森哲公司 | ACN US | 纽约 | 美国 | 221.00 | 410,713.88 | 0.48 |
| 35 | DANAHER CORP | 丹纳赫 | DHR US | 纽约 | 美国 | 221.00 | 408,528.25 | 0.48 |
| 36 | LINDE PLC | 林德公共 有限公司 | LIN US | 纽约 | 美国 | 179.00 | 406,636.67 | 0.47 |
| 37 | NEXTERA ENERGY INC | 新纪元能 源公司 | NEE US | 纽约 | 美国 | 695.00 | 404,657.19 | 0.47 |
| 38 | WELLS FARGO & CO | 富国银行 | WFC US | 纽约 | 美国 | 1,389.00 | 399,432.42 | 0.47 |
| 39 | COMCAST CORP-CLASS A | 康卡斯特 公司 | CMCSA US | 纳斯达克 | 美国 | 1,611.00 | 392,362.37 | 0.46 |
| 40 | ADOBE INC | 奥多比 | ADBE US | 纳斯达克 | 美国 | 167.00 | 391,414.07 | 0.46 |
| 41 | WALT DISNEY CO/TH E | 华特迪士 尼公司 | DIS US | 纽约 | 美国 | 646.00 | 390,884.55 | 0.46 |
| 42 | PHILIP MORRIS INTERNATIO | 菲利普莫 里斯国际 集团公司 | PM US | 纽约 | 美国 | 549.00 | 386,983.05 | 0.45 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------------------|---------|------|----|----------|------------|------|
| | NAL | | | | | | | |
| 43 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 百时美施贵宝公司 | BMY US | 纽约 | 美国 | 770.00 | 385,849.29 | 0.45 |
| 44 | BOOKING HOLDINGS INC | Booking 控股股份有限公司 | BKNG US | 纳斯达克 | 美国 | 27.00 | 378,961.72 | 0.44 |
| 45 | CONOCOPHILLIPS | 康菲石油 | COP US | 纽约 | 美国 | 459.00 | 377,216.67 | 0.44 |
| 46 | TEXAS INSTRUMENTS INC | 德州仪器 | TXN US | 纳斯达克 | 美国 | 324.00 | 372,823.95 | 0.43 |
| 47 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 雷神技术公司 | RTX US | 纽约 | 美国 | 528.00 | 371,114.00 | 0.43 |
| 48 | NIKE INC -CLB | 耐克公司 | NKE US | 纽约 | 美国 | 446.00 | 363,457.82 | 0.42 |
| 49 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 霍尼韦尔 | HON US | 纳斯达克 | 美国 | 238.00 | 355,218.28 | 0.41 |
| 50 | AMGEN INC | 安进公司 | AMGN US | 纳斯达克 | 美国 | 194.00 | 354,861.41 | 0.41 |
| 51 | AT&T INC | 美国电话电报公司 | T US | 纽约 | 美国 | 2,554.00 | 327,469.50 | 0.38 |
| 52 | LOWE'S COS INC | 劳氏 | LOW US | 纽约 | 美国 | 235.00 | 326,092.32 | 0.38 |
| 53 | UNION PACIFIC CORP | 联合太平洋 | UNP US | 纽约 | 美国 | 221.00 | 318,717.30 | 0.37 |
| 54 | SALESFORCE | Salesforce 股份有 | CRM US | 纽约 | 美国 | 345.00 | 318,585.53 | 0.37 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|-------------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| | INC | 限公司 | | | | | | |
| 55 | ORACLE CORP | 甲骨文 | ORCL US | 纽约 | 美国 | 558.00 | 317,661.81 | 0.37 |
| 56 | QUALCOMM INC | 高通公司 | QCOM US | 纳斯达克 | 美国 | 412.00 | 315,463.51 | 0.37 |
| 57 | CATERPILLAR INC | 卡特彼勒 | CAT US | 纽约 | 美国 | 185.00 | 308,661.32 | 0.36 |
| 58 | SCHWAB (CHARLES) CORP | 嘉信理财 | SCHW US | 纽约 | 美国 | 531.00 | 307,912.35 | 0.36 |
| 59 | UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 联合包裹服务股份有限公司 | UPS US | 纽约 | 美国 | 254.00 | 307,524.42 | 0.36 |
| 60 | NETFLIX INC | 奈飞公司 | NFLX US | 纳斯达克 | 美国 | 148.00 | 303,950.74 | 0.35 |
| 61 | CVS HEALTH CORP | CVS 健康公司 | CVS US | 纽约 | 美国 | 468.00 | 303,746.54 | 0.35 |
| 62 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | 国际商业机器 | IBM US | 纽约 | 美国 | 309.00 | 303,203.93 | 0.35 |
| 63 | ELEVANCE HEALTH INC | Elevance 健康股份有限公司 | ELV US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 300,100.99 | 0.35 |
| 64 | MORGAN STANLEY | 摩根士丹利 | MS US | 纽约 | 美国 | 501.00 | 296,657.28 | 0.35 |
| 65 | DEERE & CO | 迪尔 | DE US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 289,655.76 | 0.34 |
| 66 | S&P GLOBAL INC | 标普全球 | SPGI US | 纽约 | 美国 | 124.00 | 289,257.67 | 0.34 |
| 67 | LOCKHEED | 洛克希德 | LMT US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 284,609.49 | 0.33 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|---------------|---------|------|----|----------|------------|------|
| | EED MARTI N CORP | 马丁 | | | | | | |
| 68 | GOLD MAN SACHS GROUP INC | 高盛 | GS US | 纽约 | 美国 | 118.00 | 282,197.51 | 0.33 |
| 69 | STARBUCKS CORP | 星巴克公司 | SBUX US | 纳斯达克 | 美国 | 402.00 | 277,737.10 | 0.32 |
| 70 | INTELCORP | 英特尔 | INTC US | 纳斯达克 | 美国 | 1,454.00 | 267,644.15 | 0.31 |
| 71 | GILEAD SCIENCES INC | 吉利德科学 | GILD US | 纳斯达克 | 美国 | 442.00 | 264,276.62 | 0.31 |
| 72 | INTUIT INC | Intuit 股份有限公司 | INTU US | 纳斯达克 | 美国 | 97.00 | 262,943.88 | 0.31 |
| 73 | ADVANCED MICRO DEVICES | AMD 公司 | AMD US | 纳斯达克 | 美国 | 578.00 | 260,734.15 | 0.30 |
| 74 | MEDTRONIC PLC | 美敦力 | MDT US | 纽约 | 美国 | 473.00 | 256,029.56 | 0.30 |
| 75 | PROLOGIS INC | 安博 | PLD US | 纽约 | 美国 | 321.00 | 252,023.31 | 0.29 |
| 76 | BLACK ROCK INC | 贝莱德有限公司 | BLK US | 纽约 | 美国 | 51.00 | 251,701.55 | 0.29 |
| 77 | CIGNACORP | 信诺集团 | CI US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 251,533.91 | 0.29 |
| 78 | BOEING CO/TH E | 波音 | BA US | 纽约 | 美国 | 185.00 | 245,437.03 | 0.29 |
| 79 | AUTOMATIC DATA PROCESSING | ADP 公司 | ADP US | 纳斯达克 | 美国 | 145.00 | 241,216.83 | 0.28 |
| 80 | AUTOZON | AutoZon | AZO US | 纽约 | 美国 | 14.00 | 240,463.40 | 0.28 |

