

国泰中证全指软件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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 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	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
5 托管人报告	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
6 半年度财务会计报告（未经审计）	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
7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
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	55
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.11 投资组合报告附注	60
8 基金份额持有人信息	62

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2	期末上市基金前十名持有人	63
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
9	开放式基金份额变动	64
10	重大事件揭示	64
10.1	基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4	基金投资策略的改变	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11	备查文件目录	66
11.1	备查文件目录	66
11.2	存放地点	66
11.3	查阅方式	66

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证全指软件 ETF
场内简称	软件 ETF
基金主代码	515230
交易代码	515230
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 3 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,438,690,872.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 2 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	<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>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	中证全指软件指数收益率
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，跟踪中证全指软件指数，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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	李帅帅
	联系电话	021-31081600转	0755-25878287
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95511-3
传真		021-31081800	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
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	广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码		200082	518001
法定代表人		邱军	谢永林

2.4 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

2.5 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	183,269,990.26
本期利润	209,035,761.21
加权平均基金份额本期利润	0.1943
本期加权平均净值利润率	19.74%
本期基金份额净值增长率	26.52%
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	-9,843,523.81
期末可供分配基金份额利润	-0.0068
期末基金资产净值	1,428,847,348.19
期末基金份额净值	0.9932
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	-0.68%

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	1.24%	2.68%	1.20%	2.71%	0.04%	-0.03%
过去三个月	-10.80%	2.61%	-11.16%	2.65%	0.36%	-0.04%
过去六个月	26.52%	2.40%	26.14%	2.43%	0.38%	-0.03%
过去一年	26.49%	2.04%	25.69%	2.08%	0.80%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-0.68%	1.85%	-9.13%	1.92%	8.45%	-0.07%

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

国泰中证全指软件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
 （2021 年 2 月 3 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为 2021 年 2 月 3 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金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	2021-09-28	-	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 ≥ 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，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参

与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次。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。

作为行业指数基金，本基金旨在为投资者提供行业投资工具。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 26.52%，同期业绩比较基准收益率为 26.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

软件 ETF 跟踪中证全指软件指数，成分股涵盖应用于云计算、网络安全、人工智能、金融科技、智能驾驶、医疗 IT、工业互联网等各个细分领域的软件行业上市公司。政策方面，数字中国、数字经济、数据要素等方案文件落地，数字产业相关顶层设计不断完善，全产业链有望持续迎来政策支持及需求增长。技术方面，海外 AI 大模型引发人工智能技术革命，国内大模型技术加速发展，未来有望赋能千行百业。在政策与技术共振下，行业业绩有望逐步兑现，软件行业中长期机会仍值得关注。

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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

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：国泰中证全指软件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	上年度末
----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,815,519.12	4,905,268.50
结算备付金		4,689,525.40	2,512,893.27
存出保证金		1,012,797.46	335,104.84
交易性金融资产	6.4.7.2	1,416,720,338.94	608,196,812.99
其中：股票投资		1,416,720,338.94	608,196,812.99
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		2,393,350.90	388,265.09
应收股利		61,359.50	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	160,819.32	39,342.53
资产总计		1,438,853,710.64	616,377,687.22
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		-	81,809.89
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		652,144.23	266,413.52
应付托管费		130,428.87	53,282.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,083.32	5,387.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	9,210,706.03	1,586,254.22
负债合计		10,006,362.45	1,993,147.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,438,690,872.00	782,690,872.00
未分配利润	6.4.7.8	-9,843,523.81	-168,306,332.37
净资产合计		1,428,847,348.19	614,384,539.63
负债和净资产总计		1,438,853,710.64	616,377,687.22

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9932 元，基金份额总额 1,438,690,872.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证全指软件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	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		212,245,419.86	-83,020,474.81
1.利息收入		1,842,166.56	186,033.21
其中：存款利息收入	6.4.7.9	83,724.99	25,205.42
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		1,758,441.57	160,827.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		180,543,444.75	-42,428,426.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	176,861,165.67	-43,218,340.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	3,682,279.08	789,913.88
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	25,765,770.95	-41,268,343.00
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	4,094,037.60	490,261.55
减：二、营业总支出		3,209,658.65	878,330.49
1. 管理人报酬		2,594,643.32	657,075.99
2. 托管费		518,928.69	131,415.22
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		6,330.55	579.13
8. 其他费用	6.4.7.16	89,756.09	89,260.15

