

**国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资  
基金**

**2023 年中期报告**

**2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。本中期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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	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 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
<b>5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.11 投资组合报告附注	47
<b>8 基金份额持有人信息</b>	49

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.4	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 .....	50
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2	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 .....	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4	基金投资策略的改变 .....	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
<b>11</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
11.1	备查文件目录 .....	53
11.2	存放地点 .....	53
11.3	查阅方式 .....	53

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用 ETF
场内简称	MSCIESGETF
基金主代码	159621
交易代码	159621
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 30 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,434,717.00 份
基金合同存续期	不定期

### 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	<p>1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。</p>
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股人民币 ESG 通用指数（MSCI China ARMB ESG Universal Index）收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>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。</p>

## 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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	姜敏
	联系电话	021-31081600转	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95558
传真		021-31081800	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200082	100020
法定代表人		邱军	朱鹤新

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层和本基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,303,955.96
本期利润	4,269,300.72
加权平均基金份额本期利润	0.0594
本期加权平均净值利润率	5.99%
本期基金份额净值增长率	-1.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,657,325.31

期末可供分配基金份额利润	-0.0497
期末基金资产净值	50,777,391.69
期末基金份额净值	0.9503
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-4.97%

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 8 月 30 日，截止至 2023 年 6 月 30 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
过去一个月	1.19%	0.87%	-1.78%	1.09%	2.97%	-0.22%
过去三个月	-5.01%	0.77%	-10.86%	0.90%	5.85%	-0.13%
过去六个月	-1.20%	0.78%	-6.69%	0.99%	5.49%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-4.97%	0.93%	-11.79%	1.22%	6.82%	-0.29%

#### 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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金

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 8 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：(1)本基金合同生效日为 2022 年 08 月 30 日，截止到 2023 年 6 月 30 日，本基金成立尚未满一年。

(2)本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。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		
苗梦羽	国泰中证全指软件 ETF、国泰中证全指软件 ETF 联接、国泰中证基建 ETF、国泰中证港股通科技 ETF 发起联接、国泰国证疫苗与生物科技 ETF、国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用 ETF、国泰中证基建 ETF 发起联接、国泰中证机床 ETF、国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII)、国泰国证疫苗与生物科技 ETF 发起联接、国泰中证机床 ETF 发起联接、国泰国证绿色电力 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF 的基金经理	2022-08-30	-	8 年	硕士研究生。2015 年 8 月加入国泰基金, 历任助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 9 月起任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理, 2022 年 2 月起兼任国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2022 年 6 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理, 2022 年 8 月起兼任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和国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2022 年 10 月起兼任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和国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2022 年 11 月起兼任国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 和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的基金经理, 2022 年 12 月起兼任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和国泰国证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2023 年 5 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 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、组合间同向交易记录配对。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 $\geq 30$ ），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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人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

上半年 A 股市场走势震荡，人工智能及中特估为重要主线。年初，政策放宽带来经济复苏强预期，同时北向资金大幅净流入助力全面上涨。1 月末起，人工智能催化 TMT 板块行情，计算机、通信、传媒、电子等行业表现活跃。进入二季度，在经济弱复苏的现实和预期下，A 股市场情绪回落，前期活跃板块逐步迎来分化。上半年，通信、传媒行业领涨，计算机亦涨幅靠前；半数行业录得负收益，商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料等跌幅居前。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为-1.20%，同期业绩比较基准收益率为-6.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

MSCI 中国 A 股人民币 ESG 通用指数覆盖沪深市场的大中盘股票，并在自由流通市值权重的基础上，给予 ESG 情况稳健及积极改善的公司更高权重。从行业分布来看，银行、电力设备、食品饮料、医药生物、非银金融等行业的权重位居前列。整体来看，指数成分股集中度低，行业分布均衡，能够较好地分散行业和个股风险，长期配置价值值得关注。

#### 4.6 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银行进行复核。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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，国泰基金管理有限公司在国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,139,910.05	2,461,685.30
结算备付金		68,418.39	190,142.72
存出保证金		19,125.20	388,802.88
交易性金融资产	6.4.7.2	49,668,402.68	137,965,109.58
其中：股票投资		49,668,402.68	137,965,109.58
基金投资		-	-
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	60,908.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		50,895,856.32	141,066,648.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,927.88	62,860.14
应付托管费		4,185.60	12,572.03
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	6.4.7.6	93,351.15	145,110.92
负债合计		118,464.63	220,543.09
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	53,434,717.00	146,434,717.00
未分配利润	6.4.7.8	-2,657,325.31	-5,588,611.21
净资产合计		50,777,391.69	140,846,105.79
负债和净资产总计		50,895,856.32	141,066,648.88

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9503 元，基金份额总额 53,434,717.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,568,371.22
1.利息收入		5,828.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,828.13
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		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,489,366.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,972,267.91
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	933.44
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	516,165.06
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,965,344.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	107,831.92
<b>减：二、营业总支出</b>		299,070.50
1. 管理人报酬		178,860.76
2. 托管费		35,772.18
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		-
8. 其他费用	6.4.7.16	84,437.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,269,300.72</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,269,300.72</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>4,269,300.72</b>

注：本基金合同生效日为 2022 年 8 月 30 日，因此无上年度可比期间。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	146,434,717.00	-5,588,611.21	140,846,105.79
二、本期期初净资产（基金净值）	146,434,717.00	-5,588,611.21	140,846,105.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-93,000,000.00	2,931,285.90	-90,068,714.10
（一）、综合收益总额	-	4,269,300.72	4,269,300.72
（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）	-93,000,000.00	-1,338,014.82	-94,338,014.82
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-93,000,000.00	-1,338,014.82	-94,338,014.82
（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）	53,434,717.00	-2,657,325.31	50,777,391.69