| | | | | | | | | |
|----|------------------------------------|-------------------|---------|----------|----|--------|------------|------|
| | ONE INC | e 股份有 限公司 | | | | | | |
| 81 | TJX COMPANIES INC | TJX 公司 | TJX US | 纽约 | 美国 | 421.00 | 233,394.89 | 0.27 |
| 82 | AMERICAN TOWER CORP | 美国发射 塔公司 | AMT US | 纽约 | 美国 | 157.00 | 231,656.66 | 0.27 |
| 83 | INTUITIVE SURGICAL INC | 直觉外科 手术公司 | ISRG US | 纳斯达 克 | 美国 | 124.00 | 229,159.02 | 0.27 |
| 84 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 亿滋国际 | MDLZ US | 纳斯达 克 | 美国 | 488.00 | 226,525.01 | 0.26 |
| 85 | GENERAL ELECTRIC CO | 通用电气 | GE US | 纽约 | 美国 | 388.00 | 226,422.77 | 0.26 |
| 86 | CHUBB LTD | 邱博保险 集团 | CB US | 纽约 | 美国 | 145.00 | 222,776.66 | 0.26 |
| 87 | CITIGROUP INC | 花旗集团 | C US | 纽约 | 美国 | 703.00 | 221,451.23 | 0.26 |
| 88 | AMERICAN EXPRESS CO | 美国运通 | AXP US | 纽约 | 美国 | 214.00 | 220,210.21 | 0.26 |
| 89 | NORTHROP GRUMMAN CORP | 诺斯洛普 格鲁门公 司 | NOC US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 216,597.46 | 0.25 |
| 90 | APPLIED MATERIALS INC | 应用材料 | AMAT US | 纳斯达 克 | 美国 | 309.00 | 209,567.74 | 0.24 |
| 91 | ANALOG DEVICES CORP | 亚德诺半 | ADI US | 纳斯达 | 美国 | 181.00 | 206,775.00 | 0.24 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|---|---------|----------|----|--------|------------|------|
| | G DEVIC ES INC | 导体 | | 克 | | | | |
| 92 | REGEN ERON PHARM ACEUT ICALS | 再生元制 药股份有 限公司 | REGN US | 纳斯达 克 | 美国 | 41.00 | 206,020.46 | 0.24 |
| 93 | ALTRIA GROUP INC | 高特利 | MO US | 纽约 | 美国 | 646.00 | 205,655.31 | 0.24 |
| 94 | PAYPAL HOLDI NGS INC | Paypal 控 股股份有 限公司 | PYPL US | 纳斯达 克 | 美国 | 414.00 | 205,351.79 | 0.24 |
| 95 | MARSH & MCLEN NAN COS | Marsh & McLenna n 股份有 限公司 | MMC US | 纽约 | 美国 | 175.00 | 201,687.85 | 0.23 |
| 96 | T-MOBI LE US INC | T-Mobile US 股份 有限公司 | TMUS US | 纳斯达 克 | 美国 | 201.00 | 195,983.84 | 0.23 |
| 97 | SERVIC ENOW INC | ServiceN ow 公司 | NOW US | 纽约 | 美国 | 72.00 | 194,698.46 | 0.23 |
| 98 | STRYK ER CORP | 史赛克 | SYK US | 纽约 | 美国 | 114.00 | 194,116.36 | 0.23 |
| 99 | DUKE ENERG Y CORP | 杜克能源 | DUK US | 纽约 | 美国 | 268.00 | 192,232.15 | 0.22 |
| 100 | SOUTH ERN CO/TH E | 南方公司 | SO US | 纽约 | 美国 | 371.00 | 184,513.91 | 0.21 |
| 101 | CHIPO TLE MEXIC AN GRILL INC | Chipotle Mexican Grill 股份 有限公司 | CMG US | 纽约 | 美国 | 19.00 | 183,602.94 | 0.21 |
| 102 | SCHLU MBERG ER LTD | 斯伦贝谢 有限公司 | SLB US | 纽约 | 美国 | 493.00 | 183,557.47 | 0.21 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|-------------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| 103 | PROGRESSIVE CORP | 前进保险公司 | PGR US | 纽约 | 美国 | 201.00 | 181,579.03 | 0.21 |
| 104 | EOG RESOURCES INC | EOG 资源 | EOG US | 纽约 | 美国 | 201.00 | 181,313.05 | 0.21 |
| 105 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 福泰制药 | VRTX US | 纳斯达克 | 美国 | 87.00 | 174,977.64 | 0.20 |
| 106 | TARGET CORP | 塔吉特公司 | TGT US | 纽约 | 美国 | 167.00 | 173,346.67 | 0.20 |
| 107 | BECTON DICKINSON AND CO | 碧迪 | BDX US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 171,796.48 | 0.20 |
| 108 | HUMANA INC | Humana 股份有限公司 | HUM US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 171,225.53 | 0.20 |
| 109 | CSX CORP | CSX 公司 | CSX US | 纳斯达克 | 美国 | 792.00 | 170,884.54 | 0.20 |
| 110 | ZOETIS INC | 硕腾股份有限公司 | ZTS US | 纽约 | 美国 | 167.00 | 170,450.58 | 0.20 |
| 111 | EQUINIX INC | Equinix 有限公司 | EQIX US | 纳斯达克 | 美国 | 37.00 | 168,794.81 | 0.20 |
| 112 | 3M CO | 3M 公司 | MMM US | 纽约 | 美国 | 198.00 | 165,368.58 | 0.19 |
| 113 | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 空气产品公司 | APD US | 纽约 | 美国 | 77.00 | 165,311.88 | 0.19 |
| 114 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | O'Reilly 汽车股份有限公司 | ORLY US | 纳斯达克 | 美国 | 28.00 | 164,593.28 | 0.19 |
| 115 | MARATHON PETRO | 马拉松石油公司 | MPC US | 纽约 | 美国 | 201.00 | 162,932.57 | 0.19 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------------------|--------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| | LEUM CORP | | | | | | | |
| 116 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 波士顿科学 | BSX US | 纽约 | 美国 | 503.00 | 162,092.78 | 0.19 |
| 117 | COLGATE-PALMOLIVE CO | 高露洁棕榄 | CL US | 纽约 | 美国 | 292.00 | 160,232.32 | 0.19 |
| 118 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | PNC 财务服务 | PNC US | 纽约 | 美国 | 145.00 | 159,498.39 | 0.19 |
| 119 | AON PLC-CLASS A | 怡安集团 | AON US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 156,776.63 | 0.18 |
| 120 | EATON CORP PLC | 伊顿 | ETN US | 纽约 | 美国 | 141.00 | 154,126.25 | 0.18 |
| 121 | WASTE MANAGEMENT INC | 废品管理 | WM US | 纽约 | 美国 | 138.00 | 150,779.69 | 0.18 |
| 122 | KLA CORP | KLA 公司 | KLAC US | 纳斯达克 | 美国 | 57.00 | 149,674.20 | 0.17 |
| 123 | MCKESSON CORP | McKesson 公司 | MCK US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 148,915.96 | 0.17 |
| 124 | MODERNA INC | 莫德纳公司 | MRNA US | 纳斯达克 | 美国 | 119.00 | 148,866.79 | 0.17 |
| 125 | ILLINOIS TOOLWORKS | 伊利诺伊工具股份有限公司 | ITW US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 148,827.23 | 0.17 |
| 126 | FISERV INC | Fiserv 公司 | FISV US | 纳斯达克 | 美国 | 208.00 | 146,413.72 | 0.17 |
| 127 | ACTIVISION BLIZZA | 动视暴雪股份有限公司 | ATVI US | 纳斯达克 | 美国 | 274.00 | 146,080.40 | 0.17 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| | RD INC | | | | | | | |
| 128 | CME GROUP INC | 芝加哥商业交易所 | CME US | 纳斯达克 | 美国 | 124.00 | 145,224.72 | 0.17 |
| 129 | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 雅诗兰黛 | EL US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 145,150.90 | 0.17 |
| 130 | GENERAL DYNAMICS CORP | 通用动力 | GD US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 145,150.90 | 0.17 |
| 131 | US BANCORP | 美国合众银行 | USB US | 纽约 | 美国 | 475.00 | 144,269.95 | 0.17 |
| 132 | NORFOLK SOUTHERN CORP | 诺福克南方 | NSC US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 144,162.21 | 0.17 |
| 133 | DOLLAR GENERAL CORP | 达乐公司 | DG US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 144,062.75 | 0.17 |
| 134 | LAM RESEARCH CORP | 泛林集团 | LRCX US | 纳斯达克 | 美国 | 49.00 | 143,433.85 | 0.17 |
| 135 | TRUIST FINANCIAL CORP | Truist 金融公司 | TFC US | 纽约 | 美国 | 471.00 | 141,152.45 | 0.16 |
| 136 | METTLER-TOLDO INTERNATIONAL | 梅特勒-托利多国际股份有限公司 | MTD US | 纽约 | 美国 | 14.00 | 140,937.73 | 0.16 |
| 137 | HCA HEALTHCARE | HCA 医疗保健有限公司 | HCA US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 140,382.93 | 0.16 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|----------------|--------|------|----|--------|------------|------|
| | INC | | | | | | | |
| 138 | EMERSON ELECTRIC CO | 艾默生电气 | EMR US | 纽约 | 美国 | 208.00 | 139,156.05 | 0.16 |
| 139 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 宣伟公司 | SHW US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 138,844.32 | 0.16 |
| 140 | INTERNATIONAL EXCHANGE INC | 洲际交易所 (ICE) | ICE US | 纽约 | 美国 | 194.00 | 138,612.67 | 0.16 |
| 141 | FREEMORT-COMERAN INC | 自由港迈克墨伦股份有限公司 | FCX US | 纽约 | 美国 | 518.00 | 137,091.19 | 0.16 |
| 142 | CROWN CASTLE INC | 冠城股份有限公司 | CCI US | 纽约 | 美国 | 145.00 | 136,978.36 | 0.16 |
| 143 | MICRON TECHNOLOGY INC | 美光科技股份有限公司 | MU US | 纳斯达克 | 美国 | 391.00 | 136,103.47 | 0.16 |
| 144 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 西方石油 | OXY US | 纽约 | 美国 | 308.00 | 135,119.65 | 0.16 |
| 145 | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | Pioneer 自然资源公司 | PXD US | 纽约 | 美国 | 82.00 | 130,432.89 | 0.15 |
| 146 | AMERICAN INTERNATIONAL | 美国国际集团 | AIG US | 纽约 | 美国 | 291.00 | 128,168.42 | 0.15 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------|---------------------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| | NAL GROUP | | | | | | | |
| 147 | VALERO ENERGY CORP | Valero 能源 | VLO US | 纽约 | 美国 | 144.00 | 127,228.20 | 0.15 |
| 148 | SYNOPTICS INC | 新思科技公司 | SNPS US | 纳斯达克 | 美国 | 57.00 | 126,752.45 | 0.15 |
| 149 | METLIFE INC | 大都会集团 | MET US | 纽约 | 美国 | 249.00 | 125,503.00 | 0.15 |
| 150 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | Archer-Daniels-Midland 公司 | ADM US | 纽约 | 美国 | 194.00 | 125,452.64 | 0.15 |
| 151 | ROPER TECHNOLOGIES INC | 儒博技术公司 | ROP US | 纽约 | 美国 | 41.00 | 123,382.69 | 0.14 |
| 152 | GENERAL MILLS INC | 通用磨坊 | GIS US | 纽约 | 美国 | 211.00 | 123,220.14 | 0.14 |
| 153 | PHILLIPS 66 | Phillips 66 | PSX US | 纽约 | 美国 | 167.00 | 121,054.22 | 0.14 |
| 154 | DOMINION ENERGY INC | Dominion 能源股份有限公司 | D US | 纽约 | 美国 | 282.00 | 120,433.53 | 0.14 |
| 155 | GENERAL MOTORS CO | 通用汽车公司 | GM US | 纽约 | 美国 | 511.00 | 119,721.75 | 0.14 |
| 156 | TRANS DIGM GROUP INC | TransDigm 集团公司 | TDG US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 118,402.03 | 0.14 |
| 157 | SEMPRA ENERGY | 桑普拉能源 | SRE US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 117,317.71 | 0.14 |
| 158 | CINTAS CORP | CINTAS 公司 | CTAS US | 纳斯达克 | 美国 | 37.00 | 116,378.05 | 0.14 |
| 159 | AMERICAN ELECTRICITY | 美国电力 | AEP US | 纳斯达克 | 美国 | 174.00 | 115,064.25 | 0.13 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------------|---------------|---------|------|----|----------|------------|------|
| | CAN ELECTRIC POWER | | | 克 | | | | |
| 160 | CENTENE CORP | Centene 公司 | CNC US | 纽约 | 美国 | 201.00 | 114,804.54 | 0.13 |
| 161 | FORD MOTOR CO | 福特汽车 | F US | 纽约 | 美国 | 1,400.00 | 113,397.62 | 0.13 |
| 162 | MOODY'S CORP | 穆迪 | MCO US | 纽约 | 美国 | 58.00 | 112,547.66 | 0.13 |
| 163 | AMPHENOL CORP-CL A | 安费诺公司 | APH US | 纽约 | 美国 | 211.00 | 111,890.06 | 0.13 |
| 164 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 江森自控国际有限公司 | JCI US | 纽约 | 美国 | 251.00 | 111,879.33 | 0.13 |
| 165 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 爱德华生命科学公司 | EW US | 纽约 | 美国 | 215.00 | 111,720.19 | 0.13 |
| 166 | PUBLIC STORAGE | 公共存储公司 | PSA US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 111,230.44 | 0.13 |
| 167 | BIOGEN INC | 渤健公司 | BIIB US | 纳斯达克 | 美国 | 57.00 | 109,932.31 | 0.13 |
| 168 | TRAVELERS COS INC/THE | 旅行家集团 | TRV US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 109,686.60 | 0.13 |
| 169 | DEXCOM INC | Dexcom 股份有限公司 | DXCM US | 纳斯达克 | 美国 | 139.00 | 109,625.31 | 0.13 |
| 170 | AGILENT TECHNOLOGIES INC | 安捷伦 | A US | 纽约 | 美国 | 104.00 | 108,394.25 | 0.13 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|------------------------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| | OLOGIES INC | | | | | | | |
| 171 | KIMBERLY-CLARK CORP | 金佰利 | KMB US | 纽约 | 美国 | 114.00 | 107,780.67 | 0.13 |
| 172 | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | Charter 通信公司 | CHTR US | 纳斯达克 | 美国 | 45.00 | 106,276.31 | 0.12 |
| 173 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | 摩托罗拉解决方案股份有限公司 | MSI US | 纽约 | 美国 | 59.00 | 105,895.98 | 0.12 |
| 174 | AFLAC INC | 家庭人寿保险 | AFL US | 纽约 | 美国 | 211.00 | 105,718.03 | 0.12 |
| 175 | WW GRAINGER INC | 固安捷股份有限公司 | GWG US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 104,599.59 | 0.12 |
| 176 | L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | L3Harris Technologies 股份有限公司 | LHX US | 纽约 | 美国 | 72.00 | 104,407.15 | 0.12 |
| 177 | CORTEVA INC | 科迪华公司 | CTVA US | 纽约 | 美国 | 254.00 | 103,982.31 | 0.12 |
| 178 | EXELON CORP | Exelon 公司 | EXC US | 纳斯达克 | 美国 | 344.00 | 103,571.40 | 0.12 |
| 179 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | Cadence 设计系统股份有限公司 | CDNS US | 纳斯达克 | 美国 | 91.00 | 101,810.19 | 0.12 |
| 180 | FEDEX CORP | 联邦快递 | FDX US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 101,326.57 | 0.12 |
| 181 | IQVIA HOLDINGS INC | 艾昆纬 | IQV US | 纽约 | 美国 | 71.00 | 101,315.36 | 0.12 |
| 182 | MSCI INC | MSCI 明晟 | MSCI US | 纽约 | 美国 | 31.00 | 100,431.41 | 0.12 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|------------|---------|------|----|--------|------------|------|
| 183 | ROSS STORE S INC | 罗斯百货股份有限公司 | ROST US | 纳斯达克 | 美国 | 124.00 | 100,239.26 | 0.12 |
| 184 | FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 繁德信息技术有限公司 | FIS US | 纽约 | 美国 | 212.00 | 100,180.20 | 0.12 |
| 185 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | 亚瑟加拉格尔有限公司 | AJG US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 98,482.93 | 0.11 |
| 186 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | 特灵科技公共有限公司 | TT US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 98,337.09 | 0.11 |
| 187 | WILLIAMS COS INC | 威廉姆斯公司 | WMB US | 纽约 | 美国 | 428.00 | 98,069.93 | 0.11 |
| 188 | NXP SEMICONDUCTORS NV | 恩智浦半导体公司 | NXPI US | 纳斯达克 | 美国 | 89.00 | 97,954.80 | 0.11 |
| 189 | AUTODESK INC | 欧特克 | ADSK US | 纳斯达克 | 美国 | 75.00 | 97,610.61 | 0.11 |
| 190 | PARKE RHANIFFIN CORP | 派克汉尼汾公司 | PH US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 97,281.53 | 0.11 |
| 191 | IDEXX LABORATORIES INC | 爱德士股份有限公司 | IDXX US | 纳斯达克 | 美国 | 34.00 | 96,603.46 | 0.11 |
| 192 | MARRIOTT INTERNATIONAL -CLA | 万豪国际 | MAR US | 纳斯达克 | 美国 | 91.00 | 94,363.30 | 0.11 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|--------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| 193 | MICRO CHIP TECHN OLOGY INC | 微芯科技 股份有限 公司 | MCHP US | 纳斯达 克 | 美国 | 192.00 | 93,938.52 | 0.11 |
| 194 | DEVON ENERG Y CORP | 戴文能源 | DVN US | 纽约 | 美国 | 219.00 | 93,817.97 | 0.11 |
| 195 | CONST ELLATI ON BRAND S INC-A | 星座品牌 股份有限 公司 | STZ US | 纽约 | 美国 | 58.00 | 93,614.67 | 0.11 |
| 196 | CAPITA L ONE FINAN CIAL CORP | 第一资本 金融 | COF US | 纽约 | 美国 | 144.00 | 93,229.81 | 0.11 |
| 197 | SYSCO CORP | Sysco 公 司 | SYU US | 纽约 | 美国 | 175.00 | 93,177.64 | 0.11 |
| 198 | NEWM ONT CORP | 纽蒙黄金 公司 | NEM US | 纽约 | 美国 | 279.00 | 91,715.42 | 0.11 |
| 199 | ALLST ATE CORP | 全州保险 公司 | ALL US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 91,606.78 | 0.11 |
| 200 | AMERI PRISE FINAN CIAL INC | 阿默普莱 斯金融公 司 | AMP US | 纽约 | 美国 | 42.00 | 91,079.84 | 0.11 |
| 201 | MONST ER BEVER AGE CORP | 怪兽饮料 公司 | MNST US | 纳斯达 克 | 美国 | 128.00 | 90,510.83 | 0.11 |
| 202 | XCEL ENERG Y INC | Xcel 能 源 | XEL US | 纳斯达 克 | 美国 | 185.00 | 90,333.30 | 0.11 |
| 203 | HESS CORP | 赫斯公司 | HES US | 纽约 | 美国 | 91.00 | 89,882.48 | 0.10 |
| 204 | DOW INC | 陶氏公司 | DOW US | 纽约 | 美国 | 256.00 | 89,842.23 | 0.10 |
| 205 | PRUDE NTIAL | 保德信金 融集团 | PRU US | 纽约 | 美国 | 129.00 | 89,358.19 | 0.10 |