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		209,035,761.21	-83,898,805.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		209,035,761.21	-83,898,805.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		209,035,761.21	-83,898,805.30

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证全指软件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）	782,690,872.00	-168,306,332.37	614,384,539.63
二、本期期初净资产（基金净值）	782,690,872.00	-168,306,332.37	614,384,539.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	656,000,000.00	158,462,808.56	814,462,808.56
（一）、综合收益总额	-	209,035,761.21	209,035,761.21
（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）	656,000,000.00	-50,572,952.65	605,427,047.35
其中：1.基金申购款	2,921,000,000.00	-17,254,669.27	2,903,745,330.73
2.基金赎回款	-2,265,000,000.00	-33,318,283.38	-2,298,318,283.38
（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）	1,438,690,872.00	-9,843,523.81	1,428,847,348.19

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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）	277,690,872.00	7,513,063.04	285,203,935.04
二、本期期初净资产（基金净值）	277,690,872.00	7,513,063.04	285,203,935.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	30,000,000.00	-73,616,334.93	-43,616,334.93
（一）、综合收益总额	-	-83,898,805.30	-83,898,805.30
（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）	30,000,000.00	10,282,470.37	40,282,470.37
其中：1.基金申购款	213,000,000.00	-15,772,257.36	197,227,742.64
2.基金赎回款	-183,000,000.00	26,054,727.73	-156,945,272.27
（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）	307,690,872.00	-66,103,271.89	241,587,600.11

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

国泰中证全指软件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[2020]3684 号《关于准予国泰中证全指软件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《国泰中证全指软件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 449,690,872.00 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(2021)第 0135 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 449,690,872.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]第 82 号文审核同意，本基金 449,690,872.00 份基金份额于 2021 年 3 月 2 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证全指软件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、备选成份股。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(包括中小板、创业板、科创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的规定参与融资和转融通证券出借业务。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的指数收益率，即中证全指软件指数收益率。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(以下简称“国泰中证全指软件 ETF 联接基金”)。国泰中证全指软件 ETF 联接基金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(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》、《国泰中证软件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 年中期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 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止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	13,815,519.12
等于：本金	13,811,694.55
加：应计利息	3,824.57
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	13,815,519.12

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	1,414,071,018.10	-	1,416,720,338.94	2,649,320.84
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	1,414,071,018.10	-	1,416,720,338.94	2,649,320.84

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
应计转融通出借证券利息	160,819.32
合计	160,819.32

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	486,217.68
其中：交易所市场	486,217.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,756.09
应付替代款	8,634,732.26
合计	9,210,706.03

注：应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

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	782,690,872.00	782,690,872.00
本期申购	2,921,000,000.00	2,921,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,265,000,000.00	-2,265,000,000.00
本期末	1,438,690,872.00	1,438,690,872.00

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	-97,684,658.95	-70,621,673.42	-168,306,332.37
本期利润	183,269,990.26	25,765,770.95	209,035,761.21
本期基金份额交易产生的变动数	-8,114,013.41	-42,458,939.24	-50,572,952.65
其中：基金申购款	-54,954,343.10	37,699,673.83	-17,254,669.27
基金赎回款	46,840,329.69	-80,158,613.07	-33,318,283.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,471,317.90	-87,314,841.71	-9,843,523.81

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	51,475.61
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	26,729.74
其他	5,519.64
合计	83,724.99

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	104,801,151.10
股票投资收益——赎回差价收入	72,060,014.57
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	176,861,165.67

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	1,531,023,996.78
减：卖出股票成本总额	1,423,768,769.63
减：交易费用	2,454,076.05

买卖股票差价收入	104,801,151.10
----------	----------------

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	2,298,318,283.38
减：现金支付赎回款总额	1,366,532,647.38
减：赎回股票成本总额	859,725,621.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	72,060,014.57

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

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	3,682,279.08
其中：证券出借权益补偿收入	376,847.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,682,279.08

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	25,765,770.95
——股票投资	25,765,770.95
——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	25,765,770.95

