

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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。

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，决定自 2023 年 8 月 16 日起调整本基金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 2023 年 8 月 11 日发布的《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

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	5
2.4 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	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4 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	41
7.4.1 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权益投资明细	41
7.4.2 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权益投资明细	79
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	79
7.6 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	81
7.7 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	81
7.8 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	81
7.9 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	81
7.10 投资组合报告附注	81
8 基金份额持有人信息	82

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2 期末上市基金前十名持有人	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
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	83
9 开放式基金份额变动	83
10 重大事件揭示	84
10.1 基金份额持有人大会决议	84
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	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
10.4 基金投资策略的改变	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
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	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
10.8 其他重大事件	86
11 影响投资者决策的其他重要信息	87
12 备查文件目录	87
12.1 备查文件目录	87
12.2 存放地点	87
12.3 查阅方式	87

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	123,898,651.00 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	张姗
	联系电话	021-31081600转	0755-83077987
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	zhangshan_1027@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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
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

2.6 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	1,360,012.72
本期利润	23,432,574.64
加权平均基金份额本期利润	0.2099
本期加权平均净值利润率	19.70%
本期基金份额净值增长率	20.35%
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	5,004,714.87
期末可供分配基金份额利润	0.0404

期末基金资产净值	149,082,831.60
期末基金份额净值	1.2033
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.33%

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

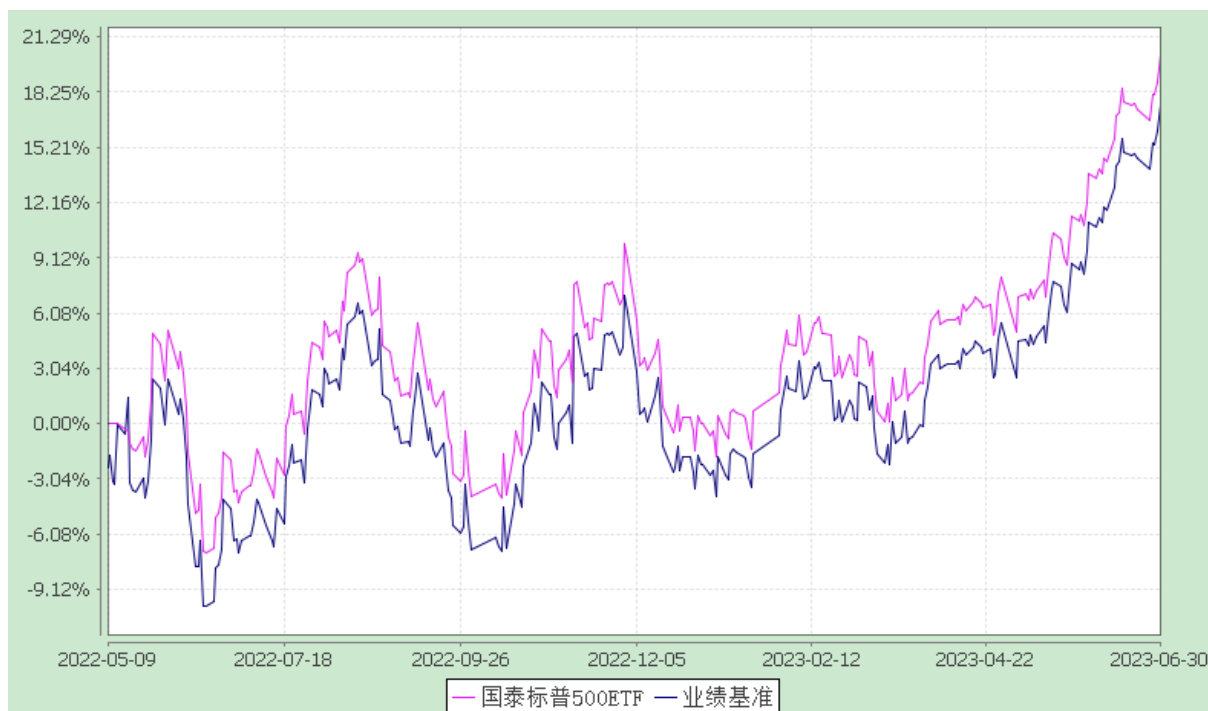
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.53%	0.67%	8.63%	0.68%	-0.10%	-0.01%
过去三个月	13.89%	0.84%	13.88%	0.85%	0.01%	-0.01%
过去六个月	20.35%	0.98%	20.26%	0.97%	0.09%	0.01%
过去一年	25.79%	1.21%	26.58%	1.23%	-0.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	20.33%	1.26%	17.57%	1.35%	2.76%	-0.09%

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 2023 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日为 2022 年 5 月 9 日,在 6 个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

（2）同期业绩比较基准以人民币计价。

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		
徐成城	本基金的基金经理	2022-05-09	2023-05-23	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 月至 2023 年 5 月任纳斯达克 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 月至 2023 年 5 月任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，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 月至 2023 年 5 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的基金经理，2020 年 3 月至 2023 年 5 月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 月至 2023 年 4 月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 月至 2023 年 5 月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 月至 2023 年 5 月任国
--	--	--	--	---

					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 6 月至 2023 年 6 月任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至 2023 年 5 月任国泰中证光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 月至 2023 年 5 月任国泰中证 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 月至 2023 年 4 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 4 月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 月至 2023 年 5 月任国泰标普 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。
艾小军	国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、	2023-05-23	-	22 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限

	国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合、芯片 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接、国泰中证全指证券公司 ETF 联接、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰标普 500ETF、国泰中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监			公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任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)的基金经理,2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理,2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理,2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018 年 12 月至 2019 年 3 月任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)的基金经理,2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 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变更而来)的基金经理,2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 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)的基金经理,2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(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)的基金经理,2019 年 7 月至 2021 年 1 月任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型
--	--	--	--	--	--

					开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起兼任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的基金经理，2020 年 12 月起兼任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）的基金经理，2021 年 5 月起兼任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的基金经理，2023 年 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理，2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程总监。
--	--	--	--	--	--

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

一季度美股震荡上行，不同指数表现有所分化。大盘指数标普 500 上涨 7.0%，周期股为主的道琼斯工业指数上涨 0.4%，科技股为主的纳斯达克指数上涨 16.8%，其中市值排名前 100 家公司组成的纳斯达克 100 指数（本基金跟踪的指数）上涨 20.5%。一季度人民币兑美元升值 0.4%，对本基金人民币计价净值有一定侵蚀。剔除汇率因素后，本基金净值和纳斯达克 100 指数走势高度吻合。1 月美国通胀回落趋势持续，主要经济数据如制造业、服务业 PMI 等不及预期，宽松预期不断强化，市场风险偏好抬升带动股市上涨。2 月 FOMC 如期放缓加息步伐至 25bp，但此后公布的非农就业以及通胀数据均显强劲，零售销售等重要消费指标也显示美国经济增长预期有所修复，叠加美联储 2 月会议纪要重申抗通胀决心，市场修正过于乐观的降息预期，股市出现回落。3 月欧美银行风险引发市场恐慌情绪，市场一度跌超 5%。3 月 FOMC 继续加息 25bp，但对后续紧缩路径措辞有所软化，同时强调银行体系风险可控，市场风险偏好在美国联储及时介入下再度回暖。自 ChatGPT 发布后，生成式人工智能（AIGC）迅速成为新一轮数字产业化变革浪潮，所涉及的产业链已迅速成为全球资本瞩目的焦点，相关公司股价均实现大幅上涨。

二季度强劲的就业数据以及居高不下的通胀显示美国经济仍然保持强劲的复苏态势，地区银行的风险事件短期内没有对美国经济带来过大的冲击，美联储货币政策仍以打击通胀为主要目标；另一方面，以 ChatGPT 为代表的各种人工智能大模型的持续推进，包括算力芯片的强劲需求，边缘端模型、应用插件的推出都对科技股形成较强的支撑，在美国经济保持强劲、科技创新带动下包括纳斯达克、标普 500 等为代表的美国主要股指迭创新高，其中包含主要大型科技股的纳指 100 表现尤为亮眼。全季度来看，纳指 100 指数上涨 15.16%，标普 500 上涨 8.3%。

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 20.35%，同期业绩比较基准收益率为 20.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年我们预计美国通胀水平仍将保持高位，包括产业链重建以及服务业复苏有望支撑就业保持在较高水平，美国经济预计将保持温和复苏态势，但在较高的美国国债利率水平下，美国经济复苏的不确定性预计将加大，美联储货币政策转向停止加息甚至降息的可能性逐步上升；受益人工智能所带来的科技创新红利，我们预计美国市场表现仍然值得期待，以主要科技股为主的纳指 ETF 尤其值得关注。

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

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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,863,191.56	3,133,371.84
结算备付金		0.01	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	140,291,551.87	83,837,669.05
其中：股票投资		135,663,893.32	80,907,218.18
基金投资		4,627,658.55	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		6,828.38	6,581.55
应收股利		77,748.94	57,070.83
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		149,239,320.76	87,034,693.27
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
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		69,322.87	42,511.00
应付托管费		17,330.72	10,627.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,368.80	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	64,466.77	120,000.00
负债合计		156,489.16	1,151,634.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	123,898,651.00	85,898,651.00
未分配利润	6.4.7.8	25,184,180.60	-15,592.29
净资产合计		149,082,831.60	85,883,058.71
负债和净资产总计		149,239,320.76	87,034,693.27

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2033 元，基金份额总额 123,898,651.00 份。

6.2 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：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	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日（基 金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		23,954,999.17	-3,681,459.11
1.利息收入		35,475.86	28,621.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,386.50	28,242.92
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		89.36	379.06
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,775,204.99	2,006,835.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	115,551.32	1,767,985.72
基金投资收益	6.4.7.11	826,449.97	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	833,203.70	238,850.23
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	22,072,561.92	-3,059,169.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		33,903.16	-2,174,312.03
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	37,853.24	-483,435.63
减：二、营业总支出		522,424.53	193,298.89