注：本基金合同生效日为 2022 年 8 月 30 日，因此无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“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[2022]105 号《关于准予国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 989,403,138.00 元(含募集股票市值)，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 0574 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 989,434,717.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,579.00 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]877 号文审核同意，本基金 989,434,717.00 份基金份额于 2022 年 9 月 9 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》和《国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银

行存款、股指期货、货币市场工具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相关规定)。本基金将根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。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：MSCI 中国 A 股人民币 ESG 通用指数(MSCI China ARMB ESG Universal Index)收益率。

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 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 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(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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息

红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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，对国债、地方政府债以及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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,139,910.05
等于：本金	1,139,809.16
加：应计利息	100.89
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	1,139,910.05

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,728,349.96	-	49,668,402.68	-2,059,947.28
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,728,349.96	-	49,668,402.68	-2,059,947.28

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	9,048.59
其中：交易所市场	9,048.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	93,351.15

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,434,717.00	146,434,717.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-93,000,000.00	-93,000,000.00
本期末	53,434,717.00	53,434,717.00

注：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。

#### 6.4.7.8 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
上年度末	-4,289,243.40	-1,299,367.81	-5,588,611.21
本期利润	2,303,955.96	1,965,344.76	4,269,300.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,685,379.98	-3,023,394.80	-1,338,014.82
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	1,685,379.98	-3,023,394.80	-1,338,014.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-299,907.46	-2,357,417.85	-2,657,325.31

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,137.67
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	885.51
其他	1,804.95
合计	5,828.13

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,171,637.59
股票投资收益——赎回差价收入	800,630.32
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	1,972,267.91

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	64,927,168.46
减：卖出股票成本总额	63,665,176.65
减：交易费用	90,354.22

买卖股票差价收入	1,171,637.59
----------	--------------

### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	94,338,014.82
减：现金支付赎回款总额	56,423,187.82
减：赎回股票成本总额	37,114,196.68
减：交易费用	-
赎回差价收入	800,630.32

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	932.74
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	933.44

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,633.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,700.00
减：应计利息总额	0.70
减：交易费用	0.23
买卖债券差价收入	932.74

### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	516,165.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	516,165.06

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	1,965,344.76
——股票投资	1,965,344.76
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	1,965,344.76

注：本基金本会计期间公允价值变动损益——股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	107,831.92
合计	107,831.92

注：ETF 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。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	135.00
合计	84,437.56

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	178,860.76
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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	35,772.18

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
	中信银行	1,139,910.05

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023-06-27	1 个月以内(含)	配股未上市	2.02	2.64	9,240.00	18,664.80	24,393.60	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 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。

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

#### 6.4.13.2 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中信银行，因而与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中国证券登记结算有限责任公司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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 6.4.13.3 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 2023 年 06 月 30 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。

#### 6.4.13.3.1 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》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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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持有的债券投资的公允价值。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%。

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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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、存出保证金及结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,139,910.05	-	-	-	1,139,910.05
结算备付金	68,418.39	-	-	-	68,418.39
存出保证金	19,125.20	-	-	-	19,125.20
交易性金融资产	-	-	-	49,668,402.68	49,668,402.68
资产总计	1,227,453.64	-	-	49,668,402.68	50,895,856.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	20,927.88	20,927.88
应付托管费	-	-	-	4,185.60	4,185.60
其他负债	-	-	-	93,351.15	93,351.15
负债总计	-	-	-	118,464.63	118,464.63
利率敏感度缺口	1,227,453.64	-	-	49,549,938.05	50,777,391.69
上年度末 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	2,461,685.30	-	-	-	2,461,685.30
结算备付金	190,142.72	-	-	-	190,142.72
存出保证金	388,802.88	-	-	-	388,802.88
交易性金融资产	-	-	-	137,965,109.58	137,965,109.58
应收清算款	-	-	-	60,908.40	60,908.40
资产总计	3,040,630.90	-	-	138,026,017.98	141,066,648.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	62,860.14	62,860.14
应付托管费	-	-	-	12,572.03	12,572.03
其他负债	-	-	-	145,110.92	145,110.92
负债总计	-	-	-	220,543.09	220,543.09
利率敏感度缺口	3,040,630.90	-	-	137,805,474.89	140,846,105.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 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%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	49,668,402.68	97.82	137,965,109.58	97.95

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,668,402.68	97.82	137,965,109.58	97.95

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	49,644,009.08	137,809,353.21
第二层次	24,393.60	-
第三层次	-	155,756.37
合计	49,668,402.68	137,965,109.58

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对

于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 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，本基金未发生基金申购业务。

(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。

### 7 投资组合报告

#### 7.1 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	49,668,402.68	97.59
	其中：股票	49,668,402.68	97.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,208,328.44	2.37
8	其他各项资产	19,125.20	0.04

9	合计	50,895,856.32	100.00
---	----	---------------	--------

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	360,878.00	0.71
B	采矿业	1,524,643.91	3.00
C	制造业	27,342,628.86	53.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,624,896.62	3.20
E	建筑业	605,200.56	1.19
F	批发和零售业	653,811.04	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,655,551.50	3.26
H	住宿和餐饮业	98,064.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,996,166.40	5.90
J	金融业	10,045,084.12	19.78
K	房地产业	805,425.00	1.59
L	租赁和商务服务业	561,627.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	732,053.00	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	47,427.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,090.00	0.04
Q	卫生和社会工作	337,310.00	0.66
R	文化、体育和娱乐业	181,012.00	0.36
S	综合	53,295.00	0.10
	合计	49,647,164.01	97.77

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,610.56	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,628.11	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,238.67	0.04

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,600	2,705,600.00	5.33
2	300750	宁德时代	8,163	1,867,612.77	3.68