| | | | | | | | | |
|-----|---------------------------------------|-------------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| | FINAN CIAL INC | | | | | | | |
| 206 | SIMON PROPE RTY GROUP INC | 西蒙房地 产集团公 司 | SPG US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 89,183.93 | 0.10 |
| 207 | ENPHA SE ENERG Y INC | Enphase 能源股份 有限公司 | ENPH US | 纳斯达 克 | 美国 | 48.00 | 88,576.34 | 0.10 |
| 208 | YUM! BRAND S INC | 百胜餐饮 集团 | YUM US | 纽约 | 美国 | 99.00 | 88,310.57 | 0.10 |
| 209 | ULTA BEAUT Y INC | Ulta 美容 产品公司 | ULTA US | 纳斯达 克 | 美国 | 27.00 | 88,205.89 | 0.10 |
| 210 | PAYCH EX INC | Paychex 公司 | PAYX US | 纳斯达 克 | 美国 | 109.00 | 87,726.38 | 0.10 |
| 211 | TE CONNE CTIVIT Y LTD | 泰科电子 公司 | TEL US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 87,149.43 | 0.10 |
| 212 | HERSH EY CO/TH E | 好时公司 | HSY US | 纽约 | 美国 | 54.00 | 87,090.79 | 0.10 |
| 213 | KINDE R MORG AN INC | 特拉华州 金德摩根 公司 | KMI US | 纽约 | 美国 | 689.00 | 86,758.86 | 0.10 |
| 214 | CUMMI NS INC | 康明斯 | CMI US | 纽约 | 美国 | 51.00 | 86,060.10 | 0.10 |
| 215 | REALT Y INCOM E CORP | Realty Income 公司 | O US | 纽约 | 美国 | 194.00 | 85,702.33 | 0.10 |
| 216 | DUPON T DE NEMO URS INC | 杜邦公司 | DD US | 纽约 | 美国 | 179.00 | 85,558.51 | 0.10 |
| 217 | HALLI BURTO | 哈利伯顿 | HAL US | 纽约 | 美国 | 311.00 | 85,231.73 | 0.10 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|----------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| | N CO | | | | | | | |
| 218 | ECOLA B INC | 艺康集团 | ECL US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 85,156.44 | 0.10 |
| 219 | CARRI ER GLOBA L CORP | 开利全球 公司 | CARR US | 纽约 | 美国 | 294.00 | 84,463.19 | 0.10 |
| 220 | ELECT RONIC ARTS INC | 电子艺界 | EA US | 纳斯达 克 | 美国 | 97.00 | 82,540.68 | 0.10 |
| 221 | CONSO LIDATE D EDISO N INC | 联合爱迪 生 | ED US | 纽约 | 美国 | 124.00 | 82,310.71 | 0.10 |
| 222 | SBA COMM UNICA TIONS CORP | SBA 通 信公司 | SBAC US | 纳斯达 克 | 美国 | 42.00 | 81,994.38 | 0.10 |
| 223 | WILLIS TOWER S WATSO N PLC | 韦莱韬睿 惠悦公共 有限公司 | WTW US | 纳斯达 克 | 美国 | 48.00 | 81,763.29 | 0.10 |
| 224 | AMETE K INC | 阿美特克 股份有限 公司 | AME US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 81,739.89 | 0.10 |
| 225 | NUCOR CORP | 纽柯公司 | NUE US | 纽约 | 美国 | 89.00 | 81,702.35 | 0.10 |
| 226 | BANK OF NEW YORK MELLO N CORP | 纽约梅隆 银行股份 有限公司 | BK US | 纽约 | 美国 | 256.00 | 81,159.32 | 0.09 |
| 227 | ROCK WELL AUTO MATIO N INC | 罗克韦尔 自动化 | ROK US | 纽约 | 美国 | 45.00 | 80,724.24 | 0.09 |
| 228 | PACCA R INC | 帕卡 | PCAR US | 纳斯达 克 | 美国 | 117.00 | 80,646.52 | 0.09 |
| 229 | ILLUMI | Illumina | ILMN US | 纳斯达 | 美国 | 57.00 | 80,269.80 | 0.09 |