1. 管理人报酬		353,175.38	124,673.00
2. 托管费		88,293.84	31,168.26
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		3,013.54	-
8. 其他费用	6.4.7.17	77,941.77	37,457.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,432,574.64	-3,874,758.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,432,574.64	-3,874,758.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,432,574.64	-3,874,758.00

注：比较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 6 月 30 日止期间。

6.3 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：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）	85,898,651.00	-15,592.29	85,883,058.71
二、本期期初净资产（基金净值）	85,898,651.00	-15,592.29	85,883,058.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,000,000.00	25,199,772.89	63,199,772.89
（一）、综合收益总额	-	23,432,574.64	23,432,574.64
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	38,000,000.00	1,767,198.25	39,767,198.25

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	50,000,000.00	2,146,785.19	52,146,785.19
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-379,586.94	-12,379,586.94
(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)	123,898,651.00	25,184,180.60	149,082,831.60
项目	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 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)	-	-	-
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)	-169,000,000.00	-3,422,763.08	-172,422,763.08
(一)、综合收益总额	-	-3,874,758.00	-3,874,758.00
(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)	-169,000,000.00	451,994.92	-168,548,005.08
其中: 1.基金申购款	8,000,000.00	-266,430.05	7,733,569.95
2.基金赎回款	-177,000,000.00	718,424.97	-176,281,575.03
(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)	78,898,651.00	-3,422,763.08	75,475,887.92

注: 比较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 6 月 30 日止

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注册的公募基金(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 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 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 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[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。

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	8,863,191.56
等于：本金	8,862,506.88
加：应计利息	684.68
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	8,863,191.56

注：于 2023 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 4,751,992.34 元，美元活期存款 568,866.36 元(折合人民币 4,110,514.54 元)。

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		115,726,587.10	-	135,663,893.32	19,937,306.22
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		3,806,336.36	-	4,627,658.55	821,322.19
其他		-	-	-	-
合计		119,532,923.46	-	140,291,551.87	20,758,628.41

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

本基金本报告期末未持有其他资产余额。

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
合计	64,466.77

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	85,898,651.00	85,898,651.00
本期申购	50,000,000.00	50,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	123,898,651.00	123,898,651.00

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	2,478,671.33	-2,494,263.62	-15,592.29
本期利润	1,360,012.72	22,072,561.92	23,432,574.64
本期基金份额交易产生的变动数	1,166,030.82	601,167.43	1,767,198.25
其中：基金申购款	1,548,166.18	598,619.01	2,146,785.19
基金赎回款	-382,135.36	2,548.42	-379,586.94
本期已分配利润	-	-	-

本期末	5,004,714.87	20,179,465.73	25,184,180.60
-----	--------------	---------------	---------------

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	35,386.50
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	35,386.50

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	11,994,410.42
减：卖出股票成本总额	11,867,636.09
减：交易费用	11,223.01
买卖股票差价收入	115,551.32

6.4.7.10.2 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	12,379,586.94
减：现金支付赎回款总额	12,379,586.94
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	12,349,832.45
减：卖出/赎回基金成本总额	11,487,624.88
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	25,112.84
减：交易费用	10,644.76
基金投资收益	826,449.97

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 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	821,027.84
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	12,175.86
合计	833,203.70

6.4.7.15 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	22,072,561.92
——股票投资	21,114,886.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	957,675.27
——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	22,072,561.92

6.4.7.16 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	-
其它收入_替代损益	36,231.96
其它收入_其他	1,621.28
合计	37,853.24

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。

6.4.7.17 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	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	13,475.00
合计	77,941.77

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国泰基金管理有限公司	基金管理人
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
香港上海汇丰银行有限公司（The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited）	境外资产托管人

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

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	上年度可比期间 2022年5月9日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	353,175.38	124,673.00
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 × 0.6% / 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	上年度可比期间 2022年5月9日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	88,293.84	31,168.26

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 × 0.15% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的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

本基金本报告期及上年度可比期间内均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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国泰标普 500 交 易型开放式指数 证券投资基金发	14,372,500.00	11.60%	8,970,000.00	10.44%

起式联接基金 (QDII)				
------------------	--	--	--	--

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		上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,752,650.36	6,314.76	3,769,444.81	28,215.12
汇丰银行	4,110,541.20	29,071.74	2,053,831.08	27.80

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。

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及上年度可比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

本基金本报告期无利润分配事项。

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

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。

6.4.12.2 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。

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，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，将风险控制在此可承受的范围内。

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招商银行及境外资产托管人香港上海汇丰银行，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 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约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》、《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%，投资于一只境外基金的比例不超过基金资产净值的 20%，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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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。

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	8,863,191.56	-	-	-	8,863,191.56
结算备付金	0.01	-	-	-	0.01
交易性金融资产	-	-	-	140,291,551.87	140,291,551.87
应收清算款	-	-	-	6,828.38	6,828.38
应收股利	-	-	-	77,748.94	77,748.94
资产总计	8,863,191.57	-	-	140,376,129.19	149,239,320.76

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	69,322.87	69,322.87
应付托管费	-	-	-	17,330.72	17,330.72
应交税费	-	-	-	5,368.80	5,368.80
其他负债	-	-	-	64,466.77	64,466.77
负债总计	-	-	-	156,489.16	156,489.16
利率敏感度缺口	8,863,191.57	-	-	140,219,640.03	149,082,831.60
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	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。

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

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	4,110,708.62	4,110,708.62
交易性金融资产	140,291,551.87	140,291,551.87
应收股利	77,748.94	77,748.94
应收证券清算款	6,828.38	6,828.38
资产合计	144,486,837.81	144,486,837.81
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	144,486,837.81	144,486,837.81
项目	上年度末	
	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

6.4.13.4.2.2 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: 人民币万元)	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 722	增加约 427
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 722	减少约 427

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	135,663,893.32	91.00	80,907,218.18	94.21
交易性金融资产—基金投资	4,627,658.55	3.10	2,930,450.87	3.41
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	140,291,551.87	94.10	83,837,669.05	97.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 729	-
	业绩比较基准下降 5%	减少约 729	-

注：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。

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	140,291,551.87	83,837,669.05
第二层次	-	-

第三层次	-	-
合计	140,291,551.87	83,837,669.05

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，本基金申购基金份额的对价总额为 52,146,785.19 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 52,146,785.19 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。

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	135,663,893.32	90.90
	其中：普通股	132,490,726.97	88.78
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	3,173,166.35	2.13
2	基金投资	4,627,658.55	3.10
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	8,863,191.57	5.94
8	其他各项资产	84,577.32	0.06
9	合计	149,239,320.76	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 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	135,663,893.32	91.00
合计	135,663,893.32	91.00

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 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	38,604,432.73	25.89
保健	18,326,554.99	12.29
金融	16,978,344.58	11.39
非必需消费品	14,533,745.12	9.75
通信服务	11,479,623.67	7.70
工业	10,677,682.92	7.16
必需消费品	9,107,062.91	6.11
能源	5,627,733.98	3.77
公用事业	3,518,334.92	2.36
材料	3,410,719.24	2.29
房地产	3,399,658.26	2.28
合计	135,663,893.32	91.00

注：以上行业分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 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

7.4.1 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	7,529.00	10,552,559.26	7.08
2	MICROS OFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达 克	美国	3,786.00	9,316,111.51	6.25
3	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克	美国	4,545.00	4,281,186.78	2.87
4	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克	美国	1,259.00	3,848,332.32	2.58
5	ALPHAB ET INC-CLA	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	3,026.00	2,617,272.91	1.76
6	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克	美国	1,371.00	2,593,243.30	1.74
7	META PLATFO RMS INC-CLA SS A	Meta 平台 股份有限 公司	META US	纳斯达 克	美国	1,127.00	2,337,014.91	1.57
8	ALPHAB ET INC-CLC	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达 克	美国	2,603.00	2,275,295.38	1.53
9	BERKSH IRE HATHAW AY INC-CLB	伯克希尔 哈撒韦公 司	BRK/B US	纽约	美国	909.00	2,239,774.00	1.50
10	UNITED HEALTH GROUP	联合健康 集团	UNH US	纽约	美国	475.00	1,649,679.04	1.11

	INC							
11	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油公司	XOM US	纽约	美国	2,059.00	1,595,657.16	1.07
12	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约	美国	1,324.00	1,583,523.09	1.06
13	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽约	美国	1,489.00	1,564,820.40	1.05
14	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	纽约	美国	825.00	1,415,685.96	0.95
15	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽约	美国	401.00	1,358,891.03	0.91
16	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克	美国	212.00	1,328,789.65	0.89
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	纽约	美国	1,200.00	1,315,731.47	0.88
18	MASTERCARD INC - A	万事达股份有限公司	MA US	纽约	美国	427.00	1,213,494.35	0.81
19	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽约	美国	516.00	1,158,225.22	0.78
20	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约	美国	1,292.00	1,077,250.30	0.72
21	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	纽约	美国	888.00	1,009,637.91	0.68
22	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克	美国	701.00	938,192.24	0.63
23	COSTCO WHOLESALE CORP	开市客	COST US	纳斯达克	美国	225.00	875,300.90	0.59
24	ABBVIE INC	艾伯维公司	ABBV US	纽约	美国	899.00	875,205.30	0.59