3	002594	比亚迪	5,100	1,317,177.00	2.59
4	600036	招商银行	29,700	972,972.00	1.92
5	600900	长江电力	34,307	756,812.42	1.49
6	601318	中国平安	15,600	723,840.00	1.43
7	688111	金山办公	1,400	661,108.00	1.30
8	601398	工商银行	113,900	548,998.00	1.08
9	600276	恒瑞医药	11,400	546,060.00	1.08
10	601288	农业银行	154,500	545,385.00	1.07
11	000858	五粮液	3,100	507,067.00	1.00
12	603259	药明康德	7,800	486,018.00	0.96
13	601138	工业富联	18,700	471,240.00	0.93
14	300760	迈瑞医疗	1,565	469,187.00	0.92
15	601166	兴业银行	29,700	464,805.00	0.92
16	600436	片仔癀	1,600	458,176.00	0.90
17	600030	中信证券	22,704	449,085.12	0.88
18	002352	顺丰控股	9,400	423,846.00	0.83
19	601328	交通银行	71,800	416,440.00	0.82
20	000001	平安银行	35,900	403,157.00	0.79
21	600000	浦发银行	53,100	384,444.00	0.76
22	601088	中国神华	12,500	384,375.00	0.76
23	601888	中国中免	3,400	375,802.00	0.74
24	000568	泸州老窖	1,600	335,312.00	0.66
25	600887	伊利股份	11,352	321,488.64	0.63
26	601012	隆基绿能	10,940	313,649.80	0.62
27	600028	中国石化	46,800	297,648.00	0.59
28	600809	山西汾酒	1,600	296,112.00	0.58
29	000063	中兴通讯	6,200	282,348.00	0.56
30	600690	海尔智家	11,400	267,672.00	0.53
31	300896	爱美客	600	266,970.00	0.53
32	002129	TCL 中环	7,750	257,300.00	0.51
33	601988	中国银行	64,000	250,240.00	0.49
34	002142	宁波银行	9,710	245,663.00	0.48
35	300308	中际旭创	1,600	235,920.00	0.46
36	002230	科大讯飞	3,400	231,064.00	0.46
37	600048	保利发展	17,200	224,116.00	0.44
38	000725	京东方 A	54,600	223,314.00	0.44
39	002371	北方华创	700	222,355.00	0.44
40	601919	中远海控	23,400	219,960.00	0.43
41	000661	长春高新	1,600	218,080.00	0.43
42	002304	洋河股份	1,600	210,160.00	0.41
43	601818	光大银行	67,100	205,997.00	0.41
44	601658	邮储银行	42,100	205,869.00	0.41
45	002714	牧原股份	4,700	198,105.00	0.39
46	000002	万科 A	14,000	196,280.00	0.39

47	600919	江苏银行	26,500	194,775.00	0.38
48	600016	民生银行	51,500	193,125.00	0.38
49	002460	赣锋锂业	3,162	192,755.52	0.38
50	300274	阳光电源	1,600	186,608.00	0.37
51	600585	海螺水泥	7,800	185,172.00	0.36
52	002821	凯莱英	1,563	184,215.18	0.36
53	603288	海天味业	3,896	182,527.60	0.36
54	601607	上海医药	8,100	181,521.00	0.36
55	300454	深信服	1,600	181,200.00	0.36
56	300724	捷佳伟创	1,600	179,760.00	0.35
57	601668	中国建筑	31,224	179,225.76	0.35
58	600085	同仁堂	3,100	178,436.00	0.35
59	601628	中国人寿	5,100	178,296.00	0.35
60	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.34
61	600905	三峡能源	31,200	167,544.00	0.33
62	300763	锦浪科技	1,600	166,560.00	0.33
63	000538	云南白药	3,160	165,836.80	0.33
64	600600	青岛啤酒	1,600	165,808.00	0.33
65	600837	海通证券	17,900	165,038.00	0.33
66	688396	华润微	3,100	162,471.00	0.32
67	300059	东方财富	11,340	161,028.00	0.32
68	603501	韦尔股份	1,600	156,864.00	0.31
69	688012	中微公司	1,000	156,450.00	0.31
70	000338	潍柴动力	12,500	155,750.00	0.31
71	603737	三棵树	2,380	155,699.60	0.31
72	002812	恩捷股份	1,600	154,160.00	0.30
72	300496	中科创达	1,600	154,160.00	0.30
74	601688	华泰证券	10,900	150,093.00	0.30
75	601066	中信建投	6,200	150,040.00	0.30
76	000938	紫光股份	4,700	149,695.00	0.29
77	600309	万华化学	1,700	149,328.00	0.29
78	001979	招商蛇口	11,400	148,542.00	0.29
79	600999	招商证券	10,900	147,913.00	0.29
80	600132	重庆啤酒	1,600	147,456.00	0.29
81	688036	传音控股	1,000	147,000.00	0.29
82	002027	分众传媒	21,400	145,734.00	0.29
83	002049	紫光国微	1,560	145,470.00	0.29
84	601169	北京银行	31,200	144,456.00	0.28
85	601225	陕西煤业	7,850	142,791.50	0.28
86	300957	贝泰妮	1,600	142,208.00	0.28
87	600406	国电南瑞	6,104	141,002.40	0.28
88	603993	洛阳钼业	25,977	138,457.41	0.27
89	000776	广发证券	9,400	138,274.00	0.27
90	600570	恒生电子	3,100	137,299.00	0.27