| | NA INC | 公司 | | 克 | | | | |
|-----|---------------------------------------|----------------------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 230 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 希尔顿全球控股股份有限公司 | HLT US | 纽约 | 美国 | 91.00 | 80,084.26 | 0.09 |
| 231 | FORTINET INC | Fortinet 股份有限公司 | FTNT US | 纳斯达克 | 美国 | 235.00 | 80,017.33 | 0.09 |
| 232 | OTIS WORLDWIDE CORP | 奥的斯电梯公司 | OTIS US | 纽约 | 美国 | 145.00 | 79,082.68 | 0.09 |
| 233 | RESMED INC | 瑞思迈股份有限公司 | RMD US | 纽约 | 美国 | 54.00 | 78,275.28 | 0.09 |
| 234 | KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 是德科技公司 | KEYS US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 77,443.22 | 0.09 |
| 235 | DOLLAR TREE INC | 美元树公司 | DLTR US | 纳斯达克 | 美国 | 78.00 | 76,835.70 | 0.09 |
| 236 | TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | Teledyne 科技股份有限公司 | TDY US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 75,200.76 | 0.09 |
| 237 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 公共服务企业集团 | PEG US | 纽约 | 美国 | 175.00 | 74,676.18 | 0.09 |
| 238 | PPG INDUSTRIES INC | PPG 工业 | PPG US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 73,561.22 | 0.09 |
| 239 | OLD DOMINION FREIGHT HT | Old Dominion Freight Line 股份有限公司 | ODFL US | 纳斯达克 | 美国 | 37.00 | 73,127.32 | 0.09 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------------|----------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | LINE | | | | | | | |
| 240 | GARTNER INC | Gartner 公司 | IT US | 纽约 | 美国 | 31.00 | 72,573.50 | 0.08 |
| 241 | COGNIZANT TECHNOLOGICAL SOLUTIONS-A | 高知特科技公司 | CTSH US | 纳斯达克 | 美国 | 181.00 | 72,093.29 | 0.08 |
| 242 | KROGER CO | 克罗格公司 | KR US | 纽约 | 美国 | 232.00 | 72,031.79 | 0.08 |
| 243 | UNITED RENTALS INC | 联合租赁公司 | URI US | 纽约 | 美国 | 29.00 | 71,785.39 | 0.08 |
| 244 | KRAFT HEINZ CO/THE | 卡夫亨氏公司 | KHC US | 纳斯达克 | 美国 | 252.00 | 71,449.27 | 0.08 |
| 245 | VERISK ANALYTICS INC | Verisk 分析公司 | VRSK US | 纳斯达克 | 美国 | 58.00 | 71,264.29 | 0.08 |
| 246 | WEC ENERGY GROUP INC | WEC 能源集团股份有限公司 | WEC US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 71,177.10 | 0.08 |
| 247 | HP INC | 惠普 | HPQ US | 纽约 | 美国 | 379.00 | 70,925.61 | 0.08 |
| 248 | TRACTOR SUPPLY COMPANY | 拖拉机供应公司 | TSCO US | 纳斯达克 | 美国 | 45.00 | 70,507.17 | 0.08 |
| 249 | ONEOK INC | Oneok 股份有限公司 | OKE US | 纽约 | 美国 | 152.00 | 69,551.28 | 0.08 |
| 250 | AMERICAN WATERWORKS CO INC | 美国自来水股份有限公司 | AWK US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 69,000.38 | 0.08 |
| 251 | ALBEMARLE | 雅保公司 | ALB US | 纽约 | 美国 | 45.00 | 67,965.44 | 0.08 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|-----------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | CORP | | | | | | | |
| 252 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 数字房地产信托有限公司 | DLR US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 67,739.02 | 0.08 |
| 253 | DR HORTON INC | 霍顿房屋公司 | DHI US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 67,669.86 | 0.08 |
| 254 | STATE STREET CORP | 道富集团 | STT US | 纽约 | 美国 | 125.00 | 67,530.50 | 0.08 |
| 255 | REPUBLIC SERVICES INC | 公共服务公司 | RSG US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 67,377.28 | 0.08 |
| 256 | EVERSOURCE ENERGY | Eversource 能源公司 | ES US | 纽约 | 美国 | 115.00 | 67,149.89 | 0.08 |
| 257 | GLOBAL PAYMENTS INC | 环汇有限公司 | GPN US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 67,097.23 | 0.08 |
| 258 | WATERS CORP | 沃特世公司 | WAT US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 66,806.11 | 0.08 |
| 259 | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 捷迈邦美控股股份有限公司 | ZBH US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 66,598.99 | 0.08 |
| 260 | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 芯源系统有限公司 | MPWR US | 纳斯达克 | 美国 | 27.00 | 66,494.31 | 0.08 |
| 261 | WELLTOWER INC | Welltower Inc | WELL US | 纽约 | 美国 | 145.00 | 66,196.78 | 0.08 |
| 262 | DISCOVER | Discover 金融服务 | DFS US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 66,090.64 | 0.08 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|------------------------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| | FINAN CIAL SERVIC ES | 公司 | | | | | | |
| 263 | ARISTA NETW ORKS INC | Arista 网 络股份有 限公司 | ANET US | 纽约 | 美国 | 78.00 | 65,922.03 | 0.08 |
| 264 | MARTI N MARIE TTA MATER IALS | Martin Marietta 材料股份 有限公司 | MLM US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 65,907.12 | 0.08 |
| 265 | AMERI SOURC EBERG EN CORP | 美源伯根 | ABC US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 65,783.92 | 0.08 |
| 266 | M & T BANK CORP | M&T 银 行 | MTB US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 65,668.52 | 0.08 |
| 267 | WALGR EENS BOOTS ALLIA NCE INC | 沃博联股 份有限公 司 | WBA US | 纳斯达 克 | 美国 | 252.00 | 65,569.76 | 0.08 |
| 268 | CONST ELLATI ON ENERG Y | 美国联合 能源公司 | CEG US | 纳斯达 克 | 美国 | 109.00 | 65,445.58 | 0.08 |
| 269 | FASTE NAL CO | 法思诺公 司 | FAST US | 纳斯达 克 | 美国 | 198.00 | 65,253.84 | 0.08 |
| 270 | BAKER HUGHE S CO | 贝克休斯 公司 | BKR US | 纳斯达 克 | 美国 | 316.00 | 64,990.03 | 0.08 |
| 271 | EQUIF AX INC | Equifax 股份有限 公司 | EFX US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 64,974.70 | 0.08 |
| 272 | COPAR T INC | Copart 股 份有限公 司 | CPRT US | 纳斯达 克 | 美国 | 152.00 | 64,459.32 | 0.08 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|-------------------------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 273 | T ROWE PRICE GROUP INC | 普徠仕 | TROW US | 纳斯达克 | 美国 | 84.00 | 63,802.98 | 0.07 |
| 274 | INTL FLAVO RS & FRAGR ANCES | 国际香料 | IFF US | 纽约 | 美国 | 87.00 | 63,524.67 | 0.07 |
| 275 | ANSYS INC | ANSYS 股份有限 公司 | ANSS US | 纳斯达克 | 美国 | 37.00 | 62,255.38 | 0.07 |
| 276 | COOPE R COS INC/TH E | 库柏股份 有限公司 | COO US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 62,180.58 | 0.07 |
| 277 | EBAY INC | eBay 公 司 | EBAY US | 纳斯达克 | 美国 | 215.00 | 62,096.72 | 0.07 |
| 278 | MOLIN A HEALT HCARE INC | Molina Healthcar e 股份有 限公司 | MOH US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 62,095.96 | 0.07 |
| 279 | GENUI NE PARTS CO | 原配部件 | GPC US | 纽约 | 美国 | 51.00 | 61,629.82 | 0.07 |
| 280 | EPAM SYSTE MS INC | EPAM 系统公司 | EPAM US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 61,629.61 | 0.07 |
| 281 | FACTS ET RESEA RCH SYSTE MS INC | FactSet 研究系统 股份有限 公司 | FDS US | 纽约 | 美国 | 22.00 | 61,473.88 | 0.07 |
| 282 | BAXTE R INTER NATIO NAL INC | 百特 | BAX US | 纽约 | 美国 | 172.00 | 61,057.53 | 0.07 |
| 283 | LABOR ATORY | 美国实验 控股 | LH US | 纽约 | 美国 | 37.00 | 60,680.89 | 0.07 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|----------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | CRP OF AMER HLDGS | | | | | | | |
| 284 | TYLER TECHNOLOGIES INC | Tyler 科技公司 | TYL US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 60,627.33 | 0.07 |
| 285 | HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 哈特福德金融服务 | HIG US | 纽约 | 美国 | 114.00 | 60,206.32 | 0.07 |
| 286 | CBRE GROUP INC - A | 世邦魏理仕 | CBRE US | 纽约 | 美国 | 112.00 | 60,031.51 | 0.07 |
| 287 | CDW CORP/DE | 特拉华 CDW 公司 | CDW US | 纳斯达克 | 美国 | 48.00 | 59,699.44 | 0.07 |
| 288 | DIAMONDBACK ENERGY INC | Diamondback 能源股份有限公司 | FANG US | 纳斯达克 | 美国 | 62.00 | 59,062.32 | 0.07 |
| 289 | VULCAN MATERIALS CO | Vulcan 材料 | VMC US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 58,539.41 | 0.07 |
| 290 | EDISON INTERNATIONAL | 爱迪生国际 | EIX US | 纽约 | 美国 | 132.00 | 58,487.60 | 0.07 |
| 291 | PAYCOM SOFTWARE INC | Paycom 软件股份有限公司 | PAYC US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 58,352.00 | 0.07 |
| 292 | DTE ENERGY COMPANY | DTE 能源 | DTE US | 纽约 | 美国 | 71.00 | 58,117.01 | 0.07 |
| 293 | APTIV | Aptiv 公 | APTV US | 纽约 | 美国 | 89.00 | 57,726.57 | 0.07 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|--------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | PLC | 共有限公司 | | | | | | |
| 294 | FIRSTENERGY CORP | 第一能源 | FE US | 纽约 | 美国 | 197.00 | 57,542.78 | 0.07 |
| 295 | CORNING INC | 康宁公司 | GLW US | 纽约 | 美国 | 258.00 | 57,391.93 | 0.07 |
| 296 | ENTERGY CORP | Entergy 公司 | ETR US | 纽约 | 美国 | 72.00 | 56,413.26 | 0.07 |
| 297 | NASDAQ INC | 纳斯达克股份有限公司 | NDAQ US | 纳斯达克 | 美国 | 132.00 | 56,400.72 | 0.07 |
| 298 | LENNAR CORP-A | Lennar 公司 | LEN US | 纽约 | 美国 | 89.00 | 56,096.37 | 0.07 |
| 299 | WEYERHAEUSER CO | 惠好 | WY US | 纽约 | 美国 | 258.00 | 55,702.87 | 0.06 |
| 300 | FORTIVE CORP | 福迪威公司 | FTV US | 纽约 | 美国 | 124.00 | 55,486.97 | 0.06 |
| 301 | FIRST REPUBLIC BANK/CA | 第一共和银行/加州旧金山 | FRC US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 55,179.48 | 0.06 |
| 302 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | AvalonBay 社区股份有限公司 | AVB US | 纽约 | 美国 | 49.00 | 55,121.19 | 0.06 |
| 303 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 亚历山大房地产股份有限公司 | ARE US | 纽约 | 美国 | 54.00 | 54,784.80 | 0.06 |
| 304 | FIFTH THIRD BANCO RP | 五三银行 | FITB US | 纳斯达克 | 美国 | 238.00 | 54,385.03 | 0.06 |
| 305 | VERISIGN INC | 威瑞信股份有限公司 | VRSN US | 纳斯达克 | 美国 | 38.00 | 54,370.68 | 0.06 |
| 306 | AMERE | Ameren | AEE US | 纽约 | 美国 | 87.00 | 53,878.42 | 0.06 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|------------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | N CORPO RATIO N | 公司 | | | | | | |
| 307 | SOLAR EDGE TECHN OLOGIE S INC | SolarEdge 科技股份有限公司 | SEDG US | 纳斯达克 | 美国 | 27.00 | 53,267.28 | 0.06 |
| 308 | PPL CORP | PPL 公司 | PPL US | 纽约 | 美国 | 261.00 | 53,114.96 | 0.06 |
| 309 | DOMIN O'S PIZZA INC | 达美乐披萨公司 | DPZ US | 纽约 | 美国 | 22.00 | 53,075.82 | 0.06 |
| 310 | STERIS PLC | 思泰瑞医疗公共有限公司 | STE US | 纽约 | 美国 | 41.00 | 52,737.97 | 0.06 |
| 311 | BIO-TE CHNE CORP | Bio-techn e 公司 | TECH US | 纳斯达克 | 美国 | 91.00 | 52,527.57 | 0.06 |
| 312 | INGER SOLL-R AND INC | 英格索兰股份有限公司 | IR US | 纽约 | 美国 | 144.00 | 52,401.65 | 0.06 |
| 313 | WARNE R BROS DISCO VERY INC | 华纳兄弟探索公司 | WBD US | 纳斯达克 | 美国 | 790.00 | 52,159.28 | 0.06 |
| 314 | MARAT HON OIL CORP | Marathon 石油公司 | MRO US | 纽约 | 美国 | 274.00 | 51,657.69 | 0.06 |
| 315 | LYOND ELLBA SELL INDU-C LA | 利安德巴塞爾工业公司 | LYB US | 纽约 | 美国 | 89.00 | 51,466.10 | 0.06 |
| 316 | RAYM OND JAMES FINAN CIAL INC | Raymond James 金融股份有限公司 | RJF US | 纽约 | 美国 | 69.00 | 51,347.56 | 0.06 |