25	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	纽约	美国	1,981.00	862,007.74	0.58
26	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克	美国	233.00	823,269.14	0.55
27	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT US	纽约	美国	714.00	810,926.39	0.54
28	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD US	纽约	美国	372.00	802,125.36	0.54
29	CISCO SYSTEMS INC	思科系统股份有限公司	CSCO US	纳斯达克	美国	2,086.00	779,877.99	0.52
30	SALESFORCE INC	Salesforce 股份有限公司	CRM US	纽约	美国	499.00	761,734.73	0.51
31	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约	美国	2,874.00	761,731.70	0.51
32	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	纽约	美国	197.00	742,702.05	0.50
33	BANK OF AMERICA CORP	美国银行公司	BAC US	纽约	美国	3,531.00	732,005.26	0.49
34	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克	美国	226.00	719,333.74	0.48
35	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲公司	ACN US	纽约	美国	321.00	715,745.69	0.48
36	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽约	美国	886.00	697,952.45	0.47
37	LINDE PLC	Linde PLC	LIN US	纽约	美国	250.00	688,401.97	0.46
38	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	820.00	674,934.52	0.45
39	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纽约	美国	783.00	673,787.57	0.45

40	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克	美国	2,119.00	636,191.59	0.43
41	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克	美国	462.00	600,964.29	0.40
42	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公司	DIS US	纽约	美国	930.00	599,961.06	0.40
43	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽约	美国	1,911.00	589,346.94	0.40
44	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	纽约	美国	338.00	586,156.90	0.39
45	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	纽约	美国	2,140.00	575,076.85	0.39
46	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯国际集团公司	PM US	纽约	美国	790.00	557,252.25	0.37
47	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE US	纽约	美国	1,030.00	552,238.99	0.37
48	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	2,123.00	512,982.09	0.34
49	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克	美国	339.00	508,280.84	0.34
50	NIKE INC-CL B	耐克公司	NKE US	纽约	美国	628.00	500,837.25	0.34
51	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	纽约	美国	304.00	495,782.37	0.33
52	BRISTOL-MYERS SQUIBB	百时美施贵宝公司	BMY US	纽约	美国	1,070.00	494,436.20	0.33

	CO							
53	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	567.00	487,710.28	0.33
54	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI US	纽约	美国	167.00	483,757.41	0.32
55	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	纽约	美国	370.00	479,233.12	0.32
56	INTUIT INC	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳斯达克	美国	142.00	470,132.08	0.32
57	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT US	纽约	美国	263.00	467,589.83	0.31
58	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约	美国	617.00	461,926.39	0.31
59	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽约	美国	311.00	459,826.93	0.31
60	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克	美国	430.00	449,099.37	0.30
61	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM US	纽约	美国	462.00	446,700.55	0.30
62	INTUITIVE SURGICAL INC	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克	美国	178.00	439,800.63	0.30
63	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	纽约	美国	554.00	439,739.79	0.29
64	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽约	美国	287.00	437,904.58	0.29
65	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克	美国	272.00	436,362.02	0.29
66	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约	美国	677.00	430,973.45	0.29
67	AT&T	美国电话	T US	纽约	美国	3,640.00	419,515.50	0.28

	INC	电报公司						
68	SERVICE NOW INC	ServiceNow 公司	NOW US	纽约	美国	103.00	418,250.33	0.28
69	STARBUCKS CORP	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克	美国	584.00	418,020.04	0.28
70	PROLOGIS INC	安博	PLD US	纽约	美国	470.00	416,466.93	0.28
71	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	纽约	美国	664.00	409,743.32	0.27
72	DEERE & CO	迪尔	DE US	纽约	美国	137.00	401,111.60	0.27
73	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	纽约	美国	170.00	396,203.62	0.27
74	ELEVANCE HEALTH INC	Elevance 健康股份有限公司	ELV US	纽约	美国	121.00	388,452.43	0.26
75	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	纽约	美国	302.00	380,137.78	0.25
76	BLACKROCK INC	贝莱德有限公司	BLK US	纽约	美国	76.00	379,547.00	0.25
77	STRYKER CORP	史赛克	SYK US	纽约	美国	172.00	379,177.32	0.25
78	BOOKING HOLDINGS INC	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	纳斯达克	美国	19.00	370,728.85	0.25
79	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克	美国	693.00	365,245.55	0.24
80	ANALOG DEVICES INC	亚德诺半导体	ADI US	纳斯达克	美国	257.00	361,768.13	0.24

81	TJX COMPAN IES INC	TJX 公司	TJX US	纽约	美国	587.00	359,640.57	0.24
82	GILEAD SCIENCE S INC	吉利德科 学	GILD US	纳斯达 克	美国	635.00	353,626.68	0.24
83	MARSH & MCLENN AN COS	Marsh & McLennan 股份有限 公司	MMC US	纽约	美国	251.00	341,116.14	0.23
84	AUTOMA TIC DATA PROCES SING	ADP 公司	ADP US	纳斯达 克	美国	210.00	333,513.30	0.22
85	VERTEX PHARM ACEUTI CALS INC	福泰制药	VRTX US	纳斯达 克	美国	131.00	333,110.90	0.22
86	AMERIC AN TOWER CORP	美国发射 塔公司	AMT US	纽约	美国	237.00	332,125.08	0.22
87	CITIGRO UP INC	花旗集团	C US	纽约	美国	991.00	329,681.75	0.22
88	CVS HEALTH CORP	CVS 健康 公司	CVS US	纽约	美国	653.00	326,186.27	0.22
89	LAM RESEAR CH CORP	泛林集团	LRCX US	纳斯达 克	美国	68.00	315,872.09	0.21
90	SCHWAB (CHARL ES) CORP	嘉信理财	SCHW US	纽约	美国	757.00	310,035.67	0.21
91	THE CIGNA GROUP	信诺集团	CI US	纽约	美国	151.00	306,161.48	0.21
92	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	纽约	美国	908.00	297,214.50	0.20
93	T-MOBIL E US INC	T-Mobile US 股份有 限公司	TMUS US	纳斯达 克	美国	294.00	295,077.10	0.20

94	ZOETIS INC	硕腾股份 有限公司	ZTS US	纽约	美国	236.00	293,667.78	0.20
95	CHUBB LTD	邱博保险 集团	CB US	纽约	美国	211.00	293,585.41	0.20
96	EATON CORP PLC	伊顿	ETN US	纽约	美国	202.00	293,527.89	0.20
97	FISERV INC	Fiserv 公司	FI US	纽约	美国	315.00	287,133.42	0.19
98	BOSTON SCIENTI FIC CORP	波士顿科 学	BSX US	纽约	美国	732.00	286,097.46	0.19
99	PROGRE SSIVE CORP	前进保险 公司	PGR US	纽约	美国	298.00	285,030.79	0.19
100	PALO ALTO NETWO RKS INC	Palo Alto Networks 股份有限 公司	PANW US	纳斯达 克	美国	154.00	284,324.68	0.19
101	SOUTHE RN CO/THE	南方公司	SO US	纽约	美国	555.00	281,724.91	0.19
102	REGENE RON PHARM ACEUTI CALS	再生元制 药股份有 限公司	REGN US	纳斯达 克	美国	54.00	280,369.42	0.19
103	BECTON DICKINS ON AND CO	碧迪	BDX US	纽约	美国	144.00	274,706.42	0.18
104	PAYPAL HOLDIN GS INC	Paypal 控 股股份有 限公司	PYPLUS	纳斯达 克	美国	569.00	274,359.07	0.18
105	EQUINIX INC	Equinix 有 限公司	EQIX US	纳斯达 克	美国	47.00	266,235.90	0.18
106	AON PLC-CLA SS A	怡安集团	AON US	纽约	美国	104.00	259,412.00	0.17
107	SCHLUM BERGER LTD	斯伦贝谢 公众有限 公司	SLB US	纽约	美国	725.00	257,325.19	0.17
108	CSX	CSX 公司	CSX US	纳斯达	美国	1,036.00	255,270.17	0.17

	CORP			克				
109	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺伊 工具股份 有限公司	ITW US	纽约	美国	141.00	254,872.46	0.17
110	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK US	纽约	美国	392.00	254,189.77	0.17
111	MICRON TECHNO LOGY INC	美光科技 股份有限 公司	MU US	纳斯达 克	美国	557.00	254,003.27	0.17
112	EOG RESOUR CES INC	EOG 资源	EOG US	纽约	美国	298.00	246,422.32	0.17
113	KLA CORP	KLA 公司	KLAC US	纳斯达 克	美国	70.00	245,326.03	0.16
114	CME GROUP INC	芝加哥商 业交易所	CME US	纳斯达 克	美国	183.00	245,012.93	0.16
115	AIR PRODUC TS & CHEMIC ALS INC	空气产品 公司	APD US	纽约	美国	113.00	244,570.86	0.16
116	SYNOPS YS INC	新思科技 公司	SNPS US	纳斯达 克	美国	77.00	242,256.29	0.16
117	NORTHR OP GRUMM AN CORP	诺斯洛普 格鲁门公 司	NOC US	纽约	美国	73.00	240,426.93	0.16
118	WASTE MANAG EMENT INC	废品管理	WM US	纽约	美国	188.00	235,582.47	0.16
119	CADENC E DESIGN SYS INC	Cadence 设计系统 股份有限 公司	CDNS US	纳斯达 克	美国	139.00	235,548.65	0.16
120	COLGAT E-PALM OLIVE CO	高露洁棕 榄	CL US	纽约	美国	423.00	235,473.79	0.16
121	INTERC ONTINE	洲际交易 所 (ICE)	ICE US	纽约	美国	285.00	232,871.64	0.16