91	601360	三六零	10,900	136,686.00	0.27
92	000100	TCL 科技	34,360	135,378.40	0.27
93	603659	璞泰来	3,410	130,330.20	0.26
94	002459	晶澳科技	3,120	130,104.00	0.26
95	601689	拓普集团	1,600	129,120.00	0.25
96	688777	中控技术	2,030	127,443.40	0.25
97	601601	中国太保	4,900	127,302.00	0.25
98	600588	用友网络	6,200	127,100.00	0.25
99	300015	爱尔眼科	6,770	125,583.50	0.25
100	000895	双汇发展	5,100	124,899.00	0.25
101	603486	科沃斯	1,600	124,432.00	0.25
102	300999	金龙鱼	3,100	123,969.00	0.24
103	601816	京沪高铁	23,400	123,084.00	0.24
104	300033	同花顺	700	122,696.00	0.24
105	688180	君实生物	3,145	121,208.30	0.24
106	601995	中金公司	3,400	120,768.00	0.24
107	603882	金域医学	1,579	119,214.50	0.23
108	002466	天齐锂业	1,700	118,847.00	0.23
109	601865	福莱特	3,086	118,841.86	0.23
110	601390	中国中铁	15,600	118,248.00	0.23
111	688390	固德威	700	116,802.00	0.23
112	601766	中国中车	17,900	116,350.00	0.23
113	601111	中国国航	14,000	115,360.00	0.23
114	603806	福斯特	3,092	114,991.48	0.23
115	300316	晶盛机电	1,600	113,440.00	0.22
116	600050	中国联通	23,400	112,320.00	0.22
117	002555	三七互娱	3,200	111,616.00	0.22
118	000301	东方盛虹	9,400	111,108.00	0.22
119	600926	杭州银行	9,400	110,450.00	0.22
120	600438	通威股份	3,200	109,792.00	0.22
121	002493	荣盛石化	9,400	109,416.00	0.22
122	300124	汇川技术	1,700	109,157.00	0.21
123	002920	德赛西威	700	109,067.00	0.21
124	601727	上海电气	23,400	106,938.00	0.21
125	002602	世纪华通	14,000	106,260.00	0.21
126	603986	兆易创新	1,000	106,250.00	0.21
127	300413	芒果超媒	3,100	106,051.00	0.21
128	600958	东方证券	10,900	105,730.00	0.21
129	601916	浙商银行	40,040	105,705.60	0.21
130	600015	华夏银行	19,500	105,495.00	0.21
131	600150	中国船舶	3,200	105,312.00	0.21
132	600196	复星医药	3,400	105,060.00	0.21
133	300122	智飞生物	2,371	104,798.20	0.21
134	300347	泰格医药	1,600	103,264.00	0.20

135	600031	三一重工	6,200	103,106.00	0.20
136	601100	恒立液压	1,600	102,928.00	0.20
137	603345	安井食品	700	102,760.00	0.20
138	600029	南方航空	16,850	101,605.50	0.20
139	603392	万泰生物	1,500	100,155.00	0.20
140	688063	派能科技	500	99,125.00	0.20
141	601985	中国核电	14,000	98,700.00	0.19
142	603444	吉比特	200	98,222.00	0.19
143	600845	宝信软件	1,920	97,555.20	0.19
144	600536	中国软件	2,080	97,510.40	0.19
145	000999	华润三九	1,600	97,056.00	0.19
146	300014	亿纬锂能	1,600	96,800.00	0.19
147	300832	新产业	1,600	94,400.00	0.19
148	000166	申万宏源	20,300	93,786.00	0.18
149	600346	恒力石化	6,500	93,145.00	0.18
150	601021	春秋航空	1,600	91,952.00	0.18
151	601009	南京银行	11,400	91,200.00	0.18
152	600019	宝钢股份	16,200	91,044.00	0.18
153	300408	三环集团	3,100	90,985.00	0.18
154	000792	盐湖股份	4,700	90,099.00	0.18
155	601229	上海银行	15,600	89,700.00	0.18
156	600803	新奥股份	4,700	89,206.00	0.18
157	600176	中国巨石	6,200	87,792.00	0.17
158	601939	建设银行	14,000	87,640.00	0.17
159	601211	国泰君安	6,200	86,738.00	0.17
160	601799	星宇股份	700	86,520.00	0.17
161	300498	温氏股份	4,700	86,245.00	0.17
162	002241	歌尔股份	4,849	86,069.75	0.17
163	601877	正泰电器	3,100	85,715.00	0.17
164	601633	长城汽车	3,400	85,578.00	0.17
165	603369	今世缘	1,600	84,480.00	0.17
166	600745	闻泰科技	1,700	83,130.00	0.16
167	300037	新宙邦	1,600	83,024.00	0.16
168	000977	浪潮信息	1,700	82,450.00	0.16
169	601319	中国人保	14,000	81,760.00	0.16
170	601901	方正证券	12,500	81,750.00	0.16
171	601238	广汽集团	7,800	81,276.00	0.16
172	601006	大秦铁路	10,900	80,987.00	0.16
173	300073	当升科技	1,600	80,528.00	0.16
174	688008	澜起科技	1,400	80,388.00	0.16
175	000625	长安汽车	6,200	80,166.00	0.16
176	002603	以岭药业	3,100	79,639.00	0.16
177	002028	思源电气	1,700	79,424.00	0.16
178	300628	亿联网络	2,240	78,556.80	0.15