| | | | | | | | | |
|-----|----------------------------|--|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 317 | DOVER CORP | 都福 | DOV US | 纽约 | 美国 | 54.00 | 50,926.13 | 0.06 |
| 318 | DELTA AIR LINES INC | 达美航空有限公司 | DAL US | 纽约 | 美国 | 222.00 | 50,806.20 | 0.06 |
| 319 | EVEREST RE GROUP LTD | 安富来集团有限公司 | RE US | 纽约 | 美国 | 22.00 | 50,757.59 | 0.06 |
| 320 | QUANTA SERVICES INC | Quanta 服务股份有限公司 | PWR US | 纽约 | 美国 | 51.00 | 50,615.23 | 0.06 |
| 321 | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 慧与 | HPE US | 纽约 | 美国 | 455.00 | 50,575.53 | 0.06 |
| 322 | POOL CORP | Pool 公司 | POOL US | 纳斯达克 | 美国 | 24.00 | 50,534.58 | 0.06 |
| 323 | XYLEM INC | 赛莱默公司 | XYL US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 50,054.93 | 0.06 |
| 324 | HUNTINGTON BANCSHARES INC | 杭庭顿银行 | HBAN US | 纳斯达克 | 美国 | 508.00 | 49,886.04 | 0.06 |
| 325 | REGIONS FINANCIAL CORP | 地区金融公司 | RF US | 纽约 | 美国 | 332.00 | 49,852.05 | 0.06 |
| 326 | EXTRASPACE STORAGE INC | Extra Space Storage 有限公司 | EXR US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 49,202.39 | 0.06 |
| 327 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | Mid-America Apartment Communities 股份有限公司 | MAA US | 纽约 | 美国 | 45.00 | 49,201.76 | 0.06 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|--------------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 328 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 信安金融 | PFG US | 纳斯达克 | 美国 | 84.00 | 49,095.42 | 0.06 |
| 329 | QUEST DIAGNOSTICS INC | Quest Diagnostics 股份有限公司 | DGX US | 纽约 | 美国 | 45.00 | 49,029.39 | 0.06 |
| 330 | COTERRA ENERGY INC | Coterra 能源股份有限公司 | CTRA US | 纽约 | 美国 | 285.00 | 48,769.26 | 0.06 |
| 331 | CARDINAL HEALTH INC | 嘉德诺健康集团 | CAH US | 纽约 | 美国 | 91.00 | 48,718.56 | 0.06 |
| 332 | MCCORMICK & CO-NON VGTG SHRS | 味好美股份有限公司/马里兰州 | MKC US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 48,492.84 | 0.06 |
| 333 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 斑马技术公司 | ZBRA US | 纳斯达克 | 美国 | 27.00 | 48,216.41 | 0.06 |
| 334 | WABTEC CORP | 西屋制动公司 | WAB US | 纽约 | 美国 | 69.00 | 47,964.43 | 0.06 |
| 335 | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 西氏医药服务公司 | WST US | 纽约 | 美国 | 29.00 | 47,534.44 | 0.06 |
| 336 | SOUTHWEST AIRLINES CO | 西南航空 | LUV US | 纽约 | 美国 | 202.00 | 47,368.61 | 0.06 |
| 337 | EQUITY RESIDENTIAL | 公寓物业权益信托 | EQR US | 纽约 | 美国 | 115.00 | 47,254.81 | 0.06 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------|--------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 338 | CITIZENS FINANCIAL GROUP | 公民金融集团股份有限公司 | CFG US | 纽约 | 美国 | 172.00 | 47,161.76 | 0.05 |
| 339 | CHURCH & DWIGHT CO INC | 切迟杜威股份有限公司 | CHD US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 47,158.98 | 0.05 |
| 340 | TELEFLEX INC | 泰利福公司 | TFX US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 46,941.47 | 0.05 |
| 341 | CLOROX COMPANY | 高乐氏公司 | CLX US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 46,912.43 | 0.05 |
| 342 | PERKINELMER INC | 珀金埃尔默 | PKI US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 46,875.66 | 0.05 |
| 343 | JM SMUCKER CO/THE | JM 斯马克公司 | SJM US | 纽约 | 美国 | 42.00 | 46,351.64 | 0.05 |
| 344 | DARDEN RESTAURANTS INC | 达登餐饮公司 | DRI US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 46,243.83 | 0.05 |
| 345 | IDEX CORP | 艺达思集团 | IEX US | 纽约 | 美国 | 29.00 | 46,116.59 | 0.05 |
| 346 | AES CORP | 爱伊斯公司 | AES US | 纽约 | 美国 | 229.00 | 45,869.13 | 0.05 |
| 347 | CENTROPOINT ENERGY INC | 中点能源 | CNP US | 纽约 | 美国 | 219.00 | 45,742.17 | 0.05 |
| 348 | CONAGRA BRANDS INC | 康尼格拉品牌股份有限公司 | CAG US | 纽约 | 美国 | 167.00 | 45,011.51 | 0.05 |
| 349 | SVB FINANCIAL GROUP | 硅谷银行金融集团 | SIVB US | 纳斯达克 | 美国 | 28.00 | 44,879.33 | 0.05 |

| | | | | | | | | |
|-----|--------------------------------|------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | CIAL GROUP | | | | | | | |
| 350 | EXPEDITORS INTL WASHINGTON INC | 华盛顿康捷国际物流公司 | EXPD US | 纳斯达克 | 美国 | 62.00 | 44,873.20 | 0.05 |
| 351 | NORDEASTERN CORP | 诺信公司 | NDSN US | 纳斯达克 | 美国 | 27.00 | 44,701.87 | 0.05 |
| 352 | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | CF 工业控股股份有限公司 | CF US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 44,503.79 | 0.05 |
| 353 | NORTHERN TRUST CORP | 北美信托 | NTRS US | 纳斯达克 | 美国 | 72.00 | 44,373.42 | 0.05 |
| 354 | VENTAS INC | Ventas 公司 | VTR US | 纽约 | 美国 | 141.00 | 44,239.49 | 0.05 |
| 355 | TYSON FOODS INC-CLASS A | 泰森食品公司 | TSN US | 纽约 | 美国 | 102.00 | 44,221.73 | 0.05 |
| 356 | AMCOR PLC | 安姆科公司 | AMCR US | 纽约 | 美国 | 532.00 | 44,128.54 | 0.05 |
| 357 | HOLOGIC INC | 豪洛捷公司 | HOLX US | 纳斯达克 | 美国 | 84.00 | 43,765.82 | 0.05 |
| 358 | CMS ENERGY CORP | CMS 能源 | CMS US | 纽约 | 美国 | 99.00 | 43,665.74 | 0.05 |
| 359 | KELLOGG CO | 家乐氏 | K US | 纽约 | 美国 | 87.00 | 43,165.76 | 0.05 |
| 360 | SNAP-ON INC | 实耐宝 | SNA US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 42,966.22 | 0.05 |
| 361 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | MarketAxess 控股公司 | MKTX US | 纳斯达克 | 美国 | 22.00 | 42,731.86 | 0.05 |
| 362 | OMNICOM | Omnicom 集团 | OMC US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 42,607.68 | 0.05 |