	NTAL EXCHAN GE IN							
122	HCA HEALTH CARE INC	HCA 医疗 保健有限 公司	HCA US	纽约	美国	106.00	232,445.89	0.16
123	SHERWI N-WILLI AMS CO/THE	宣伟公司	SHW US	纽约	美国	119.00	228,312.74	0.15
124	TARGET CORP	塔吉特公 司	TGT US	纽约	美国	235.00	223,974.51	0.15
125	ACTIVIS ION BLIZZAR D INC	动视暴雪 股份有限 公司	ATVI US	纳斯达 克	美国	364.00	221,725.12	0.15
126	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽约	美国	2,001.00	218,762.03	0.15
127	CHIPOTL E MEXICA N GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份 有限公司	CMG US	纽约	美国	14.00	216,383.81	0.15
128	O'REILL Y AUTOM OTIVE INC	O'Reilly 汽 车股份有 限公司	ORLY US	纳斯达 克	美国	31.00	213,987.01	0.14
129	MCKESS ON CORP	McKesson 公司	MCK US	纽约	美国	69.00	213,048.31	0.14
130	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽约	美国	118.00	211,370.55	0.14
131	FREEPO RT-MCM ORAN INC	自由港迈 克墨伦股 份有限公 司	FCX US	纽约	美国	729.00	210,704.33	0.14
132	EDWAR DS LIFESCI ENCES CORP	爱德华生 命科学公 司	EW US	纽约	美国	309.00	210,617.40	0.14
133	HUMAN	Humana 股	HUM US	纽约	美国	63.00	203,544.93	0.14

	A INC	份有限公司						
134	3M CO	3M 公司	MMM US	纽约	美国	280.00	202,504.49	0.14
135	MOODY'S CORP	穆迪	MCO US	纽约	美国	80.00	201,004.41	0.13
136	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM US	纽约	美国	708.00	197,267.81	0.13
137	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克	美国	132.00	195,224.93	0.13
138	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR US	纽约	美国	291.00	190,063.76	0.13
139	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC US	纽约	美国	115.00	188,430.08	0.13
140	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP US	纽约	美国	54.00	187,604.89	0.13
141	AMPHENOL CORP-CLASS A	安费诺公司	APH US	纽约	美国	303.00	185,991.01	0.12
142	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 财务服务	PNC US	纽约	美国	203.00	184,748.17	0.12
143	PARKER HANNIFIN CORP	派克汉尼汾公司	PH US	纽约	美国	65.00	183,192.82	0.12
144	DEXCOM INC	Dexcom 股份有限公司	DXCM US	纳斯达克	美国	197.00	182,931.75	0.12
145	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约	美国	217.00	182,828.64	0.12

146	CROWN CASTLE INC	冠城股份 有限公司	CCI US	纽约	美国	220.00	181,127.68	0.12
147	FORTINET INC	Fortinet 股 份有限公 司	FTNT US	纳斯达 克	美国	331.00	180,791.61	0.12
148	MOTOR OLA SOLUTI ONS INC	摩托罗拉 解决方案 股份有限 公司	MSI US	纽约	美国	85.00	180,130.52	0.12
149	MICROC HIP TECHNO LOGY INC	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达 克	美国	278.00	179,965.92	0.12
150	PIONEER NATURAL RESOUR CES CO	Pioneer 自 然资源公 司	PXD US	纽约	美国	120.00	179,644.95	0.12
151	GENERAL DYNAMI CS CORP	通用动力	GD US	纽约	美国	114.00	177,227.92	0.12
152	MARRIOTT INTERN ATIONAL -CL A	万豪国际	MAR US	纳斯达 克	美国	132.00	175,204.55	0.12
153	ARTHUR J GALLAG HER & CO	亚瑟加拉 格尔有限 公司	AJG US	纽约	美国	109.00	172,936.01	0.12
154	JOHNSON CONTRO LS INTERN ATION	江森自控 国际有限 公司	JCI US	纽约	美国	349.00	171,835.74	0.12
155	KIMBERLY-CLARK CORP	金佰利	KMB US	纽约	美国	171.00	170,588.57	0.11
156	ECOLAB INC	艺康集团	ECL US	纽约	美国	126.00	169,972.06	0.11

157	US BANCOR P	美国合众 银行	USB US	纽约	美国	710.00	169,505.71	0.11
158	PUBLIC STORAG E	公共存储 公司	PSA US	纽约	美国	80.00	168,725.32	0.11
159	SEMPRA ENERGY	桑普拉能 源	SRE US	纽约	美国	160.00	168,320.68	0.11
160	TRANSD IGM GROUP INC	TransDigm 集团公司	TDG US	纽约	美国	26.00	167,988.43	0.11
161	ESTEE LAUDER COMPAN IES-CL A	雅诗兰黛	EL US	纽约	美国	118.00	167,442.31	0.11
162	GENERA L MILLS INC	通用磨坊	GIS US	纽约	美国	299.00	165,711.44	0.11
163	AUTOZO NE INC	AutoZone 股份有限 公司	AZO US	纽约	美国	9.00	162,148.69	0.11
164	TE CONNEC TIVITY LTD	泰科电子 公司	TEL US	纽约	美国	160.00	162,042.90	0.11
165	MONSTE R BEVERA GE CORP	怪兽饮料 公司	MNST US	纳斯达 克	美国	389.00	161,454.43	0.11
166	PHILLIP S 66	Phillips 66	PSX US	纽约	美国	234.00	161,272.05	0.11
167	AUTODE SK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达 克	美国	109.00	161,153.33	0.11
168	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达 克	美国	266.00	160,780.55	0.11
169	TRANE TECHNO LOGIES PLC	特灵科技 公共有限 公司	TT US	纽约	美国	116.00	160,312.75	0.11
170	AMERIC AN ELECTRI C POWER	美国电力	AEP US	纳斯达 克	美国	262.00	159,404.04	0.11

171	DOMINION ENERGY INC	Dominion 能源股份有限公司	D US	纽约	美国	425.00	159,045.28	0.11
172	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达克	美国	44.00	158,039.23	0.11
173	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	纽约	美国	185.00	156,803.47	0.11
174	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽约	美国	366.00	155,505.00	0.10
175	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG US	纽约	美国	369.00	153,420.06	0.10
176	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF US	纽约	美国	194.00	153,315.43	0.10
177	IQVIA HOLDINGS INC	艾昆纬	IQV US	纽约	美国	94.00	152,669.45	0.10
178	CARRIER GLOBAL CORP	开利全球公司	CARR US	纽约	美国	425.00	152,657.67	0.10
179	IDEX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克	美国	42.00	152,418.57	0.10
180	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Dan iels-Midland 公司	ADM US	纽约	美国	278.00	151,782.84	0.10
181	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	纽约	美国	128.00	151,665.50	0.10
182	BIOGEN INC	渤健公司	BIIB US	纳斯达克	美国	73.00	150,253.65	0.10
183	CORTEVA INC	科迪华公司	CTVA US	纽约	美国	362.00	149,881.88	0.10
184	ON	安森美半	ON US	纳斯达克	美国	219.00	149,668.14	0.10

	SEMICO DUCTO R	导体公司		克				
185	EXELON CORP	Exelon 公 司	EXC US	纳斯达 克	美国	506.00	148,955.82	0.10
186	ARISTA NETWO RKS INC	Arista 网络 股份有限 公司	ANET US	纽约	美国	127.00	148,718.67	0.10
187	TRUIST FINANCI AL CORP	Truist 金融 公司	TFC US	纽约	美国	678.00	148,687.45	0.10
188	WELLTO WER INC	Welltower Inc	WELL US	纽约	美国	253.00	147,877.23	0.10
189	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公 司	O US	纽约	美国	342.00	147,754.46	0.10
190	TRAVEL ERS COS INC/THE	旅行家集 团	TRV US	纽约	美国	117.00	146,815.39	0.10
191	MODER NA INC	莫德纳公 司	MRNA US	纳斯达 克	美国	167.00	146,615.09	0.10
192	WILLIA MS COS INC	威廉姆斯 公司	WMB US	纽约	美国	620.00	146,182.27	0.10
193	CONSTE LLATION BRANDS INC-A	星座品牌 股份有限 公司	STZ US	纽约	美国	82.00	145,835.86	0.10
194	COPART INC	Copart 股 份有限公 司	CPRT US	纳斯达 克	美国	218.00	143,676.22	0.10
195	YUM! BRANDS INC	百胜餐饮 集团	YUM US	纽约	美国	142.00	142,161.11	0.10
196	HILTON WORLD WIDE HOLDIN GS IN	希尔顿全 球控股股 份有限公 司	HLT US	纽约	美国	135.00	141,981.55	0.10
197	ROSS STORES INC	罗斯百货 股份有限 公司	ROST US	纳斯达 克	美国	175.00	141,790.07	0.10
198	AFLAC INC	家庭人寿 保险	AFL US	纽约	美国	280.00	141,221.04	0.09

199	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	Charter 通信公司	CHTR US	纳斯达克	美国	53.00	140,690.73	0.09
200	DR HORTON INC	霍顿房屋公司	DHI US	纽约	美国	158.00	138,930.60	0.09
201	DOW INC	陶氏公司	DOW US	纽约	美国	360.00	138,544.60	0.09
202	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG US	纽约	美国	166.00	138,516.27	0.09
203	HESS CORP	赫斯公司	HES US	纽约	美国	141.00	138,511.00	0.09
204	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU US	纽约	美国	258.00	138,327.82	0.09
205	ROCKWELL AUTOMATION INC	罗克韦尔自动化	ROK US	纽约	美国	58.00	138,071.31	0.09
206	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG US	纽约	美国	112.00	137,401.19	0.09
207	AMETEK INC	阿美特克股份有限公司	AME US	纽约	美国	117.00	136,856.36	0.09
208	CENTENE CORP	Centene 公司	CNC US	纽约	美国	280.00	136,466.46	0.09
209	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX US	纽约	美国	96.00	135,801.11	0.09
210	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI US	纽约	美国	40.00	135,639.83	0.09
211	HERSHEY CO/THE	好时公司	HSY US	纽约	美国	75.00	135,321.17	0.09
212	OTIS WORLD	奥的斯电梯公司	OTIS US	纽约	美国	210.00	135,065.38	0.09