179	600026	中远海能	6,200	78,368.00	0.15
180	603799	华友钴业	1,700	78,047.00	0.15
181	600522	中天科技	4,900	77,959.00	0.15
182	601377	兴业证券	12,500	76,500.00	0.15
183	601825	沪农商行	14,000	76,300.00	0.15
184	002600	领益智造	10,900	75,319.00	0.15
185	688256	寒武纪	400	75,200.00	0.15
186	002311	海大集团	1,600	74,944.00	0.15
187	600111	北方稀土	3,100	74,338.00	0.15
187	300146	汤臣倍健	3,100	74,338.00	0.15
189	000963	华东医药	1,700	73,729.00	0.15
190	000157	中联重科	10,900	73,575.00	0.14
191	600547	山东黄金	3,100	72,788.00	0.14
192	600009	上海机场	1,600	72,672.00	0.14
193	688561	奇安信	1,400	72,534.00	0.14
194	600893	航发动力	1,700	71,842.00	0.14
195	601669	中国电建	12,500	71,750.00	0.14
196	002625	光启技术	4,700	71,722.00	0.14
197	000408	藏格矿业	3,100	69,967.00	0.14
198	603899	晨光股份	1,550	69,192.00	0.14
199	600732	爱旭股份	2,240	68,880.00	0.14
200	600754	锦江酒店	1,600	67,744.00	0.13
201	000513	丽珠集团	1,700	66,147.00	0.13
202	002709	天赐材料	1,600	65,904.00	0.13
203	603127	昭衍新药	1,600	65,440.00	0.13
204	002463	沪电股份	3,100	64,914.00	0.13
205	688126	沪硅产业	3,100	64,790.00	0.13
206	600886	国投电力	5,100	64,515.00	0.13
207	300418	昆仑万维	1,600	64,448.00	0.13
208	600989	宝丰能源	5,100	64,311.00	0.13
209	000425	徐工机械	9,400	63,638.00	0.13
210	002080	中材科技	3,100	63,612.00	0.13
211	688009	中国通号	10,910	63,278.00	0.12
212	605117	德业股份	420	62,811.00	0.12
213	600511	国药股份	1,600	62,160.00	0.12
214	000651	格力电器	1,700	62,067.00	0.12
215	600705	中航产融	16,200	62,046.00	0.12
216	601108	财通证券	8,500	61,540.00	0.12
217	002236	大华股份	3,100	61,225.00	0.12
218	603816	顾家家居	1,600	61,040.00	0.12
219	600660	福耀玻璃	1,700	60,945.00	0.12
220	000988	华工科技	1,600	60,816.00	0.12
221	601577	长沙银行	7,800	60,528.00	0.12
222	600011	华能国际	6,500	60,190.00	0.12

223	600115	中国东航	12,500	59,500.00	0.12
224	300759	康龙化成	1,550	59,334.00	0.12
225	600872	中炬高新	1,600	58,864.00	0.12
226	601336	新华保险	1,600	58,832.00	0.12
226	601127	赛力斯	1,600	58,832.00	0.12
228	600010	包钢股份	32,800	58,712.00	0.12
229	600703	三安光电	3,400	58,616.00	0.12
230	002568	百润股份	1,600	58,160.00	0.11
231	601077	渝农商行	16,200	58,158.00	0.11
232	600298	安琪酵母	1,600	57,936.00	0.11
233	300751	迈为股份	340	57,589.20	0.11
234	002223	鱼跃医疗	1,600	57,584.00	0.11
235	002624	完美世界	3,400	57,426.00	0.11
236	601615	明阳智能	3,400	57,392.00	0.11
237	603939	益丰药房	1,540	56,980.00	0.11
238	002056	横店东磁	3,100	56,451.00	0.11
239	002153	石基信息	4,030	56,420.00	0.11
240	300207	欣旺达	3,400	55,488.00	0.11
241	000069	华侨城 A	12,500	55,000.00	0.11
242	002430	杭氧股份	1,600	54,976.00	0.11
243	002180	纳思达	1,600	54,800.00	0.11
244	601868	中国能建	23,400	54,756.00	0.11
245	601881	中国银河	4,700	54,567.00	0.11
246	002405	四维图新	4,700	54,426.00	0.11
247	002340	格林美	7,796	53,870.36	0.11
248	603233	大参林	1,920	53,779.20	0.11
249	300390	天华新能	1,500	53,700.00	0.11
250	600655	豫园股份	7,800	53,508.00	0.11
251	601600	中国铝业	9,700	53,253.00	0.10
252	600219	南山铝业	17,200	51,944.00	0.10
253	601618	中国中冶	13,000	51,610.00	0.10
254	603712	七一二	1,700	51,357.00	0.10
255	000728	国元证券	7,845	51,149.40	0.10
256	600332	白云山	1,600	51,008.00	0.10
257	002240	盛新锂能	1,600	50,992.00	0.10
258	600188	兖矿能源	1,700	50,864.00	0.10
259	002294	信立泰	1,600	49,904.00	0.10
260	600584	长电科技	1,600	49,872.00	0.10
261	600039	四川路桥	5,080	49,834.80	0.10
262	600795	国电电力	13,000	49,790.00	0.10
263	600998	九州通	4,768	49,491.84	0.10
264	601168	西部矿业	4,700	49,397.00	0.10
265	603885	吉祥航空	3,200	49,376.00	0.10
266	300699	光威复材	1,600	49,360.00	0.10

267	600221	海航控股	31,200	49,296.00	0.10
268	601788	光大证券	3,100	49,259.00	0.10
269	600426	华鲁恒升	1,600	49,008.00	0.10
270	600460	士兰微	1,600	48,432.00	0.10
271	600763	通策医疗	500	48,430.00	0.10
272	002050	三花智控	1,600	48,416.00	0.10
273	300595	欧普康视	1,600	48,304.00	0.10
274	600674	川投能源	3,200	48,160.00	0.09
275	002422	科伦药业	1,600	47,488.00	0.09
276	600583	海油工程	8,100	47,385.00	0.09
277	000831	中国稀土	1,600	47,360.00	0.09
278	300363	博腾股份	1,600	47,344.00	0.09
279	002648	卫星化学	3,160	47,273.60	0.09
280	600383	金地集团	6,500	46,865.00	0.09
281	600566	济川药业	1,600	46,464.00	0.09
282	601231	环旭电子	3,100	46,376.00	0.09
283	601155	新城控股	3,200	46,112.00	0.09
284	603833	欧派家居	479	45,888.20	0.09
285	600233	圆通速递	3,100	45,136.00	0.09
286	002797	第一创业	7,800	44,616.00	0.09
287	002268	电科网安	1,600	44,592.00	0.09
288	600109	国金证券	5,100	44,217.00	0.09
289	002074	国轩高科	1,600	44,192.00	0.09
290	002044	美年健康	6,200	44,082.00	0.09
291	600183	生益科技	3,100	44,020.00	0.09
292	603456	九洲药业	1,600	43,808.00	0.09
293	300118	东方日升	1,700	43,571.00	0.09
294	600161	天坛生物	1,600	43,440.00	0.09
295	600481	双良节能	3,100	43,338.00	0.09
296	600079	人福医药	1,600	43,104.00	0.08
297	002508	老板电器	1,700	42,993.00	0.08
298	000066	中国长城	3,100	42,873.00	0.08
299	000983	山西焦煤	4,700	42,770.00	0.08
300	300142	沃森生物	1,600	42,320.00	0.08
301	000591	太阳能	6,200	42,036.00	0.08
302	603156	养元饮品	1,700	41,990.00	0.08
303	600027	华电国际	6,200	41,478.00	0.08
304	002384	东山精密	1,600	41,440.00	0.08
305	300782	卓胜微	425	41,067.75	0.08
306	600023	浙能电力	8,100	41,067.00	0.08
307	000009	中国宝安	3,400	41,038.00	0.08
308	002736	国信证券	4,700	41,031.00	0.08
309	600848	上海临港	3,400	40,630.00	0.08
310	002966	苏州银行	6,200	40,610.00	0.08