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	4,094,037.60
合计	4,094,037.60

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	30,248.72
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	89,756.09

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
国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰中证全指软件 ETF 联接 ”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,594,643.32	657,075.99
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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 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1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	518,928.69	131,415.22

注：支付基金托管人平安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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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
国泰中证全指软件 ETF 联接	137,262,601.00	9.54%	82,920,000.00	10.59%

6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1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
平安银行	13,815,519.12	51,475.61	4,978,404.14	20,661.50

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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
688502	茂莱光学	2023-02-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	69.72	178.59	1,509.00	105,207.48	269,492.31	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.86	18.06	5,393.00	107,104.98	97,397.58	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.10	17.04	4,459.00	49,494.90	75,981.36	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	网下中签流通受限	25.82	25.82	2,754.00	71,108.28	71,108.28	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	网下中签流通受限	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.69	5.41	10,040.00	57,127.60	54,316.40	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.60	64.67	831.00	19,611.60	53,740.77	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定流通	9.60	9.41	3,767.00	36,163.20	35,447.47	-

				受限						
30130 1	川宁 生物	2022-1 2-20	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	5.00	8.96	3,574. 00	17,870 .00	32,023 .04	-
68848 4	南芯 科技	2023-0 3-28	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	39.99	36.71	815.00	32,591 .85	29,918 .65	-
68835 2	颀中 科技	2023-0 4-11	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	12.10	12.07	2,228. 00	26,958 .80	26,891 .96	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	23.77	42.89	584.00	13,881 .68	25,047 .76	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	29.60	71.42	333.00	9,856. 80	23,782 .86	-
68855 2	航天 南湖	2023-0 5-08	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	21.17	23.50	956.00	20,238 .52	22,466 .00	-
68857 0	天玛 智控	2023-0 5-29	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	30.26	25.33	884.00	26,749 .84	22,391 .72	-
68854 3	国科 军工	2023-0 6-14	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	43.67	53.05	410.00	17,904 .70	21,750 .50	-
68845 8	美芯 晟	2023-0 5-15	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	75.00	90.76	221.00	16,575 .00	20,057 .96	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	6.58	7.58	2,646. 00	17,410 .68	20,056 .68	-
68858 1	安杰 思	2023-0 5-12	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	125.80	118.03	163.00	20,505 .40	19,238 .89	-

688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.99	16.90	949.00	18,970.51	16,038.10	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	245.56	122.11	126.00	30,940.56	15,385.86	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-
30134	涛涛	2023-0	6 个月	新股	73.45	46.64	262.00	19,243	12,219	-

5	车业	3-10	以上	锁定 流通 受限				.90	.68	
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6 个月(含)	送股	-	122.11	60.00	-	7,326.60	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月以上	新股 锁定 流通	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-

				受限						
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值	数量(单位:股)	期末估值总额
----	------	------	-------	------	----------	--------

				单价		
1	002230	科大讯飞	2023年6月15日 -2023年7月13日	67.96	134,800.00	9,161,008.00
2	688111	金山办公	2023年6月15日 -2023年7月13日	472.22	13,400.00	6,327,748.00
3	688111	金山办公	2023年6月6日 -2023年7月4日	472.22	12,000.00	5,666,640.00
4	600570	恒生电子	2023年6月15日 -2023年7月13日	44.29	110,600.00	4,898,474.00
5	688111	金山办公	2023年6月19日 -2023年7月3日	472.22	10,000.00	4,722,200.00
6	688111	金山办公	2023年6月26日 -2023年7月10日	472.22	7,600.00	3,588,872.00
7	002230	科大讯飞	2023年6月20日 -2023年7月4日	67.96	51,000.00	3,465,960.00
8	002230	科大讯飞	2023年6月19日 -2023年7月3日	67.96	48,000.00	3,262,080.00
9	601360	三六零	2023年6月15日 -2023年7月13日	12.54	260,000.00	3,260,400.00
10	002410	广联达	2023年6月15日 -2023年7月13日	32.49	97,000.00	3,151,530.00
11	600588	用友网络	2023年6月15日 -2023年7月13日	20.50	149,900.00	3,072,950.00
12	002230	科大讯飞	2023年6月21日 -2023年7月5日	67.96	43,000.00	2,922,280.00
13	002230	科大讯飞	2023年6月27日 -2023年7月11日	67.96	42,100.00	2,861,116.00
14	002230	科大讯飞	2023年6月20日 -2023年7月4日	67.96	40,600.00	2,759,176.00
15	300033	同花顺	2023年6月15日 -2023年7月13日	175.28	15,600.00	2,734,368.00
16	600845	宝信软件	2023年6月15日 -2023年7月13日	50.81	52,400.00	2,662,444.00
17	002230	科大讯飞	2023年6月30日 -2023年7月14日	67.96	38,400.00	2,609,664.00
18	002230	科大讯飞	2023年6月19日 -2023年7月3日	67.96	36,900.00	2,507,724.00
19	300496	中科创达	2023年6月15日 -2023年7月13日	96.35	23,300.00	2,244,955.00
20	002230	科大讯飞	2023年6月21日 -2023年7月5日	67.96	31,900.00	2,167,924.00
21	300454	深信服	2023年6月15日 -2023年7月13日	113.25	18,200.00	2,061,150.00
22	600536	中国软件	2023年6月15日	46.88	43,800.00	2,053,344.00