	WIDE CORP							
213	METLIFE INC	大都会集团	MET US	纽约	美国	328.00	133,979.63	0.09
214	COSTAR GROUP INC	CoStar 集团股份有限公司	CSGP US	纳斯达克	美国	208.00	133,764.01	0.09
215	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克	美国	163.00	131,761.09	0.09
216	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦	A US	纽约	美国	150.00	130,335.37	0.09
217	CUMMINS INC	康明斯	CMI US	纽约	美国	72.00	127,546.35	0.09
218	PPG INDUSTRIES INC	PPG 工业	PPG US	纽约	美国	119.00	127,518.75	0.09
219	AMERIPRISE FINANCIAL INC	阿默普莱斯金融公司	AMP US	纽约	美国	53.00	127,206.45	0.09
220	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达克	美国	280.00	125,783.84	0.08
221	WW GRAINGER INC	固安捷股份有限公司	GWV US	纽约	美国	22.00	125,360.26	0.08
222	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽约	美国	1,005.00	125,050.42	0.08
223	NEWMONT CORP	纽蒙黄金公司	NEM US	纽约	美国	404.00	124,534.06	0.08
224	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA US	纳斯达克	美国	132.00	123,708.59	0.08
225	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST US	纳斯达克	美国	290.00	123,612.48	0.08
226	OLD DOMINION FREIGHT	Old Dominion Freight Line 股份	ODFL US	纳斯达克	美国	46.00	122,900.02	0.08

	LINE	有限公司						
227	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地 产信托有 限公司	DLR US	纽约	美国	148.00	121,774.67	0.08
228	COGNIZ ANT TECH SOLUTI ONS-A	高知特科 技公司	CTSH US	纳斯达 克	美国	258.00	121,698.66	0.08
229	VERISK ANALYT ICS INC	Verisk 分析 公司	VRSK US	纳斯达 克	美国	74.00	120,860.32	0.08
230	DUPONT DE NEMOU RS INC	杜邦公司	DD US	纽约	美国	233.00	120,277.20	0.08
231	FIDELIT Y NATION AL INFO SERV	繁德信息 技术有限 公司	FIS US	纽约	美国	301.00	118,970.63	0.08
232	PRUDEN TIAL FINANCI AL INC	保德信金 融集团	PRU US	纽约	美国	186.00	118,567.57	0.08
233	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆 银行股份 有限公司	BK US	纽约	美国	366.00	117,739.50	0.08
234	BAKER HUGHES CO	贝克休斯 公司	BKR US	纳斯达 克	美国	515.00	117,629.88	0.08
235	RESMED INC	瑞思迈股 份有限公 司	RMD US	纽约	美国	74.00	116,833.96	0.08
236	LENNAR CORP-A	Lennar 公 司	LEN US	纽约	美国	129.00	116,804.98	0.08
237	VICI PROPER TIES INC	VICI Properties 股份有限 公司	VICI US	纽约	美国	511.00	116,051.62	0.08
238	CONSOL IDATED	联合爱迪 生	ED US	纽约	美国	177.00	115,618.58	0.08

	EDISON INC							
239	REPUBLIC SERVICE S INC	公共服务 公司	RSG US	纽约	美国	104.00	115,104.68	0.08
240	PUBLIC SERVICE ENTERP RISE GP	公共服务 企业集团	PEG US	纽约	美国	254.00	114,911.46	0.08
241	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN US	纽约	美国	327.00	114,219.52	0.08
242	AMERIS OURCEB ERGEN CORP	美源伯根	ABC US	纽约	美国	82.00	114,017.78	0.08
243	KROGER CO	克罗格公 司	KR US	纽约	美国	332.00	112,751.38	0.08
244	UNITED RENTAL S INC	联合租赁 公司	URI US	纽约	美国	35.00	112,635.41	0.08
245	DELTA AIR LINES INC	达美航空 有限公司	DAL US	纽约	美国	327.00	112,329.25	0.08
246	ZIMMER BIOMET HOLDIN GS INC	捷迈邦美 控股股份 有限公司	ZBH US	纽约	美国	106.00	111,520.11	0.07
247	CONSTE LLATION ENERGY	美国联合 能源公司	CEG US	纳斯达克	美国	166.00	109,812.65	0.07
248	DISCOV ER FINANCIAL SERVICE S	Discover 金 融服务公 司	DFS US	纽约	美国	130.00	109,763.51	0.07
249	HALLIB URTON CO	哈利伯顿	HAL US	纽约	美国	459.00	109,416.03	0.07
250	VULCAN MATERI ALS CO	Vulcan 材 料	VMC US	纽约	美国	67.00	109,141.95	0.07

251	KEYSIG HT TECHNO LOGIES IN	是德科技 公司	KEYS US	纽约	美国	90.00	108,896.42	0.07
252	DOLLAR TREE INC	美元树公 司	DLTR US	纳斯达 克	美国	105.00	108,874.74	0.07
253	GE HEALTH CARE TECHNO LOGY	GE HealthCare Technologi es Inc	GEHC US	纳斯达 克	美国	185.00	108,599.44	0.07
254	ILLUMIN A INC	Illumina 公 司	ILMN US	纳斯达 克	美国	80.00	108,381.22	0.07
255	EQUIFA X INC	Equifax 股 份有限公 司	EFX US	纽约	美国	62.00	105,414.31	0.07
256	ANSYS INC	ANSYS 股 份有限公 司	ANSS US	纳斯达 克	美国	44.00	105,004.46	0.07
257	ALLSTAT E CORP	好事达保 险公司	ALL US	纽约	美国	133.00	104,790.86	0.07
258	METTLE R-TOLED O INTERN ATIONA L	梅特勒-托 利多国际 股份有限 公司	MTD US	纽约	美国	11.00	104,254.13	0.07
259	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏 公司	KHC US	纳斯达 克	美国	406.00	104,145.46	0.07
260	QUANTA SERVICE S INC	Quanta 服 务股份有 限公司	PWR US	纽约	美国	73.00	103,624.11	0.07
261	MARTIN MARIET TA MATERI ALS	Martin Marietta 材料股份 有限公司	MLM US	纽约	美国	31.00	103,418.47	0.07
262	P G & E CORP	太平洋煤 气电力	PCG US	纽约	美国	823.00	102,761.28	0.07
263	WEST PHARM ACEUTI	西氏医药 服务公司	WST US	纽约	美国	37.00	102,255.11	0.07

	CAL SERVICE S							
264	ARCH CAPITAL GROUP LTD	阿契资本 集团	ACGL US	纳斯达 克	美国	189.00	102,220.86	0.07
265	WARNER BROS DISCOV ERY INC	华纳兄弟 探索股份 有限公司	WBD US	纳斯达 克	美国	1,128.00	102,209.81	0.07
266	AMERIC AN WATER WORKS CO INC	美国自来 水股份有 限公司	AWK US	纽约	美国	99.00	102,116.81	0.07
267	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源 集团股份 有限公司	WEC US	纽约	美国	160.00	102,016.73	0.07
268	GARTNE R INC	Gartner 公 司	IT US	纽约	美国	40.00	101,250.80	0.07
269	ONEOK INC	Oneok 股 份有限公 司	OKE US	纽约	美国	227.00	101,236.64	0.07
270	APTIV PLC	Aptiv 公共 有限公司	APTUS	纽约	美国	137.00	101,062.42	0.07
271	CORNIN G INC	康宁公司	GLW US	纽约	美国	389.00	98,491.70	0.07
272	AVALON BAY COMMU NITIES INC	AvalonBay 社区股份 有限公司	AVB US	纽约	美国	72.00	98,469.16	0.07
273	XYLEM INC	赛莱默公 司	XYL US	纽约	美国	121.00	98,466.12	0.07
274	HP INC	惠普	HPQ US	纽约	美国	441.00	97,859.80	0.07
275	EDISON INTERN ATIONA L	爱迪生国 际	EIX US	纽约	美国	195.00	97,857.20	0.07
276	FORTIVE CORP	福迪威公 司	FTVUS	纽约	美国	180.00	97,249.15	0.07
277	KEURIG	Keurig Dr	KDP US	纳斯达	美国	429.00	96,932.88	0.07

	DR PEPPER INC	Pepper 有 限公司		克				
278	INGERS OLL-RAN D INC	英格索兰 股份有限 公司	IR US	纽约	美国	205.00	96,817.05	0.06
279	ALBEMA RLE CORP	雅保公司	ALB US	纽约	美国	59.00	95,108.22	0.06
280	GLOBAL PAYMEN TS INC	环汇有限 公司	GPN US	纽约	美国	133.00	94,680.81	0.06
281	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理 仕	CBRE US	纽约	美国	159.00	92,727.90	0.06
282	T ROWE PRICE GROUP INC	普徕仕	TROW US	纳斯达 克	美国	114.00	92,275.49	0.06
283	SBA COMMUN ICATION S CORP	SBA 通信 公司	SBAC US	纳斯达 克	美国	55.00	92,105.83	0.06
284	ALIGN TECHNO LOGY INC	Align 科技 股份有限 公司	ALGN US	纳斯达 克	美国	36.00	91,991.95	0.06
285	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿 惠悦公共 有限公司	WTW US	纳斯达 克	美国	54.00	91,890.50	0.06
286	EVERSO URCE ENERGY	Eversource 能源公司	ES US	纽约	美国	177.00	90,704.31	0.06
287	STATE STREET CORP	道富集团	STT US	纽约	美国	171.00	90,422.07	0.06
288	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达 克	美国	68.00	90,163.53	0.06
289	WEYER HAEUSE R CO	惠好	WY US	纽约	美国	372.00	90,074.80	0.06
290	CHURCH & DWIGHT	切迟杜威 股份有限 公司	CHD US	纽约	美国	124.00	89,806.00	0.06