| | GROUP | | | | | | | |
|-----|--|-----------------------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| 363 | ALIGN TECHN OLOGY INC | Align 科 技股份有 限公司 | ALGN US | 纳斯达 克 | 美国 | 29.00 | 42,596.19 | 0.05 |
| 364 | BROAD RIDGE FINAN CIAL SOLUTI O | 布罗德里 奇金融解 决方案股 份有限公 司 | BR US | 纽约 | 美国 | 45.00 | 42,037.28 | 0.05 |
| 365 | BEST BUY CO INC | 百思买 | BBY US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 41,897.29 | 0.05 |
| 366 | FMC CORP | FMC 公 司 | FMC US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 41,720.74 | 0.05 |
| 367 | SYNCH RONY FINAN CIAL | 同步金融 公司 | SYF US | 纽约 | 美国 | 181.00 | 41,423.07 | 0.05 |
| 368 | ESSEX PROPE RTY TRUST INC | 埃塞克斯 房地产信 托公司 | ESS US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 41,326.26 | 0.05 |
| 369 | HUNT (JB) TRANS PRT SVCS INC | JB Hunt 运输服务 股份有限 公司 | JBHT US | 纳斯达 克 | 美国 | 34.00 | 41,287.82 | 0.05 |
| 370 | BIO-RA D LABOR ATORIE S-A | 伯乐生命 医学产品 有限公司 | BIO US | 纽约 | 美国 | 14.00 | 40,999.63 | 0.05 |
| 371 | CHARL ES RIVER LABOR ATORIE S | 查理斯河 实验室国 际有限公 司 | CRL US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 40,974.83 | 0.05 |
| 372 | CINCIN NATI FINAN | 辛辛那提 金融 | CINF US | 纳斯达 克 | 美国 | 57.00 | 40,647.01 | 0.05 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--------------------------------|---------|-----------|----|--------|-----------|------|
| | CIAL CORP | | | | | | | |
| 373 | APA CORP | APA | APA US | 纳斯达克 克 | 美国 | 125.00 | 40,638.44 | 0.05 |
| 374 | JACOB S SOLUTI ONS INC | Jacobs Solutions Inc | J US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 40,139.50 | 0.05 |
| 375 | ETSY INC | Etsy 股份 有限公司 | ETSY US | 纳斯达克 克 | 美国 | 48.00 | 40,042.55 | 0.05 |
| 376 | FLEET COR TECHN OLOGI ES INC | FleetCor 技术股份 有限公司 | FLT US | 纽约 | 美国 | 31.00 | 39,656.99 | 0.05 |
| 377 | KEYCO RP | KeyCorp 公司 | KEY US | 纽约 | 美国 | 324.00 | 39,308.76 | 0.05 |
| 378 | AVERY DENNI SON CORP | 艾利丹尼 森 | AVY US | 纽约 | 美国 | 31.00 | 39,078.37 | 0.05 |
| 379 | BALL CORP | 波尔 | BALL US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 38,822.49 | 0.05 |
| 380 | MOSAI C CO/TH E | Mosaic 公司 | MOS US | 纽约 | 美国 | 127.00 | 38,803.20 | 0.05 |
| 381 | INCYT E CORP | 因赛特公 司 | INCY US | 纳斯达克 克 | 美国 | 69.00 | 38,598.37 | 0.04 |
| 382 | HUNTI NGTON INGAL LS INDUS TRIE | Huntingt on Ingalls 工业公司 | HII US | 纽约 | 美国 | 24.00 | 38,558.25 | 0.04 |
| 383 | LAS VEGAS SANDS CORP | 拉斯维加 斯金沙集 团 | LVS US | 纽约 | 美国 | 115.00 | 38,500.66 | 0.04 |
| 384 | WR BERKL EY CORP | WR Berkley 公司 | WRB US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 37,906.58 | 0.04 |
| 385 | ATMOS | Atmos 能 | ATO US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 37,465.09 | 0.04 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|----------------------------|----------|------|----|--------|-----------|------|
| | ENERGY CORP | 源公司 | | | | | | |
| 386 | TEXTRON INC | 德事隆 | TXT US | 纽约 | 美国 | 75.00 | 36,982.03 | 0.04 |
| 387 | EVERGY INC | Evergy 股份有限公司 | EVERG US | 纳斯达克 | 美国 | 84.00 | 36,815.71 | 0.04 |
| 388 | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 思佳讯解决方案公司 | SWKS US | 纳斯达克 | 美国 | 58.00 | 36,811.67 | 0.04 |
| 389 | GARMIN LTD | 佳明有限公司 | GRMN US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 36,637.49 | 0.04 |
| 390 | HOWMET AEROSPACE INC | Howmet 航空航天股份有限公司 | HWM US | 纽约 | 美国 | 132.00 | 36,230.68 | 0.04 |
| 391 | LEIDOS HOLDINGS INC | Leidos 控股公司 | LDOS US | 纽约 | 美国 | 49.00 | 35,897.71 | 0.04 |
| 392 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | Cboe 环球市场公司 | CBOE US | 美国 | 美国 | 41.00 | 35,827.78 | 0.04 |
| 393 | JACK HENRY & ASSOCIATES INC | Jack Henry & Associates 公司 | JKHY US | 纳斯达克 | 美国 | 29.00 | 35,458.45 | 0.04 |
| 394 | TERADYNE INC | 泰瑞达 | TER US | 纳斯达克 | 美国 | 58.00 | 35,284.75 | 0.04 |
| 395 | EXPEDIA GROUP INC | 亿客行集团股份有限公司 | EXPE US | 纳斯达克 | 美国 | 57.00 | 34,775.64 | 0.04 |
| 396 | IRON MOUNTAIN | 美国铁山公司 | IRM US | 纽约 | 美国 | 99.00 | 34,371.35 | 0.04 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------|----------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | INC | | | | | | | |
| 397 | PTC INC | PTC 公司 | PTC US | 纳斯达克 | 美国 | 41.00 | 34,277.25 | 0.04 |
| 398 | AKAM AI TECHNOLOGIES INC | 阿卡迈技术公司 | AKAM US | 纳斯达克 | 美国 | 58.00 | 34,052.72 | 0.04 |
| 399 | LAMB WESTON HOLDINGS INC | 蓝威斯顿控股股份有限公司 | LW US | 纽约 | 美国 | 54.00 | 33,607.26 | 0.04 |
| 400 | BROWN & BROWN INC | Brown & Brown 股份有限公司 | BRO US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 33,328.95 | 0.04 |
| 401 | INTERNATIONAL PAPER CO | 国际纸业 | IP US | 纽约 | 美国 | 138.00 | 33,283.41 | 0.04 |
| 402 | LKQ CORP | LKQ 公司 | LKQ US | 纳斯达克 | 美国 | 89.00 | 33,106.16 | 0.04 |
| 403 | PACKAGING CORP OF AMERICA | 美国包装公司 | PKG US | 纽约 | 美国 | 37.00 | 32,961.15 | 0.04 |
| 404 | VIATRIS INC | 晖致 | VTRS US | 纳斯达克 | 美国 | 425.00 | 32,944.30 | 0.04 |
| 405 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | Take-Two 互动软件股份有限公司 | TTWO US | 纳斯达克 | 美国 | 45.00 | 32,635.07 | 0.04 |
| 406 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | Healthpeak 物业股份有限公司 | PEAK US | 纽约 | 美国 | 185.00 | 32,301.47 | 0.04 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|-------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 407 | ALLIANT ENERGY CORP | Alliant 能源公司 | LNT US | 纳斯达克 | 美国 | 84.00 | 32,299.31 | 0.04 |
| 408 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | Interpublic 集团 | IPG US | 纽约 | 美国 | 139.00 | 32,246.72 | 0.04 |
| 409 | NETAPP INC | 美国网域存储技术有限公司 | NTAP US | 纳斯达克 | 美国 | 77.00 | 32,208.63 | 0.04 |
| 410 | CAMDEN PROPERTIES TRUST | Camden 房地产信托公司 | CPT US | 纽约 | 美国 | 41.00 | 31,947.18 | 0.04 |
| 411 | KIMCO REALTY CORP | Kimco Realty Corp | KIM US | 纽约 | 美国 | 214.00 | 31,567.19 | 0.04 |
| 412 | GLOBE LIFE INC | Globe Life 股份有限公司 | GL US | 纽约 | 美国 | 37.00 | 31,064.55 | 0.04 |
| 413 | HORMEL FOODS CORP | 荷美尔食品有限公司 | HRL US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 30,772.04 | 0.04 |
| 414 | C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 罗宾逊全球物流有限公司 | CHRW US | 纳斯达克 | 美国 | 48.00 | 30,608.58 | 0.04 |
| 415 | STANLEY BLACK & DECKER INC | 史丹利百得公司 | SWK US | 纽约 | 美国 | 58.00 | 30,344.48 | 0.04 |
| 416 | MGM RESORTS INTERNATIONAL | 美高梅国际酒店集团 | MGM US | 纽约 | 美国 | 129.00 | 30,124.47 | 0.04 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------|----------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| 417 | GEN DIGITAL INC | Gen Digital 股份有限公司 | GEN US | 纳斯达克 | 美国 | 201.00 | 29,999.53 | 0.03 |
| 418 | TRIMBLE INC | 天宝股份有限公司 | TRMB US | 纳斯达克 | 美国 | 85.00 | 29,931.06 | 0.03 |
| 419 | CELANESE CORP | 塞拉尼斯公司 | CE US | 纽约 | 美国 | 42.00 | 29,906.55 | 0.03 |
| 420 | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 百富门公司 | BF/B US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 29,733.27 | 0.03 |
| 421 | LOEWS CORP | 罗斯公司 | L US | 纽约 | 美国 | 71.00 | 28,843.40 | 0.03 |
| 422 | ADVANCE AUTO PARTS INC | 领先汽车配件股份有限公司 | AAP US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 28,672.14 | 0.03 |
| 423 | UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 美国联合航空控股股份有限公司 | UAL US | 纳斯达克 | 美国 | 109.00 | 28,619.63 | 0.03 |
| 424 | CAMPBELL SOUP CO | 金宝汤 | CPB US | 纽约 | 美国 | 72.00 | 28,457.36 | 0.03 |
| 425 | UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | Universal 保健服务股份有限公司 | UHS US | 纽约 | 美国 | 29.00 | 28,456.03 | 0.03 |
| 426 | HOST HOTELS & RESORTS INC | Host 酒店及度假股份有限公司 | HST US | 纳斯达克 | 美国 | 252.00 | 28,169.02 | 0.03 |
| 427 | UDR | UDR 公 | UDR US | 纽约 | 美国 | 104.00 | 28,052.85 | 0.03 |

| | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------------------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | INC | 司 | | | | | | |
| 428 | MATCH GROUP INC | Match 集团股份有限公司 | MTCH US | 纳斯达克 | 美国 | 97.00 | 28,029.24 | 0.03 |
| 429 | F5 INC | F5 股份有限公司 | FFIV US | 纳斯达克 | 美国 | 28.00 | 27,985.71 | 0.03 |
| 430 | WHIRLPOOL CORP | 惠而浦 | WHR US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 27,585.94 | 0.03 |
| 431 | MASCO CORP | 马斯可 | MAS US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 27,303.18 | 0.03 |
| 432 | HENRY SCHEIN INC | 亨利香恩公司 | HSIC US | 纳斯达克 | 美国 | 49.00 | 27,256.87 | 0.03 |
| 433 | EASTMAN CHEMICAL CO | 伊士曼化工 | EMN US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 27,225.46 | 0.03 |
| 434 | ALLEGION PLC | 安朗杰公共有限公司 | ALLE US | 纽约 | 美国 | 37.00 | 27,124.47 | 0.03 |
| 435 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 皇家加勒比国际游轮有限公司 | RCL US | 纽约 | 美国 | 78.00 | 26,852.29 | 0.03 |
| 436 | PULTE GROUP INC | Pulte 集团公司 | PHM US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 26,636.25 | 0.03 |
| 437 | NISOURCE INC | NiSource 公司 | NI US | 纽约 | 美国 | 139.00 | 26,544.74 | 0.03 |
| 438 | QORVO INC | Qorvo 股份有限公司 | QRVO US | 纳斯达克 | 美国 | 42.00 | 26,513.40 | 0.03 |
| 439 | SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | Seagate Technology 控股公共有限公司 | STX US | 纳斯达克 | 美国 | 72.00 | 26,381.35 | 0.03 |
| 440 | BATH & BODY WORKS | Bath & Body Works 股 | BBWI US | 纽约 | 美国 | 87.00 | 25,533.48 | 0.03 |

| | | | | | | | | |
|-----|---|--------------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| | WORK S INC | 份有限公司 | | | | | | |
| 441 | REGEN CY CENTE RS CORP | Regency Centers 公司 | REG US | 纳斯达 克 | 美国 | 57.00 | 24,811.39 | 0.03 |
| 442 | PARAM OUNT GLOBA L-CLAS S B | 派拉蒙全 球 | PARA US | 纳斯达 克 | 美国 | 211.00 | 24,805.68 | 0.03 |
| 443 | MOLSO N COORS BEVER AGE CO - B | 莫尔森库 尔斯饮料 公司 | TAP US | 纽约 | 美国 | 69.00 | 24,758.32 | 0.03 |
| 444 | CARM AX INC | CarMax 股份有限 公司 | KMX US | 纽约 | 美国 | 58.00 | 24,596.32 | 0.03 |
| 445 | JUNIP E NETW ORKS INC | 瞻博网络 股份有限 公司 | JNPR US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 24,262.16 | 0.03 |
| 446 | BOSTO N PROPE RTIES INC | 波士顿地 产公司 | BXP US | 纽约 | 美国 | 51.00 | 24,004.05 | 0.03 |
| 447 | PINNA CLE WEST CAPITA L | Pinnacle 西部资本 | PNW US | 纽约 | 美国 | 45.00 | 23,831.47 | 0.03 |
| 448 | WESTE RN DIGITA L CORP | 西部数据 公司 | WDC US | 纳斯达 克 | 美国 | 108.00 | 23,731.18 | 0.03 |
| 449 | TAPEST RY INC | TPR-DR S-RS | TPR US | 纽约 | 美国 | 89.00 | 23,603.87 | 0.03 |
| 450 | WYNN RESOR TS LTD | 永利渡假 村有限公 司 | WYNN US | 纳斯达 克 | 美国 | 41.00 | 23,549.19 | 0.03 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|--|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| 451 | BORG WARNE R INC | 博格华纳 股份有限 公司 | BWA US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 23,547.31 | 0.03 |
| 452 | ASSUR ANT INC | 安信龙集 团 | AIZ US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 23,516.81 | 0.03 |
| 453 | LIVE NATIO N ENTER TAINM ENT IN | Live Nation 娱 乐公司 | LYV US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 23,314.14 | 0.03 |
| 454 | FOX CORP - CLASS A | 福克斯公 司 | FOXA US | 纳斯达 克 | 美国 | 109.00 | 23,055.12 | 0.03 |
| 455 | SIGNAT URE BANK | Signature 银行/纽 约 | SBNY US | 纳斯达 克 | 美国 | 28.00 | 22,468.91 | 0.03 |
| 456 | COMER ICA INC | Comerica 公司 | CMA US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 22,348.01 | 0.03 |
| 457 | CERIDI AN HCM HOLDI NG INC | Ceridian 人力资本 管理控股 股份有限 公司 | CDAY US | 纽约 | 美国 | 49.00 | 21,892.18 | 0.03 |
| 458 | WESTR OCK CO | WestRoc k 公司 | WRK US | 纽约 | 美国 | 89.00 | 21,793.90 | 0.03 |
| 459 | CAESA RS ENTER TAINM ENT INC | 凯撒娱乐 集团 | CZR US | 纳斯达 克 | 美国 | 75.00 | 21,729.55 | 0.03 |
| 460 | ROBER T HALF INTL INC | 罗致恒富 国际公司 | RHI US | 纽约 | 美国 | 42.00 | 21,596.25 | 0.03 |
| 461 | VF CORP | VF 公司 | VFC US | 纽约 | 美国 | 109.00 | 20,959.89 | 0.02 |
| 462 | HASBR O INC | 孩之宝 | HAS US | 纳斯达 克 | 美国 | 48.00 | 20,395.69 | 0.02 |
| 463 | CATAL | 康泰伦特 | CTLT US | 纽约 | 美国 | 65.00 | 20,375.98 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|-----|--|------------------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| | ENT INC | 股份有 限公 司 | | | | | | |
| 464 | AMERI CAN AIRLIN ES GROUP INC | 美国航空 集团公 司 | AAL US | 纳斯达 克 | 美国 | 226.00 | 20,021.27 | 0.02 |
| 465 | RALPH LAURE N CORP | 拉夫劳伦 | RL US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 19,870.63 | 0.02 |
| 466 | ROLLI NS INC | Rollins 公 司 | ROL US | 纽约 | 美国 | 78.00 | 19,849.95 | 0.02 |
| 467 | SEALE D AIR CORP | 希悦尔公 司 | SEE US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 19,801.47 | 0.02 |
| 468 | FEDER AL REALT Y INVS TRUST | 联邦房地 产投资信 托公司 | FRT US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 19,703.69 | 0.02 |
| 469 | GENER AC HOLDI NGS INC | Generac 控股公 司 | GNRC US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 19,629.59 | 0.02 |
| 470 | ZIONS BANCO RP NA | 锡安银行 | ZION US | 纳斯达 克 | 美国 | 57.00 | 19,515.64 | 0.02 |
| 471 | MOHA WK INDUS TRIES INC | Mohawk 工业股份 有限公司 | MHK US | 纽约 | 美国 | 27.00 | 19,221.88 | 0.02 |
| 472 | SMITH (A.O.) CORP | AO 史密 斯公司 | AOS US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 19,135.38 | 0.02 |
| 473 | NRG ENERG Y INC | NRG 能 源股份有 限公司 | NRG US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 18,615.54 | 0.02 |
| 474 | PENTAI R PLC | Pentair 公 共有限公 司 | PNR US | 纽约 | 美国 | 58.00 | 18,169.53 | 0.02 |
| 475 | FRANK LIN | 富兰克林 资源 | BEN US | 纽约 | 美国 | 97.00 | 17,821.44 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|-----|-------------------------------|----------------|---------|------|----|--------|-----------|------|
| | RESOURCES INC | | | | | | | |
| 476 | NEWS CORP - CLASS A | 新闻集团 | NWSA US | 纳斯达克 | 美国 | 139.00 | 17,619.05 | 0.02 |
| 477 | ORGANON & CO | Organon & Co | OGN US | 纽约 | 美国 | 87.00 | 16,923.35 | 0.02 |
| 478 | DENTSPLY SIRONA INC | 登士柏西诺德公司 | XRAY US | 纳斯达克 | 美国 | 75.00 | 16,631.46 | 0.02 |
| 479 | CARNIVAL CORP | 嘉年华公司 | CCL US | 纽约 | 美国 | 282.00 | 15,829.98 | 0.02 |
| 480 | DXC TECHNOLOGY CO | DXC 技术公司 | DXC US | 纽约 | 美国 | 84.00 | 15,503.20 | 0.02 |
| 481 | DAVITA INC | DaVita 股份有限公司 | DVA US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 14,561.31 | 0.02 |
| 482 | INVESTCO LTD | 景顺有限公司 | IVZ US | 纽约 | 美国 | 115.00 | 14,408.71 | 0.02 |
| 483 | ALASKA AIR GROUP INC | 阿拉斯加航空集团股份有限公司 | ALK US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 14,354.88 | 0.02 |
| 484 | LINCOLN NATIONAL CORP | 林肯国民 | LNC US | 纽约 | 美国 | 58.00 | 12,409.25 | 0.01 |
| 485 | NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING | 挪威邮轮控股有限公司 | NCLH US | 纽约 | 美国 | 145.00 | 12,360.77 | 0.01 |
| 486 | LUMEN TECHNOLOGIES INC | Lumen 科技股份有限公司 | LUMN US | 纽约 | 美国 | 324.00 | 11,779.09 | 0.01 |

| | | | | | | | | |
|-----|------------------------------------|---------------|---------|----------|----|--------|-----------|------|
| 487 | NEWEL L BRAND S INC | 纽威尔品 牌公司 | NWL US | 纳斯达 克 | 美国 | 129.00 | 11,751.51 | 0.01 |
| 488 | FOX CORP- CLASS B | 福克斯公 司 | FOX US | 纳斯达 克 | 美国 | 54.00 | 10,699.71 | 0.01 |
| 489 | VORNA DO REALT Y TRUST | 沃那多房 地产信托 | VNO US | 纽约 | 美国 | 57.00 | 8,261.20 | 0.01 |
| 490 | DISH NETW ORK CORP- A | DISH 网 络公司 | DISH US | 纳斯达 克 | 美国 | 84.00 | 8,213.77 | 0.01 |
| 491 | NEWS CORP- CLASS B | 新闻集团 | NWS US | 纳斯达 克 | 美国 | 48.00 | 6,164.51 | 0.01 |