			-2023 年 7 月 13 日			0
23	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	67.96	30,000.00	2,038,800.0 0
24	688111	金山办公	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	472.2 2	4,300.00	2,030,546.0 0
25	002405	四维图新	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	11.58	173,200.00	2,005,656.0 0
26	600570	恒生电子	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	44.29	45,000.00	1,993,050.0 0
27	688111	金山办公	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	472.2 2	3,800.00	1,794,436.0 0
28	688111	金山办公	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	472.2 2	3,600.00	1,699,992.0 0
29	300033	同花顺	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	175.2 8	9,000.00	1,577,520.0 0
30	300033	同花顺	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	175.2 8	9,000.00	1,577,520.0 0
31	600570	恒生电子	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	44.29	35,100.00	1,554,579.0 0
32	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	67.96	21,600.00	1,467,936.0 0
33	300496	中科创达	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	96.35	15,000.00	1,445,250.0 0
34	300496	中科创达	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	96.35	15,000.00	1,445,250.0 0
35	002439	启明星辰	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	29.76	48,500.00	1,443,360.0 0
36	600570	恒生电子	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	44.29	31,400.00	1,390,706.0 0
37	300339	润和软件	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	23.96	57,900.00	1,387,284.0 0
38	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 7 日 -2023 年 7 月 5 日	67.96	18,300.00	1,243,668.0 0
39	601360	三六零	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	12.54	98,000.00	1,228,920.0 0
40	688111	金山办公	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	472.2 2	2,600.00	1,227,772.0 0
41	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	67.96	17,900.00	1,216,484.0 0
42	601360	三六零	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	12.54	95,700.00	1,200,078.0 0
43	601360	三六零	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	12.54	95,200.00	1,193,808.0 0
44	600845	宝信软件	2023 年 6 月 26 日	50.81	23,400.00	1,188,954.0

			-2023 年 7 月 10 日			0
45	300496	中科创达	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	96.35	11,800.00	1,136,930.0 0
46	300682	朗新科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	23.28	48,400.00	1,126,752.0 0
47	300682	朗新科技	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	23.28	47,900.00	1,115,112.0 0
48	600271	航天信息	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	13.69	80,900.00	1,107,521.0 0
49	600570	恒生电子	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	44.29	24,300.00	1,076,247.0 0
50	300229	拓尔思	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	25.97	40,500.00	1,051,785.0 0
51	002410	广联达	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	32.49	30,800.00	1,000,692.0 0
52	603927	中科软	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	38.56	25,900.00	998,704.00
53	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	67.96	14,600.00	992,216.00
54	600570	恒生电子	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	44.29	22,300.00	987,667.00
55	300033	同花顺	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	175.2 8	5,600.00	981,568.00
56	600588	用友网络	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	20.50	47,600.00	975,800.00
57	300339	润和软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	23.96	40,000.00	958,400.00
58	688111	金山办公	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	472.2 2	2,000.00	944,440.00
59	002410	广联达	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	32.49	27,500.00	893,475.00
60	300339	润和软件	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	23.96	37,100.00	888,916.00
61	300033	同花顺	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	175.2 8	5,000.00	876,400.00
62	600588	用友网络	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	20.50	42,600.00	873,300.00
63	300803	指南针	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	48.59	17,800.00	864,902.00
64	300036	超图软件	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	23.71	35,900.00	851,189.00
65	002153	石基信息	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 26 日	14.00	60,000.00	840,000.00
66	600570	恒生电子	2023 年 6 月 28 日	44.29	18,900.00	837,081.00