	CO INC							
291	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供 应公司	TSCO US	纳斯达 克	美国	56.00	89,466.97	0.06
292	CARDINAL HEALTH INC	嘉德诺健 康集团	CAH US	纽约	美国	130.00	88,834.71	0.06
293	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股 份有限公司	FANG US	纳斯达 克	美国	93.00	88,273.84	0.06
294	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达 克	美国	273.00	88,157.43	0.06
295	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC US	纽约	美国	71.00	86,820.37	0.06
296	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系统 有限公司	MPWR US	纳斯达 克	美国	22.00	85,879.07	0.06
297	LYONDELL BASELL INDUSTRIAL	利安德巴 塞尔工业 公司	LYB US	纽约	美国	129.00	85,597.33	0.06
298	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	Take-Two 互动软件 股份有限 公司	TTWO US	纳斯达 克	美国	80.00	85,067.90	0.06
299	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美容 产品公司	ULTAUS	纳斯达 克	美国	25.00	85,010.67	0.06
300	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	纽约	美国	257.00	84,606.31	0.06
301	ENPHASE ENERGY	Enphase 能 源股份有 限公司	ENPH US	纳斯达 克	美国	69.00	83,502.21	0.06

	INC							
302	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL US	纽约	美国	111.00	83,206.10	0.06
303	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE US	纽约	美国	104.00	82,678.18	0.06
304	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR US	纽约	美国	173.00	82,466.68	0.06
305	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	哈特福德金融服务	HIG US	纽约	美国	158.00	82,223.53	0.06
306	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	纽约	美国	50.00	81,283.02	0.05
307	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC US	纽约	美国	127.00	80,048.93	0.05
308	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE US	纽约	美国	659.00	79,998.28	0.05
309	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航空	LUV US	纽约	美国	303.00	79,278.80	0.05
310	AMEREN CORPORATION	Ameren 公司	AEE US	纽约	美国	133.00	78,487.43	0.05
311	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	美国实验控股	LH US	纽约	美国	45.00	78,471.10	0.05
312	FIRSTENERGY	第一能源	FE US	纽约	美国	277.00	77,820.13	0.05

	ERGY CORP							
313	M & T BANK CORP	M&T 银行	MTB US	纽约	美国	85.00	76,012.53	0.05
314	DOVER CORP	都福	DOV US	纽约	美国	71.00	75,749.15	0.05
315	ENTERGY CORP	Entergy 公 司	ETR US	纽约	美国	107.00	75,282.65	0.05
316	VERISIG N INC	威瑞信股 份有限公 司	VRSN US	纳斯达 克	美国	46.00	75,109.45	0.05
317	WALGRE ENS BOOTS ALLIAN CE INC	沃博联股 份有限公 司	WBA US	纳斯达 克	美国	364.00	74,934.15	0.05
318	INTL FLAVOR S & FRAGRA NCES	国际香料	IFF US	纽约	美国	129.00	74,188.08	0.05
319	DARDEN RESTAU RANTS INC	达登餐饮 公司	DRI US	纽约	美国	61.00	73,644.49	0.05
320	INVITATI ON HOMES INC	邀请家园 公司	INVH US	纽约	美国	296.00	73,575.99	0.05
321	RAYMO ND JAMES FINANCI AL INC	Raymond James 金 融股份有 限公司	RJF US	纽约	美国	98.00	73,482.48	0.05
322	EXTRA SPACE STORAG E INC	Extra Space Storage 有 限公司	EXR US	纽约	美国	68.00	73,138.10	0.05
323	HOLOGI C INC	豪洛捷公 司	HOLX US	纳斯达 克	美国	125.00	73,134.13	0.05
324	INSULET CORP	Insulet 股 份有限公 司	PODD US	纳斯达 克	美国	35.00	72,922.05	0.05
325	WABTEC	西屋制动	WAB US	纽约	美国	92.00	72,905.72	0.05

	CORP	公司						
326	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR US	纽约	美国	60.00	71,808.56	0.05
327	PPL CORP	PPL 公司	PPL US	纽约	美国	375.00	71,698.00	0.05
328	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX US	纽约	美国	62.00	71,249.86	0.05
329	COTERRA ENERGY INC	Coterra 能源股份有限公司	CTRAUS	纽约	美国	386.00	70,565.72	0.05
330	FAIR ISAAC CORP	费埃哲公司	FICO US	纽约	美国	12.00	70,166.28	0.05
331	OMNICO M GROUP	Omnicom 集团	OMC US	纽约	美国	102.00	70,128.56	0.05
332	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙集团	LVS US	纽约	美国	167.00	69,989.10	0.05
333	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL US	纽约	美国	511.00	69,527.59	0.05
334	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR US	纽约	美国	203.00	69,337.40	0.05
335	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限公司	COO US	纽约	美国	25.00	69,264.71	0.05
336	FIRST SOLAR INC	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克	美国	50.00	68,677.62	0.05
337	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	Teledyne 科技股份有限公司	TDY US	纽约	美国	23.00	68,323.77	0.05
338	EXPEDITORS INTL WASH	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纳斯达克	美国	78.00	68,270.37	0.05

	INC							
339	CENTER POINT ENERGY INC	中点能源	CNP US	纽约	美国	321.00	67,612.89	0.05
340	BALL CORP	波尔	BALL US	纽约	美国	160.00	67,298.21	0.05
341	FLEETC OR TECHNO LOGIES INC	FleetCor 技 术股份有 限公司	FLT US	纽约	美国	37.00	67,127.39	0.05
342	HOWME T AEROSP ACE INC	Howmet 航 空航天股 份有限公 司	HWM US	纽约	美国	187.00	66,966.69	0.04
343	UNITED AIRLINE S HOLDIN GS INC	美国联合 航空控股 股份有限 公司	UAL US	纳斯达 克	美国	167.00	66,212.10	0.04
344	FIFTH THIRD BANCOR P	五三银行	FITB US	纳斯达 克	美国	347.00	65,717.71	0.04
345	ALEXAN DRIA REAL ESTATE EQUIT	亚历山大 房地产股 份有限公 司	ARE US	纽约	美国	80.00	65,604.48	0.04
346	SKYWO RKS SOLUTI ONS INC	思佳讯解 决方案公 司	SWKS US	纳斯达 克	美国	81.00	64,785.73	0.04
347	MID-AM ERICA APARTM ENT COMM	Mid-Ameri ca Apartment Communiti es 股份有 限公司	MAA US	纽约	美国	59.00	64,741.29	0.04
348	Steel Dynamics	Steel Dynamics 股份有限 公司	STLD US	纳斯达 克	美国	82.00	64,542.72	0.04
349	PULTEG	Pulte 集团	PHM US	纽约	美国	114.00	63,988.22	0.04

	ROUP INC	公司						
350	TERADY NE INC	泰瑞达	TER US	纳斯达克 克	美国	79.00	63,551.42	0.04
351	KELLOG G CO	家乐氏	K US	纽约	美国	130.00	63,312.46	0.04
352	TARGA RESOUR CES CORP	Targa 资源 公司	TRGP US	纽约	美国	115.00	63,236.59	0.04
353	TYLER TECHNO LOGIES INC	Tyler 科技 公司	TYL US	纽约	美国	21.00	63,195.91	0.04
354	MOLINA HEALTH CARE INC	Molina Healthcare 股份有限 公司	MOH US	纽约	美国	29.00	63,124.30	0.04
355	PRINCIP AL FINANCI AL GROUP	信安金融	PFG US	纳斯达克 克	美国	115.00	63,020.54	0.04
356	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS US	纽约	美国	148.00	62,828.33	0.04
357	NASDAQ INC	纳斯达克 股份有限 公司	NDAQ US	纳斯达克 克	美国	172.00	61,955.45	0.04
358	LAMB WESTON HOLDIN GS INC	蓝威斯顿 控股股份 有限公司	LW US	纽约	美国	74.00	61,464.82	0.04
359	REGION S FINANCI AL CORP	地区金融 公司	RF US	纽约	美国	477.00	61,420.31	0.04
360	ATMOS ENERGY CORP	Atmos 能 源公司	ATO US	纽约	美国	73.00	61,367.42	0.04
361	IRON MOUNT AIN INC	美国铁山 公司	IRM US	纽约	美国	148.00	60,764.35	0.04
362	NETAPP INC	美国网域 存储技术	NTAP US	纳斯达克 克	美国	109.00	60,173.57	0.04

		有限公司						
363	BEST BUY CO INC	百思买	BBY US	纽约	美国	100.00	59,215.43	0.04
364	BROWN & BROWN INC	Brown & Brown 股 份有限公 司	BRO US	纽约	美国	119.00	59,193.46	0.04
365	IDEX CORP	艺达思集 团	IEX US	纽约	美国	38.00	59,106.18	0.04
366	CONAGR A BRANDS INC	康尼格拉 品牌股份 有限公司	CAG US	纽约	美国	242.00	58,964.26	0.04
367	GARMIN LTD	佳明有限 公司	GRMN US	纽约	美国	77.00	58,025.56	0.04
368	QUEST DIAGNO STICS INC	Quest Diagnostics 股份有限 公司	DGX US	纽约	美国	57.00	57,892.53	0.04
369	WATERS CORP	沃特世公 司	WAT US	纽约	美国	30.00	57,778.94	0.04
370	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集 团股份有 限公司	EXPE US	纳斯达 克	美国	73.00	57,701.41	0.04
371	JM SMUCKE R CO/THE	JM 斯马克 公司	SJM US	纽约	美国	54.00	57,619.83	0.04
372	HUNTIN GTON BANCSH ARES INC	俄亥俄州 亨廷顿银 行控股公 司	HBAN US	纳斯达 克	美国	735.00	57,252.18	0.04
373	NORTHE RN TRUST CORP	北美信托	NTRS US	纳斯达 克	美国	106.00	56,786.41	0.04
374	CINCINN ATI FINANCI AL CORP	辛辛那提 金融	CINF US	纳斯达 克	美国	80.00	56,257.19	0.04
375	SNAP-O N INC	实耐宝	SNA US	纽约	美国	27.00	56,224.89	0.04