8.4.2 积极投资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益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名 称 (英 文) | 公司名 称(中文) | 证券代码 | 所在证 券市场 | 所属国 家(地区) | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
|----|---|--|---------|------------|--------------|-----------|-----------|--------------------------|
| 1 | FORTU NE BRAND S INNOV ATIONS I | FORTUN E BRAND S INNOVA TIONS 股份有 限公 司 | FBIN US | 纽约 | 美国 | 48.00 | 19,091.92 | 0.02 |
| 2 | IPG PHOTO NICS CORP | IPG 光 子公 司 | IPGP US | 纳斯达 克 | 美国 | 22.00 | 14,505.45 | 0.02 |
| 3 | PVH CORP | PVH 公 司 | PVH US | 纽约 | 美国 | 28.00 | 13,765.67 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|---|--|-------------------------|---------|----------|----|-------|-----------|------|
| 4 | PENN ENTER TAINM ENT INC | Penn 娱 乐股份有 限公司 | PENN US | 纳斯达 克 | 美国 | 58.00 | 11,997.22 | 0.01 |
| 5 | UNDER ARMO UR INC-CL ASS A | 安德玛股 份有限公 司 | UAA US | 纽约 | 美国 | 69.00 | 4,882.46 | 0.01 |
| 6 | UNDER ARMO UR INC-CL ASS C | 安德玛股 份有限公 司 | UA US | 纳斯达 克 | 美国 | 75.00 | 4,659.32 | 0.01 |
| 7 | MASTE RBRAN D INC | MASTE RBRAN D INC | MBC US | 纳斯达 克 | 美国 | 48.00 | 2,523.97 | - |

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期末基金 资产净值比例 (%) |
|----|-----------------------------------|----------|---------------|------------------------|
| 1 | APPLE INC | AAPL US | 18,322,969.26 | 21.33 |
| 2 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 15,758,602.11 | 18.35 |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 7,668,613.03 | 8.93 |
| 4 | ALPHABET INC-CL A | GOOGL US | 5,446,821.43 | 6.34 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C | GOOG US | 5,028,193.04 | 5.85 |
| 6 | TESLA INC | TSLA US | 4,757,240.51 | 5.54 |
| 7 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | BRK/B US | 4,621,759.44 | 5.38 |
| 8 | JOHNSON & JOHNSON | JNJ US | 3,815,984.43 | 4.44 |
| 9 | UNITEDHEALTH GROUP INC | UNH US | 3,728,852.30 | 4.34 |
| 10 | NVIDIA CORP | NVDA US | 3,500,719.43 | 4.08 |

| | | | | |
|----|------------------------------|---------|--------------|------|
| 11 | EXXON MOBIL CORP | XOM US | 3,254,670.51 | 3.79 |
| 12 | META PLATFORMS INC-CLASS A | FB US | 2,991,290.94 | 3.48 |
| 13 | JPMORGAN CHASE & CO | JPM US | 2,969,391.51 | 3.46 |
| 14 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | PG US | 2,876,458.32 | 3.35 |
| 15 | VISA INC-CLASS A SHARES | V US | 2,760,082.58 | 3.21 |
| 16 | CHEVRON CORP | CVX US | 2,676,705.97 | 3.12 |
| 17 | HOME DEPOT INC | HD US | 2,497,290.58 | 2.91 |
| 18 | MASTERCARD INC - A | MA US | 2,389,361.36 | 2.78 |
| 19 | PFIZER INC | PFE US | 2,353,204.12 | 2.74 |
| 20 | ABBVIE INC | ABBV US | 2,238,747.16 | 2.61 |
| 21 | BANK OF AMERICA CORP | BAC US | 2,042,383.68 | 2.38 |
| 22 | ELI LILLY & CO | LLY US | 1,988,866.42 | 2.32 |
| 23 | COCA-COLA CO/THE | KO US | 1,975,378.51 | 2.30 |
| 24 | MERCK & CO. INC. | MRK US | 1,959,712.95 | 2.28 |
| 25 | BROADCOM INC | AVGO US | 1,910,811.43 | 2.22 |
| 26 | PEPSICO INC | PEP US | 1,894,607.27 | 2.21 |
| 27 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | TMO US | 1,764,411.90 | 2.05 |

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|-------------------|----------|---------------|----------------|
| 1 | APPLE INC | AAPL US | 13,225,844.66 | 15.40 |
| 2 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 11,484,822.93 | 13.37 |
| 3 | AMAZON.COM INC | AMZN US | 5,845,463.03 | 6.81 |
| 4 | ALPHABET INC-CL A | GOOGL US | 3,882,330.48 | 4.52 |

| | | | | |
|----|-----------------------------|-------------|--------------|------|
| 5 | ALPHABET INC-CL C | GOOG US | 3,595,714.87 | 4.19 |
| 6 | TESLA INC | TSLA US | 3,511,537.84 | 4.09 |
| 7 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | BRK/B US | 3,212,576.93 | 3.74 |
| 8 | UNITEDHEALTH GROUP INC | UNH US | 2,730,942.17 | 3.18 |
| 9 | JOHNSON & JOHNSON | JNJ US | 2,683,857.93 | 3.13 |
| 10 | NVIDIA CORP | NVDA US | 2,499,278.70 | 2.91 |
| 11 | EXXON MOBIL CORP | XOM US | 2,368,468.82 | 2.76 |
| 12 | JPMORGAN CHASE & CO | JPM US | 2,119,922.50 | 2.47 |
| 13 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | PG US | 2,001,976.08 | 2.33 |
| 14 | VISA INC-CLASS A SHARES | V US | 1,995,187.29 | 2.32 |
| 15 | CHEVRON CORP | CVX US | 1,902,571.46 | 2.22 |
| 16 | HOME DEPOT INC | HD US | 1,778,958.00 | 2.07 |
| 17 | MASTERCARD INC - A | MA US | 1,736,525.56 | 2.02 |
| 18 | META PLATFORMS INC-CLASS A | FB US | 1,676,414.44 | 1.95 |
| 19 | PFIZER INC | PFE US | 1,671,284.56 | 1.95 |
| 20 | ABBVIE INC | ABBV US | 1,503,222.25 | 1.75 |

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 273,180,696.00 |
| 卖出收入（成交）总额 | 194,621,822.05 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------|------|-----------------|--------------|---------------|
| 1 | PROSHARES ULTRA S&P500 | ETF 基金 | 开放式 | ProShares Trust | 2,930,450.87 | 3.41 |

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | 6,581.55 |
| 3 | 应收股利 | 57,070.83 |
| 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 | 63,652.38 |

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 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。

8.11.5.2 报告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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持 有的基 金份额 | 持有人结构 | | | | | |
|--------------|-------------------|------------------|------------|-------------------|------------|--------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | | 标普 500ETF 联接基 金 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 1,906 | 45,067.5 0 | 8,334,605 .00 | 9.70% | 68,594,046 .00 | 79.85% | 8,970,000 .00 | 10.44% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份额比例 |
|----|------------|---------------|----------|
| 1 | 陈敏 | 34,128,905.00 | 39.73% |
| 2 | 招商证券股份有限公司 | 3,569,702.00 | 4.16% |
| 3 | 中信证券股份有限公司 | 2,047,205.00 | 2.38% |

| | | | |
|----|---|--------------|--------|
| 4 | 杭州瑞峰投资管理有限 公司 | 1,822,100.00 | 2.12% |
| 5 | 周仕国 | 1,399,700.00 | 1.63% |
| 6 | 陈帆 | 1,139,700.00 | 1.33% |
| 7 | 吴俊辉 | 1,042,100.00 | 1.21% |
| 8 | 李金成 | 940,000.00 | 1.09% |
| 9 | 张宁 | 911,000.00 | 1.06% |
| 10 | 蔡华雄 | 833,200.00 | 0.97% |
| - | 国泰标普 500 交易型开 放式指数证券投资基金 发起式联接基金 (QDII) | 8,970,000.00 | 10.44% |

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00 | 0.00% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开 放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式 基金 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2022年5月9日)基金份额总 额 | 247,898,651.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额 | 65,000,000.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎 | 227,000,000.00 |

| | |
|------------------------|---------------|
| 回份额 | |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 85,898,651.00 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 8 月 16 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第十六次会议审议通过，张瑞兵先生不再担任本基金管理人副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|--------|----------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| Goldman Sachs And Co. LLC | 1 | 457,745,810.27 | 97.85% | 84,521.76 | 95.84% | - |
| Haitong International Securities Co Ltd | 1 | 10,056,707.78 | 2.15% | 3,665.08 | 4.16% | - |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|---|------|--------------|------|--------------|------|--------------|--------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| Goldman Sachs And Co. LLC | - | - | - | - | - | - | 5,411,551.03 | 56.85% |
| Haitong International Securities Co Ltd | - | - | - | - | - | - | 4,106,618.82 | 43.15% |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|---------|------------|
| 1 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同生效公告 | 《上海证券报》 | 2022-05-10 |
| 2 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 开放日常申购与赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-05-17 |
| 3 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易公告书 | 公司官网 | 2022-05-17 |
| 4 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 上市交易提示性公告 | 《上海证券报》 | 2022-05-20 |
| 5 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-05-25 |
| 6 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-06-15 |
| 7 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-06-29 |

| | | | |
|----|---|-----------------|------------|
| | 公告 | | |
| 8 | 国泰基金管理有限公司关于公司旗下公募基金最新风险等级评价结果的公告 | 《中国证券报》 | 2022-07-26 |
| 9 | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《中国证券报》 | 2022-08-16 |
| 10 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-08-31 |
| 11 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-11-21 |
| 12 | 国泰基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整申购赎回替代金额处理程序的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》 | 2022-12-13 |
| 13 | 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告 | 《上海证券报》 | 2022-12-21 |
| 14 | 国泰基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告 | 《中国证券报》 | 2022-12-28 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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05月09日至2022年06月12日, 2022年06月27日至2022年06月27日 | 120,004,665.00 | 126,648,462.00 | 243,083,425.00 | 3,569,702.00 | 4.16% |
| 个人 | 1 | 2022年06月13日至2022年12月31日 | - | 34,128,905.00 | - | 34,128,905.00 | 39.73% |
| 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。 | | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者需求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2022 年 12 月 16 日起对本基金调整申购赎回替代金额处理程序，并相应修改招募说明书相关条款。具体可查阅本基金管理人于 2022 年 12 月 13 日披露的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整申购赎回替代金额处理程序的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复
- 2、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同
- 3、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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

13.2 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。

基金托管人住所或办公场所。

13.3 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

二〇二三年三月三十日