			-2023 年 7 月 26 日			
67	002212	天融信	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	9.70	86,200.00	836,140.00
68	601360	三六零	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	12.54	66,100.00	828,894.00
69	688066	航天宏图	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	60.90	13,200.00	803,880.00
70	002063	远光软件	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	8.68	92,400.00	802,032.00
71	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	20.79	37,500.00	779,625.00
72	300033	同花顺	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	175.2 8	4,400.00	771,232.00
73	688088	虹软科技	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	42.75	17,700.00	756,675.00
74	300166	东方国信	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	11.24	67,100.00	754,204.00
75	600536	中国软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	46.88	16,000.00	750,080.00
76	002153	石基信息	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	14.00	53,100.00	743,400.00
77	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	12.54	59,000.00	739,860.00
78	300075	数字政通	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	24.88	29,600.00	736,448.00
79	300674	宇信科技	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	17.68	41,400.00	731,952.00
80	002439	启明星辰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	29.76	24,000.00	714,240.00
81	300075	数字政通	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 4 日	24.88	28,700.00	714,056.00
82	300496	中科创达	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	96.35	7,400.00	712,990.00
83	600446	金证股份	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	14.54	47,900.00	696,466.00
84	600570	恒生电子	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 7 日	44.29	15,700.00	695,353.00
85	600845	宝信软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	50.81	13,600.00	691,016.00
86	300379	东方通	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	20.57	33,500.00	689,095.00
87	300674	宇信科技	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	17.68	38,800.00	685,984.00
88	300674	宇信科技	2023 年 6 月 27 日	17.68	38,800.00	685,984.00

			-2023 年 7 月 11 日			
89	300036	超图软件	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	23.71	28,900.00	685,219.00
90	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	67.96	10,000.00	679,600.00
91	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	67.96	10,000.00	679,600.00
92	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	67.96	10,000.00	679,600.00
93	300682	朗新科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.28	29,000.00	675,120.00
94	600718	东软集团	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	10.66	61,800.00	658,788.00
95	300454	深信服	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	113.2 5	5,800.00	656,850.00
96	603927	中科软	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	38.56	17,000.00	655,520.00
97	603927	中科软	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	38.56	17,000.00	655,520.00
98	300229	拓尔思	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	25.97	24,900.00	646,653.00
99	300339	润和软件	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	23.96	26,900.00	644,524.00
100	002405	四维图新	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	11.58	55,400.00	641,532.00
101	002153	石基信息	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	14.00	45,800.00	641,200.00
102	002405	四维图新	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	11.58	55,100.00	638,058.00
103	300496	中科创达	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	96.35	6,600.00	635,910.00
104	601360	三六零	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.54	50,700.00	635,778.00
105	601360	三六零	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.54	50,000.00	627,000.00
106	601360	三六零	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	12.54	50,000.00	627,000.00
107	601360	三六零	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.54	50,000.00	627,000.00
108	600845	宝信软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	50.81	12,200.00	619,882.00
109	002410	广联达	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 25 日	32.49	18,400.00	597,816.00
110	601360	三六零	2023 年 6 月 27 日	12.54	47,600.00	596,904.00