376	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom 软件股份有限公司	PAYC US	纽约	美国	24.00	55,709.18	0.04
377	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CLASS A	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克	美国	26.00	55,577.82	0.04
378	PTC INC	PTC 公司	PTC US	纳斯达克	美国	54.00	55,524.49	0.04
379	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS US	纽约	美国	19.00	55,005.32	0.04
380	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	185.00	54,981.47	0.04
381	JACOBS SOLUTIONS INC	Jacobs Solutions Inc	J US	纽约	美国	64.00	54,980.82	0.04
382	HUNT (JB) TRANSPORT SVCS INC	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT US	纳斯达克	美国	42.00	54,939.64	0.04
383	REVVITY INC	Revvity 股份有限公司	RVTY US	纽约	美国	64.00	54,934.58	0.04
384	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	Interpublic 集团	IPG US	纽约	美国	197.00	54,917.96	0.04
385	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	SolarEdge 科技股份有限公司	SEDG US	纳斯达克	美国	28.00	54,434.84	0.04
386	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ US	纳斯达克	美国	129.00	54,315.11	0.04
387	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯房地产信托公司	ESS US	纽约	美国	32.00	54,176.16	0.04

388	AMCOR PLC	安姆科公 司	AMCR US	纽约	美国	750.00	54,085.11	0.04
389	SYNCHR ONY FINANCIAL	同步金融 公司	SYF US	纽约	美国	219.00	53,676.71	0.04
390	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品 公司	TSN US	纽约	美国	145.00	53,476.70	0.04
391	CBOE GLOBAL MARKET S INC	Cboe 环球 市场公司	CBOE US	芝加哥	美国	53.00	52,853.33	0.04
392	MARATH ON OIL CORP	Marathon 石油公司	MRO US	纽约	美国	315.00	52,396.44	0.04
393	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百 得公司	SWK US	纽约	美国	77.00	52,138.99	0.03
394	EVERES TRE GROUP LTD	安富来集 团有限公 司	RE US	纽约	美国	21.00	51,874.45	0.03
395	BUNGE LTD	邦吉有限 公司	BG US	纽约	美国	76.00	51,813.32	0.03
396	POOL CORP	Pool 公司	POOL US	纳斯达克	美国	19.00	51,434.40	0.03
397	AES CORP	爱伊斯公 司	AES US	纽约	美国	340.00	50,928.88	0.03
398	AVERY DENNIS ON CORP	艾利丹尼 森	AVY US	纽约	美国	41.00	50,897.09	0.03
399	AKAMAI TECHNO LOGIES INC	阿卡迈技 术公司	AKAM US	纳斯达克	美国	78.00	50,651.85	0.03
400	TEXTRO N INC	德事隆	TXT US	纽约	美国	103.00	50,334.13	0.03
401	CF INDUST RIES	CF 工业控 股股份有 限公司	CF US	纽约	美国	99.00	49,659.89	0.03

	HOLDING GS INC							
402	AXON ENTERPRISE INC	Axon Enterprise 股份有限 公司	AXON US	纳斯达 克	美国	35.00	49,346.43	0.03
403	EVERGY INC	Evergy 股 份有限公 司	EVERG US	纳斯达 克	美国	116.00	48,967.22	0.03
404	MGM RESORTS INTERN ATIONA L	美高梅国 际酒店集 团	MGM US	纽约	美国	154.00	48,873.00	0.03
405	UDR INC	UDR 公司	UDR US	纽约	美国	157.00	48,736.00	0.03
406	ALLIAN T ENERGY CORP	Alliant 能 源公司	LNT US	纳斯达 克	美国	128.00	48,538.88	0.03
407	NORDSON CORP	诺信公司	NDSN US	纳斯达 克	美国	27.00	48,419.07	0.03
408	CARMAX INC	CarMax 股 份有限公 司	KMX US	纽约	美国	80.00	48,383.96	0.03
409	FMC CORP	FMC 公司	FMC US	纽约	美国	64.00	48,252.16	0.03
410	TRIMBLE INC	天宝股份 有限公司	TRMB US	纳斯达 克	美国	126.00	48,199.27	0.03
411	LIVE NATION ENTERT AINMEN T INC	Live Nation 娱 乐公司	LYV US	纽约	美国	73.00	48,059.01	0.03
412	MASCO CORP	马斯可	MAS US	纽约	美国	114.00	47,266.27	0.03
413	BIO-TECH NE CORP	Bio-techn e 公司	TECH US	纳斯达 克	美国	80.00	47,187.36	0.03
414	EPAM SYSTEM S INC	EPAM 系 统公司	EPAM US	纽约	美国	29.00	47,095.96	0.03
415	CITIZEN S	公民金融 集团股份	CFG US	纽约	美国	247.00	46,546.87	0.03

	FINANCIAL GROUP	有限公司						
416	NVR INC	NVR 股份有限公司	NVR US	纽约	美国	1.00	45,888.31	0.03
417	MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	纽约	美国	95.00	45,195.93	0.03
418	KIMCO REALTY CORP	Kimco Realty Corp	KIM US	纽约	美国	315.00	44,885.22	0.03
419	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	百富门公司	BF/B US	纽约	美国	93.00	44,876.12	0.03
420	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克	美国	37.00	44,736.45	0.03
421	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC US	纳斯达克	美国	162.00	44,400.08	0.03
422	WR BERKLEY CORP	WR Berkley 公司	WRB US	纽约	美国	103.00	44,327.97	0.03
423	HOST HOTELS & RESORTS INC	Host 酒店及度假股份有限公司	HST US	纳斯达克	美国	363.00	44,144.51	0.03
424	LEIDOS HOLDINGS INC	Leidos 控股公司	LDOS US	纽约	美国	69.00	44,114.38	0.03
425	VIATRIS INC	晖致	VTRS US	纳斯达克	美国	611.00	44,061.34	0.03
426	PACKAGING CORP OF AMERICA	美国包装公司	PKG US	纽约	美国	46.00	43,928.24	0.03

427	DOMINO'S PIZZA INC	达美乐披萨公司	DPZ US	纽约	美国	18.00	43,830.40	0.03
428	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	Seagate Technology 控股公共有限公司	STX US	纳斯达克	美国	98.00	43,811.90	0.03
429	CAMDEN PROPER TY TRUST	Camden 房地产信托公司	CPT US	纽约	美国	55.00	43,267.01	0.03
430	AMERICAN AIRLINE S GROUP INC	美国航空集团公司	AAL US	纳斯达克	美国	332.00	43,037.44	0.03
431	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS US	纽约	美国	170.00	42,993.51	0.03
432	MATCH GROUP INC	Match 集团股份有限公司	MTCH US	纳斯达克	美国	142.00	42,940.76	0.03
433	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品有限公司	HRL US	纽约	美国	147.00	42,721.39	0.03
434	INCYTE CORP	因赛特公司	INCY US	纳斯达克	美国	94.00	42,281.77	0.03
435	BORGWARNER INC	博格华纳股份有限公司	BWA US	纽约	美国	119.00	42,056.25	0.03
436	CELANESE CORP	塞拉尼斯公司	CE US	纽约	美国	50.00	41,837.38	0.03
437	LOEWS CORP	罗斯公司	L US	纽约	美国	97.00	41,619.60	0.03
438	NISOURCE INC	NiSource 公司	NI US	纽约	美国	210.00	41,501.38	0.03
439	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP US	纽约	美国	177.00	40,683.93	0.03
440	HEALTH PEAK PROPER	Healthpeak Properties Inc	PEAK US	纽约	美国	278.00	40,376.33	0.03

	TIES INC							
441	TELEFLEX INC	泰利福公司	TFX US	纽约	美国	23.00	40,223.79	0.03
442	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW US	纳斯达克	美国	59.00	40,223.50	0.03
443	CAESARS ENTERTAINMENT INC	凯撒娱乐集团	CZR US	纳斯达克	美国	109.00	40,144.59	0.03
444	WYNN RESORTS LTD	永利渡假村有限公司	WYNN US	纳斯达克	美国	52.00	39,682.07	0.03
445	CHARLES RIVER LABORATORIES	查理斯河实验室国际有限公司	CRL US	纽约	美国	26.00	39,499.84	0.03
446	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克	美国	67.00	39,262.83	0.03
447	APA CORP	APA	APA US	纳斯达克	美国	158.00	39,011.08	0.03
448	PENTAIR PLC	Pentair 公共有限公司	PNR US	纽约	美国	83.00	38,743.29	0.03
449	GEN DIGITAL INC	Gen Digital 股份有限公司	GEN US	纳斯达克	美国	289.00	38,737.15	0.03
450	ETSY INC	Etsy 股份有限公司	ETSY US	纳斯达克	美国	63.00	38,516.62	0.03
451	ALLEGION PLC	安朗杰公共有限公司	ALLE US	纽约	美国	44.00	38,158.58	0.03
452	CERIDIAN HCM HOLDING INC	Ceridian 人力资本管理控股股份有限公司	CDAY US	纽约	美国	78.00	37,745.12	0.03
453	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网络股份有限公司	JNPR US	纽约	美国	164.00	37,127.03	0.02