311	002353	杰瑞股份	1,600	40,208.00	0.08
312	002739	万达电影	3,200	40,128.00	0.08
313	600415	小商品城	4,700	40,091.00	0.08
314	000876	新希望	3,400	39,712.00	0.08
315	300601	康泰生物	1,560	39,608.40	0.08
316	000807	云铝股份	3,100	39,463.00	0.08
317	600380	健康元	3,100	39,401.00	0.08
318	000987	越秀资本	6,200	39,370.00	0.08
319	000786	北新建材	1,600	39,216.00	0.08
320	000738	航发控制	1,600	39,040.00	0.08
321	002831	裕同科技	1,600	39,024.00	0.08
322	601117	中国化学	4,700	38,916.00	0.08
323	002938	鹏鼎控股	1,600	38,864.00	0.08
324	600704	物产中大	7,800	38,532.00	0.08
325	002138	顺络电子	1,600	38,256.00	0.08
326	002507	涪陵榨菜	2,080	38,084.80	0.08
327	601838	成都银行	3,100	37,851.00	0.07
328	300529	健帆生物	1,600	37,088.00	0.07
329	002252	上海莱士	4,900	36,799.00	0.07
330	000893	亚钾国际	1,600	36,704.00	0.07
331	300003	乐普医疗	1,600	36,176.00	0.07
332	002156	通富微电	1,600	36,160.00	0.07
333	002202	金风科技	3,400	36,108.00	0.07
334	601872	招商轮船	6,200	35,898.00	0.07
335	002007	华兰生物	1,600	35,856.00	0.07
336	601966	玲珑轮胎	1,600	35,552.00	0.07
336	600141	兴发集团	1,600	35,552.00	0.07
338	600918	中泰证券	5,100	35,241.00	0.07
339	600489	中金黄金	3,400	35,122.00	0.07
340	688779	长远锂科	3,100	34,937.00	0.07
341	002372	伟星新材	1,700	34,918.00	0.07
342	601958	金铂股份	3,100	34,565.00	0.07
343	601016	节能风电	9,360	34,351.20	0.07
344	600688	上海石化	10,900	33,899.00	0.07
345	600061	国投资本	4,700	33,464.00	0.07
346	603858	步长制药	1,600	32,944.00	0.06
347	600515	海南机场	8,100	32,886.00	0.06
348	601555	东吴证券	4,700	32,618.00	0.06
349	002064	华峰化学	4,700	32,242.00	0.06
349	600256	广汇能源	4,700	32,242.00	0.06
351	000423	东阿阿胶	600	32,070.00	0.06
352	000021	深科技	1,600	31,984.00	0.06
353	601216	君正集团	7,800	31,980.00	0.06
354	600875	东方电气	1,700	31,705.00	0.06

355	600741	华域汽车	1,700	31,382.00	0.06
356	002407	多氟多	1,580	31,378.80	0.06
357	002414	高德红外	4,030	31,313.10	0.06
358	002030	达安基因	3,100	30,907.00	0.06
359	002299	圣农发展	1,600	30,640.00	0.06
360	601878	浙商证券	3,100	30,628.00	0.06
361	600549	厦门钨业	1,600	30,448.00	0.06
362	603218	日月股份	1,600	30,384.00	0.06
363	600362	江西铜业	1,600	30,368.00	0.06
364	600258	首旅酒店	1,600	30,320.00	0.06
365	002497	雅化集团	1,700	30,226.00	0.06
366	000932	华菱钢铁	6,200	29,574.00	0.06
367	600521	华海药业	1,600	29,456.00	0.06
368	600338	西藏珠峰	1,600	29,216.00	0.06
369	600352	浙江龙盛	3,100	28,985.00	0.06
370	000519	中兵红箭	1,600	28,944.00	0.06
371	002558	巨人网络	1,600	28,688.00	0.06
372	002185	华天科技	3,100	28,520.00	0.06
373	000739	普洛药业	1,600	28,384.00	0.06
374	600699	均胜电子	1,600	28,224.00	0.06
375	002601	龙佰集团	1,700	28,050.00	0.06
376	603568	伟明环保	1,600	28,016.00	0.06
377	601699	潞安环能	1,700	27,744.00	0.05
378	300568	星源材质	1,600	27,504.00	0.05
379	600096	云天化	1,600	27,312.00	0.05
380	000783	长江证券	4,700	27,260.00	0.05
381	601992	金隅集团	12,500	27,250.00	0.05
382	600018	上港集团	5,100	26,775.00	0.05
383	002001	新和成	1,700	26,180.00	0.05
384	002531	天顺风能	1,700	25,891.00	0.05
385	601990	南京证券	3,100	25,358.00	0.05
386	002939	长城证券	3,100	25,203.00	0.05
387	600487	亨通光电	1,700	24,922.00	0.05
388	000960	锡业股份	1,600	24,880.00	0.05
389	601198	东兴证券	3,100	24,862.00	0.05
390	000998	隆平高科	1,600	24,560.00	0.05
391	600348	华阳股份	3,100	24,521.00	0.05
392	600004	白云机场	1,700	24,378.00	0.05
393	000629	钒钛股份	6,200	24,242.00	0.05
394	600884	杉杉股份	1,600	24,224.00	0.05
395	600642	申能股份	3,400	23,766.00	0.05
396	600160	巨化股份	1,700	23,426.00	0.05
397	600606	绿地控股	8,500	23,375.00	0.05
398	000723	美锦能源	3,100	23,374.00	0.05