			-2023 年 7 月 11 日			
111	601360	三六零	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	12.54	47,500.00	595,650.00
112	300454	深信服	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	113.2 5	5,100.00	577,575.00
113	600718	东软集团	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	10.66	54,000.00	575,640.00
114	688568	中科星图	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	80.58	7,100.00	572,118.00
115	002405	四维图新	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	11.58	49,200.00	569,736.00
116	300229	拓尔思	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	25.97	21,900.00	568,743.00
117	002063	远光软件	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	8.68	64,400.00	558,992.00
118	300496	中科创达	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	96.35	5,800.00	558,830.00
119	300496	中科创达	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	96.35	5,800.00	558,830.00
120	601519	大智慧	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	7.16	74,100.00	530,556.00
121	000555	神州信息	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	12.30	42,900.00	527,670.00
122	300033	同花顺	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	175.2 8	3,000.00	525,840.00
123	300229	拓尔思	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	25.97	20,200.00	524,594.00
124	688111	金山办公	2023 年 6 月 16 日 -2023 年 7 月 14 日	472.2 2	1,100.00	519,442.00
125	688088	虹软科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	42.75	12,000.00	513,000.00
126	300339	润和软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.96	21,400.00	512,744.00
127	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	12.37	40,800.00	504,696.00
128	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	20.79	24,000.00	498,960.00
129	600536	中国软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	46.88	10,600.00	496,928.00
130	688066	航天宏图	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	60.90	8,000.00	487,200.00
131	300803	指南针	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	48.59	10,000.00	485,900.00
132	300803	指南针	2023 年 6 月 6 日	48.59	10,000.00	485,900.00

			-2023 年 7 月 4 日			
133	688088	虹软科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	42.75	11,200.00	478,800.00
134	300229	拓尔思	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	25.97	18,000.00	467,460.00
135	002439	启明星辰	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	29.76	15,400.00	458,304.00
136	300036	超图软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	23.71	19,000.00	450,490.00
137	300348	长亮科技	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	10.44	42,600.00	444,744.00
138	300339	润和软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.96	18,400.00	440,864.00
139	600536	中国软件	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	46.88	9,400.00	440,672.00
140	300803	指南针	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	48.59	9,000.00	437,310.00
141	300803	指南针	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	48.59	9,000.00	437,310.00
142	688088	虹软科技	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 4 日	42.75	10,100.00	431,775.00
143	600536	中国软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	46.88	9,200.00	431,296.00
144	601360	三六零	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	12.54	34,100.00	427,614.00
145	600845	宝信软件	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	50.81	8,400.00	426,804.00
146	688066	航天宏图	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	60.90	7,000.00	426,300.00
147	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	20.79	20,100.00	417,879.00
148	600446	金证股份	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	14.54	28,700.00	417,298.00
149	002439	启明星辰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	29.76	14,000.00	416,640.00
150	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	20.79	20,000.00	415,800.00
151	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	20.79	20,000.00	415,800.00
152	600446	金证股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	14.54	28,400.00	412,936.00
153	002439	启明星辰	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	29.76	13,800.00	410,688.00
154	002439	启明星辰	2023 年 6 月 30 日	29.76	13,800.00	410,688.00

			-2023 年 7 月 14 日			
155	002439	启明星辰	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	29.76	13,700.00	407,712.00
156	300166	东方国信	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	11.24	36,200.00	406,888.00
157	300166	东方国信	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	11.24	36,000.00	404,640.00
158	300674	宇信科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	17.68	22,700.00	401,336.00
159	300682	朗新科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	23.28	17,200.00	400,416.00
160	300339	润和软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	23.96	16,400.00	392,944.00
161	300229	拓尔思	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 5 日	25.97	15,000.00	389,550.00
162	300229	拓尔思	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	25.97	15,000.00	389,550.00
163	688232	新点软件	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	53.81	7,200.00	387,432.00
164	300339	润和软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.96	16,100.00	385,756.00
165	603927	中科软	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	38.56	10,000.00	385,600.00
166	300075	数字政通	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	24.88	15,200.00	378,176.00
167	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 4 日	12.37	30,400.00	376,048.00
168	002212	天融信	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	9.70	38,300.00	371,510.00
169	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	67.96	5,400.00	366,984.00
170	300075	数字政通	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	24.88	14,300.00	355,784.00
171	300036	超图软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	23.71	15,000.00	355,650.00
172	300379	东方通	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	20.57	17,200.00	353,804.00
173	600271	航天信息	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	13.69	25,700.00	351,833.00
174	002987	京北方	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	21.92	16,000.00	350,720.00
175	002987	京北方	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	21.92	16,000.00	350,720.00
176	002987	京北方	2023 年 6 月 15 日	21.92	16,000.00	350,720.00