454	QORVO INC	Qorvo 股份有限公司	QRVO US	纳斯达克	美国	50.00	36,862.42	0.02
455	TAPESTRY INC	TPR-DRS-RS	TPR US	纽约	美国	119.00	36,802.44	0.02
456	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	Universal 保健服务股份有限公司	UHS US	纽约	美国	32.00	36,480.46	0.02
457	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股份有限公司	GL US	纽约	美国	46.00	36,436.24	0.02
458	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	EMN US	纽约	美国	60.00	36,296.64	0.02
459	ROLLINS INC	Rollins 公司	ROL US	纽约	美国	117.00	36,209.28	0.02
460	MARKET AXESS HOLDINGS INC	MarketAxess 控股公司	MKTX US	纳斯达克	美国	19.00	35,890.40	0.02
461	REGENCY CENTER S CORP	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克	美国	78.00	34,814.34	0.02
462	GENERAC HOLDINGS INC	Generac 控股公司	GNRC US	纽约	美国	32.00	34,482.67	0.02
463	FOX CORP - CLASS A	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克	美国	138.00	33,903.45	0.02
464	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	纽约	美国	215.00	33,820.72	0.02
465	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB US	纽约	美国	102.00	33,689.71	0.02
466	SMITH (A.O.) CORP	AO 史密斯公司	AOS US	纽约	美国	64.00	33,657.20	0.02
467	PINNACLE	Pinnacle	PNW US	纽约	美国	57.00	33,550.98	0.02

	LE WEST CAPITAL	西部资本						
468	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	Huntington Ingalls 工业公司	HII US	纽约	美国	20.00	32,891.84	0.02
469	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY US	纽约	美国	476.00	31,780.80	0.02
470	F5 INC	F5 股份有限公司	FFIV US	纳斯达克	美国	30.00	31,705.37	0.02
471	NRG ENERGY INC	NRG 能源股份有限公司	NRG US	纽约	美国	117.00	31,610.20	0.02
472	DENTSPILY SIRONA INC	登士柏西诺德公司	XRAY US	纳斯达克	美国	109.00	31,520.24	0.02
473	BATH & BODY WORKS INC	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI US	纽约	美国	116.00	31,432.23	0.02
474	HASBRO INC	孩之宝	HAS US	纳斯达克	美国	66.00	30,888.99	0.02
475	BIO-RAD LABORATORIES-A	伯乐生命医学产品有限公司	BIO US	纽约	美国	11.00	30,133.90	0.02
476	BOSTON PROPERTIES INC	波士顿地产公司	BXP US	纽约	美国	72.00	29,961.64	0.02
477	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	派拉蒙全球	PARA US	纳斯达克	美国	258.00	29,660.32	0.02
478	ROBERT HALF INC	罗致恒富国际公司	RHI US	纽约	美国	54.00	29,350.33	0.02
479	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR US	纽约	美国	27.00	29,028.42	0.02
480	CATALANT INC	康泰伦特股份有限公司	CTLT US	纽约	美国	91.00	28,511.27	0.02

		公司						
481	INVESCO LTD	景顺有限公司	IVZ US	纽约	美国	233.00	28,301.51	0.02
482	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN US	纽约	美国	145.00	27,985.16	0.02
483	NEWS CORP - CLASS A	新闻集团	NWSA US	纳斯达克	美国	194.00	27,335.20	0.02
484	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK US	纽约	美国	130.00	27,307.02	0.02
485	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	联邦房地产投资信托公司	FRT US	纽约	美国	37.00	25,871.90	0.02
486	ALASKA AIR GROUP INC	阿拉斯加航空集团股份有限公司	ALK US	纽约	美国	65.00	24,977.42	0.02
487	ASSURANT INC	安信龙集团	AIZ US	纽约	美国	27.00	24,527.54	0.02
488	VF CORP	VF 公司	VFC US	纽约	美国	168.00	23,174.01	0.02
489	DXC TECHNOLOGY CO	DXC 技术公司	DXC US	纽约	美国	115.00	22,203.44	0.01
490	SEALED AIR CORP	希悦尔公司	SEE US	纽约	美国	73.00	21,099.34	0.01
491	COMERICA INC	Comerica 公司	CMA US	纽约	美国	67.00	20,507.69	0.01
492	DAVITA INC	DaVita 股份有限公司	DVA US	纽约	美国	28.00	20,327.33	0.01
493	ORGANON & CO	Organon & Co	OGN US	纽约	美国	129.00	19,397.59	0.01
494	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业股份有限公司	MHK US	纽约	美国	26.00	19,380.75	0.01
495	RALPH LAUREN	拉夫劳伦	RL US	纽约	美国	20.00	17,818.82	0.01

	CORP							
496	FOX CORP - CLASS B	福克斯公 司	FOX US	纳斯达 克	美国	70.00	16,130.15	0.01
497	ADVANC E AUTO PARTS INC	领先汽车 配件股份 有限公司	AAP US	纽约	美国	30.00	15,239.21	0.01
498	ZIONS BANCOR P NA	锡安银行	ZION US	纳斯达 克	美国	76.00	14,750.46	0.01
499	LINCOL N NATION AL CORP	林肯国民	LNC US	纽约	美国	78.00	14,518.66	0.01
500	NEWELL BRANDS INC	纽威尔品 牌公司	NWL US	纳斯达 克	美国	191.00	12,007.11	0.01
501	NEWS CORP - CLASS B	新闻集团	NWS US	纳斯达 克	美国	59.00	8,407.07	0.01

7.4.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	APPLE INC	AAPL US	2,761,355.56	3.22
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	2,604,512.71	3.03
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,285,900.52	1.50
4	NVIDIA CORP	NVDA US	811,581.37	0.94
5	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	776,669.40	0.90
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	750,014.73	0.87
7	TESLA INC	TSLA US	719,891.61	0.84
8	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	659,739.81	0.77
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	604,713.95	0.70

10	EXXON MOBIL CORP	XOM US	582,902.56	0.68
11	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	565,179.55	0.66
12	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	542,110.89	0.63
13	METAPLATFORMS INC-CLASS A	METAUS	481,117.73	0.56
14	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	474,410.88	0.55
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	445,160.28	0.52
16	MASTERCARD INC - A	MA US	424,271.00	0.49
17	HOME DEPOT INC	HD US	418,652.27	0.49
18	ELI LILLY & CO	LLY US	399,504.86	0.47
19	CHEVRON CORP	CVX US	380,747.68	0.44
20	BROADCOM INC	AVGO US	379,268.23	0.44

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	767,169.92	0.89
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	562,394.43	0.65
3	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	RTX US	512,302.67	0.60
4	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	379,238.23	0.44
5	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	258,316.18	0.30
6	AMAZON.COM INC	AMZN US	241,347.61	0.28
7	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	224,429.21	0.26
8	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	180,202.34	0.21
9	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	165,827.13	0.19
10	NVIDIA CORP	NVDA US	165,390.13	0.19
11	EXXON MOBIL CORP	XOM US	162,136.88	0.19
12	CHEVRON CORP	CVX US	135,379.93	0.16
13	TESLA INC	TSLA US	132,438.46	0.15
14	METAPLATFORMS INC-CLASS A	METAUS	128,835.45	0.15
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	127,657.46	0.15
16	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	123,523.57	0.14
17	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	117,298.95	0.14
18	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG US	112,211.13	0.13

19	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	107,114.28	0.12
20	AUTOZONE INC	AZO US	102,606.38	0.12

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。

7.5.3 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	45,509,424.58
卖出收入（成交）总额	11,994,410.42

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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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	PROSHAR ES ULTRAPR O S&P 500	ETF 基金	开放式	ProShares Trust	4,627,658.55	3.10

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	6,828.38
3	应收股利	77,748.94
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	84,577.32

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 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。

7.10.5.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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		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
2,331	53,152.57	29,449,097.00	23.77%	80,077,054.00	64.63%	14,372,500.00	11.60%

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	陈敏	29,148,905.00	23.53%
2	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	22,000,000.00	17.76%
3	杨巧伟	5,426,800.00	4.38%
4	郑灿标	4,898,500.00	3.95%
5	严国用	2,805,600.00	2.26%
6	BARCLAYS BANK PLC	2,522,600.00	2.04%
7	招商证券股份有限公司	1,230,702.00	0.99%
8	罗雄强	1,200,000.00	0.97%
9	国泰基金—中建投信托股份有限公司— 国泰基金宏观对冲 2 号单一资产管理计 划	1,102,600.00	0.89%
10	吴俊辉	1,042,100.00	0.84%
-	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）	14,372,500.00	11.60%

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 5 月 9 日）基金份额总额	247,898,651.00
本报告期期初基金份额总额	85,898,651.00
本报告期基金总申购份额	50,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	123,898,651.00

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未发生重大人事变动。

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	
China Galaxy International Financial	1	-	-	574.83	2.67%	-

Holdings Limited						
early redemption	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	2	54,164,093.69	94.19%	20,254.37	94.11%	-
Haitong International Securities Co Ltd	1	3,339,738.17	5.81%	692.96	3.22%	-

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		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
China Galaxy International Financial Holdings	-	-	-	-	-	-	1,330,441.08	5.41%

Limit ed								
early rede mptio n	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	23,24 6,548. 64	94.59%
Haito ng Inter natio nal Secur ities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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）暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-01-11
2	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》	2023-02-15
3	国泰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值调整的公告	《上海证券报》	2023-03-29
4	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》	2023-04-03
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》	2023-05-24
6	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理变更公告	《上海证券报》	2023-05-24
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》	2023-06-14
8	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》	2023-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2023 年 03 月 13 日至 2023 年 03 月 13 日	—	22,000,000.00	—	22,000,000.00	17.76%
个人	1	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	34,128,905.00	20,000.00	5,000,000.00	29,148,905.00	23.53%
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 备查文件目录

12.1 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

12.2 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。

12.3 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