399	600546	山煤国际	1,600	23,152.00	0.05
400	000155	川能动力	1,600	23,040.00	0.05
401	600157	永泰能源	16,200	23,004.00	0.05
402	000630	铜陵有色	7,800	22,542.00	0.04
403	601233	桐昆股份	1,700	22,525.00	0.04
404	000027	深圳能源	3,400	22,406.00	0.04
405	000683	远兴能源	3,100	22,289.00	0.04
406	002607	中公教育	4,700	22,090.00	0.04
407	600056	中国医药	1,700	22,066.00	0.04
408	002065	东华软件	3,100	21,886.00	0.04
409	601880	辽港股份	14,000	21,840.00	0.04
410	600988	赤峰黄金	1,600	21,536.00	0.04
411	600598	北大荒	1,600	21,328.00	0.04
412	000729	燕京啤酒	1,700	21,199.00	0.04
413	002128	电投能源	1,600	21,152.00	0.04
414	300144	宋城演艺	1,700	21,080.00	0.04
415	000703	恒逸石化	3,100	21,018.00	0.04
416	600801	华新水泥	1,700	20,995.00	0.04
417	000933	神火股份	1,600	20,800.00	0.04
418	603707	健友股份	1,530	20,655.00	0.04
419	600392	盛和资源	1,600	20,592.00	0.04
420	601991	大唐发电	6,200	20,522.00	0.04
421	002385	大北农	3,100	20,460.00	0.04
422	002532	天山铝业	3,400	20,366.00	0.04
423	601933	永辉超市	6,500	20,345.00	0.04
424	002673	西部证券	3,200	20,320.00	0.04
425	002152	广电运通	1,700	19,924.00	0.04
426	000975	银泰黄金	1,700	19,890.00	0.04
427	000937	冀中能源	3,100	19,778.00	0.04
428	000825	太钢不锈	5,100	19,737.00	0.04
429	600985	淮北矿业	1,700	19,584.00	0.04
430	002266	浙富控股	4,700	19,411.00	0.04
431	601058	赛轮轮胎	1,700	19,363.00	0.04
432	601866	中远海发	7,800	19,266.00	0.04
433	600516	方大炭素	3,100	19,220.00	0.04
434	002176	江特电机	1,600	19,072.00	0.04
435	600153	建发股份	1,700	18,547.00	0.04
436	600021	上海电力	1,700	18,309.00	0.04
437	002145	中核钛白	3,100	18,259.00	0.04
438	600499	科达制造	1,600	18,176.00	0.04
439	002078	太阳纸业	1,700	18,173.00	0.04
440	601696	中银证券	1,700	18,122.00	0.04
441	300676	华大基因	300	17,997.00	0.04
442	600369	西南证券	4,900	17,885.00	0.04

443	000709	河钢股份	7,800	17,628.00	0.03
444	002465	海格通信	1,700	17,578.00	0.03
445	600170	上海建工	6,500	17,485.00	0.03
446	002500	山西证券	3,100	17,298.00	0.03
447	000830	鲁西化工	1,600	16,896.00	0.03
448	300357	我武生物	485	16,310.55	0.03
449	002120	韵达股份	1,700	16,252.00	0.03
450	603077	和邦生物	6,500	15,795.00	0.03
451	603866	桃李面包	1,560	15,787.20	0.03
452	000050	深天马 A	1,700	15,606.00	0.03
453	601456	国联证券	1,700	15,470.00	0.03
454	600873	梅花生物	1,700	15,181.00	0.03
455	002244	滨江集团	1,700	14,994.00	0.03
456	601636	旗滨集团	1,700	14,654.00	0.03
457	000800	一汽解放	1,700	14,229.00	0.03
458	002926	华西证券	1,700	14,127.00	0.03
459	300251	光线传媒	1,700	13,753.00	0.03
460	601666	平煤股份	1,700	12,818.00	0.03
461	000401	冀东水泥	1,700	12,529.00	0.02
462	600673	东阳光	1,700	12,257.00	0.02
463	002408	齐翔腾达	1,700	10,829.00	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	301297	富乐德	561	12,628.11	0.02
2	301301	川宁生物	961	8,610.56	0.02

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	533,964.55	0.38
2	600436	片仔癀	272,107.00	0.19
3	300760	迈瑞医疗	190,170.00	0.14
4	600519	贵州茅台	175,301.00	0.12
5	601318	中国平安	175,053.00	0.12
6	000661	长春高新	174,752.00	0.12

7	300750	宁德时代	169,990.00	0.12
8	688777	中控技术	137,914.00	0.10
9	601816	京沪高铁	132,678.00	0.09
10	601888	中国中免	132,552.00	0.09
11	601288	农业银行	111,849.00	0.08
12	600030	中信证券	96,707.00	0.07
13	600085	同仁堂	95,961.00	0.07
14	603833	欧派家居	95,725.42	0.07
15	688256	寒武纪	95,612.00	0.07
16	603605	珀莱雅	91,640.00	0.07
17	300418	昆仑万维	89,478.00	0.06
18	601021	春秋航空	89,449.00	0.06
19	600000	浦发银行	87,984.00	0.06
20	601901	方正证券	85,375.00	0.06