			-2023 年 7 月 13 日			
177	300379	东方通	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	20.57	16,800.00	345,576.00
178	601519	大智慧	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	7.16	48,100.00	344,396.00
179	300339	润和软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.96	14,000.00	335,440.00
180	600446	金证股份	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	14.54	23,000.00	334,420.00
181	300674	宇信科技	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	17.68	18,900.00	334,152.00
182	600446	金证股份	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	14.54	22,900.00	332,966.00
183	300229	拓尔思	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	25.97	12,800.00	332,416.00
184	000555	神州信息	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.30	27,000.00	332,100.00
185	600588	用友网络	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	20.50	16,000.00	328,000.00
186	000555	神州信息	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.30	26,300.00	323,490.00
187	603927	中科软	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	38.56	8,200.00	316,192.00
188	300166	东方国信	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 4 日	11.24	28,100.00	315,844.00
189	600271	航天信息	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	13.69	23,000.00	314,870.00
190	301153	中科江南	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	74.96	4,200.00	314,832.00
191	600718	东软集团	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	10.66	29,400.00	313,404.00
192	300339	润和软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.96	13,000.00	311,480.00
193	688066	航天宏图	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	60.90	5,100.00	310,590.00
194	002439	启明星辰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	29.76	10,400.00	309,504.00
195	300036	超图软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	23.71	12,600.00	298,746.00
196	300229	拓尔思	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	25.97	11,500.00	298,655.00
197	601360	三六零	2023 年 6 月 16 日 -2023 年 7 月 14 日	12.54	23,200.00	290,928.00
198	601360	三六零	2023 年 6 月 16 日	12.54	23,200.00	290,928.00

			-2023 年 7 月 14 日			
199	600446	金证股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	14.54	20,000.00	290,800.00
200	000948	南天信息	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	16.90	17,200.00	290,680.00
201	601519	大智慧	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	7.16	40,000.00	286,400.00
202	601519	大智慧	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	7.16	40,000.00	286,400.00
203	300682	朗新科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.28	12,300.00	286,344.00
204	603927	中科软	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	38.56	7,400.00	285,344.00
205	300579	数字认证	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	28.90	9,800.00	283,220.00
206	300033	同花顺	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	175.28	1,600.00	280,448.00
207	300803	指南针	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	48.59	5,600.00	272,104.00
208	002212	天融信	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	9.70	28,000.00	271,600.00
209	002212	天融信	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	9.70	28,000.00	271,600.00
210	000948	南天信息	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	16.90	16,000.00	270,400.00
211	000948	南天信息	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	16.90	16,000.00	270,400.00
212	000948	南天信息	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	16.90	16,000.00	270,400.00
213	300036	超图软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.71	11,300.00	267,923.00
214	002212	天融信	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	9.70	27,400.00	265,780.00
215	002987	京北方	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	21.92	12,000.00	263,040.00
216	601360	三六零	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	12.54	20,900.00	262,086.00
217	300075	数字政通	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	24.88	10,300.00	256,264.00
218	002063	远光软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	8.68	29,300.00	254,324.00
219	300682	朗新科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	23.28	10,900.00	253,752.00
220	300166	东方国信	2023 年 6 月 20 日	11.24	22,500.00	252,900.00

			-2023 年 7 月 4 日			
221	300803	指南针	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	48.59	5,200.00	252,668.00
222	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	12.37	20,200.00	249,874.00
223	300075	数字政通	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	24.88	10,000.00	248,800.00
224	300803	指南针	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	48.59	5,100.00	247,809.00
225	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	20.79	11,900.00	247,401.00
226	601360	三六零	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	12.54	19,700.00	247,038.00
227	300348	长亮科技	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	10.44	23,500.00	245,340.00
228	300803	指南针	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	48.59	5,000.00	242,950.00
229	300379	东方通	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	20.57	11,800.00	242,726.00
230	300379	东方通	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	20.57	11,800.00	242,726.00
231	300036	超图软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	23.71	10,100.00	239,471.00
232	300166	东方国信	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	11.24	21,300.00	239,412.00
233	002212	天融信	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	9.70	24,500.00	237,650.00
234	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	12.37	19,000.00	235,030.00
235	600536	中国软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	46.88	5,000.00	234,400.00
236	300075	数字政通	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	24.88	9,400.00	233,872.00
237	300682	朗新科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	23.28	10,000.00	232,800.00
238	300579	数字认证	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	28.90	8,000.00	231,200.00
239	300579	数字认证	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	28.90	8,000.00	231,200.00
240	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	20.79	11,100.00	230,769.00
241	002063	远光软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	8.68	26,200.00	227,416.00
242	688066	航天宏图	2023 年 6 月 30 日	60.90	3,700.00	225,330.00