注：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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	5,714,395.00	4.06
2	600036	招商银行	3,317,067.55	2.36
3	600900	长江电力	1,432,464.00	1.02
4	603259	药明康德	1,397,995.65	0.99
5	601888	中国中免	1,397,397.00	0.99
6	601012	隆基绿能	1,310,953.00	0.93
7	601318	中国平安	1,256,023.00	0.89
8	600276	恒瑞医药	1,136,318.00	0.81
9	601166	兴业银行	1,122,737.00	0.80
10	601398	工商银行	1,068,915.00	0.76
11	600809	山西汾酒	898,460.00	0.64
12	600887	伊利股份	840,657.00	0.60
13	600030	中信证券	787,284.00	0.56
14	601288	农业银行	765,424.00	0.54
15	601601	中国太保	750,229.00	0.53
16	601328	交通银行	748,133.00	0.53
17	600309	万华化学	713,102.00	0.51
18	601088	中国神华	706,889.00	0.50
19	600019	宝钢股份	679,767.00	0.48
20	600690	海尔智家	672,444.00	0.48

注：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。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,517,321.67
卖出股票的收入（成交）总额	64,927,168.46

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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“招商银行”、“工商银行”、“农业银行”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

招商银行及下属分支机构因超过期限向中国人民银行报送账户开立资料；拖延支付票据；未按照规定履行客户身份识别义务；未按照规定处理征信异议；未按照规定报送可疑交易报告；金融消费者权益保护部门没有足够的人力独立开展工作；未按规定向人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；

未按规定履行客户身份识别义务；对外付出残缺、污损人民币；未按规定收缴假币；代销保险业务存在误导销售；贷后管理不到位；贷款业务严重违反审慎经营规则；发卡授信不审慎，严重违反审慎经营规则；个人贷款资金违规流入房地产市场；流动资金贷款违规流入房地产市场；违规保管借款人已签字但关键要素空白的文书；个人经营性贷款三查不尽职，贷款资金被挪用；财务顾问费质价不符；监管标准化数据质量问题未整改到位；因开立、撤销银行结算账户超期备案、未按规定停止新增不同法人机构间直连处理条码支付业务；未按规定对保险销售从业人员进行执业登记和管理；向未完成竣工验收的商业用房发放按揭贷款；非标业务管理不尽职；违规审批用于固定资产投资项目的流动资金贷款、贷款受托支付不及时、贷前调查不尽职形成风险、违规发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款，信贷资产非真实洁净转让；不当销售；总行对分支机构管控不力承担管理责任；对公账户管理严重违反审慎经营规则；基金理财销售业务违规；管理不善导致金融许可证遗失；违反反洗钱管理规定；员工行为管理不到位；贸易背景审查不到位；涉案账户交易监测不到位；存在信贷资金违规回流借款人开立存单等问题，受到央行及派出机构、地方银保监局、地方证监局公开批评、公开处罚、警告、罚款、责令改正等处罚。

工商银行及下属分支机构因未依法履行职责、违规经营、内控管理不严，严重违反审慎经营规则，个人贷款资金审查不严致使违规流入限制性领域，贷款“三查”执行不到位违法违规，贷款管理不到位，个人信贷资金被违规挪用，存在以贷收费行为，欺骗投保人、被保险人或者受益人，逆程序进行贷款操作，员工行为管理不到位、违规发放个人汽车消费贷款并形成不良，提供虚假资料证明文件，违反反洗钱法、工作人员贪污、挪用、侵占银行或者客户的资金，内部制度不完善等问题，受到银保监局、央行派出机构责令改正、警告、罚款、没收违法所得等处罚。

农业银行下属分支机构因未按规定换领金融许可证；贷后管理不到位；贷前调查不尽职；收取顾问费，质价不符；以贷吸存；信贷管理不审慎，员工管理不到位；员工行为排查不到位，未发现员工异常行为；管理不善、导致金融许可证遗失；辖属金融服务点未经批准暂停营业；贷款资金被挪用；员工行为管理不到位；贷款“三查”不到位，对公信贷资金违规流入限制性领域；贷款“三查”不到位，个人信贷资金违规流入限制性领域；发放虚假二手房按揭贷款，严重违反审慎经营规则；信用卡汽车分期业务管理不审慎；服务收费质价不符；虚增存贷款；因管理不善导致许可证遗失；违反规定办理结汇业务；内控制度执行严重不到位；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查，违反外汇登记管理规定等原因，受到监管机构公开处罚。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.11.2 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。

**7.11.3 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	19,125.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,125.20

**7.11.4 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。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**7.11.5.1 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。

**7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 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	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例		比例
1,557	34,319.02	11,954,321.00	22.37%	41,480,396.00	77.63%

### 8.2 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	广发证券股份有限公司	6,293,524.00	11.78%
2	中信建投证券股份有限公司	2,403,299.00	4.50%
3	海通证券股份有限公司	1,771,962.00	3.32%
4	段徐蕙	1,380,040.00	2.58%
5	白巍	1,060,550.00	1.98%
6	汤赛	1,001,077.00	1.87%
7	武汉华虹科技投资管理有限公司	1,000,019.00	1.87%
8	谭玉兰	682,222.00	1.28%
9	杨美华	500,048.00	0.94%
10	冯娜	500,043.00	0.94%

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。

### 8.3 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%

### 8.4 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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 8 月 30 日）基金份额总额	989,434,717.00
本报告期期初基金份额总额	146,434,717.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	93,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	53,434,717.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

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：

基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 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。

### 10.6.2 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
申万宏源	2	58,681,315.52	78.24%	7,118.89	37.69%	-
广发证券	2	16,316,480.83	21.76%	11,768.83	62.31%	-

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。

### 10.7.2 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	
	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
申万宏源	3,489.12	61.93%	-	-	-	-

广发证券	2,144.55	38.07%	-	-	-	-
------	----------	--------	---	---	---	---

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 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

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇二三年八月三十日