			-2023 年 7 月 14 日			
243	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	20.79	10,700.00	222,453.00
244	600446	金证股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	14.54	15,200.00	221,008.00
245	300379	东方通	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	20.57	10,600.00	218,042.00
246	300166	东方国信	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	11.24	19,000.00	213,560.00
247	002405	四维图新	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	11.58	18,400.00	213,072.00
248	600718	东软集团	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	10.66	19,800.00	211,068.00
249	300075	数字政通	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	24.88	8,400.00	208,992.00
250	300379	东方通	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	20.57	10,100.00	207,757.00
251	000555	神州信息	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	12.30	16,800.00	206,640.00
252	002153	石基信息	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	14.00	14,600.00	204,400.00
253	300674	宇信科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	17.68	11,500.00	203,320.00
254	600718	东软集团	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	10.66	19,000.00	202,540.00
255	002212	天融信	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	9.70	20,800.00	201,760.00
256	688088	虹软科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	42.75	4,700.00	200,925.00
257	002212	天融信	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	9.70	20,700.00	200,790.00
258	300379	东方通	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	20.57	9,700.00	199,529.00
259	600446	金证股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	14.54	13,600.00	197,744.00
260	000555	神州信息	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	12.30	16,000.00	196,800.00
261	300379	东方通	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	20.57	9,500.00	195,415.00
262	300496	中科创达	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	96.35	2,000.00	192,700.00
263	002153	石基信息	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 13 日	14.00	13,740.00	192,360.00
264	300166	东方国信	2023 年 6 月 6 日	11.24	17,100.00	192,204.00

			-2023 年 7 月 4 日			
265	601360	三六零	2023 年 6 月 7 日 -2023 年 7 月 5 日	12.54	15,100.00	189,354.00
266	600718	东软集团	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	10.66	17,700.00	188,682.00
267	300379	东方通	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	20.57	9,000.00	185,130.00
268	600446	金证股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	14.54	12,700.00	184,658.00
269	688066	航天宏图	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	60.90	3,000.00	182,700.00
270	300674	宇信科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	17.68	10,300.00	182,104.00
271	002153	石基信息	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	14.00	13,000.00	182,000.00
272	688088	虹软科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	42.75	4,200.00	179,550.00
273	002439	启明星辰	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	29.76	6,000.00	178,560.00
274	300339	润和软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.96	7,400.00	177,304.00
275	600718	东软集团	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	10.66	16,000.00	170,560.00
276	002439	启明星辰	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	29.76	5,700.00	169,632.00
277	601519	大智慧	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	7.16	23,500.00	168,260.00
278	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	12.37	13,100.00	162,047.00
279	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	12.37	12,900.00	159,573.00
280	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	12.54	12,200.00	152,988.00
281	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	12.37	12,300.00	152,151.00
282	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	12.54	12,000.00	150,480.00
283	601519	大智慧	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	7.16	21,000.00	150,360.00
284	002439	启明星辰	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	29.76	5,000.00	148,800.00
285	002439	启明星辰	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	29.76	5,000.00	148,800.00
286	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 30 日	12.37	11,600.00	143,492.00

			-2023 年 7 月 14 日			
287	601519	大智慧	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	7.16	20,000.00	143,200.00
288	300579	数字认证	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	28.90	4,900.00	141,610.00
289	300348	长亮科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	10.44	13,500.00	140,940.00
290	000555	神州信息	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	12.30	11,400.00	140,220.00
291	688066	航天宏图	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	60.90	2,300.00	140,070.00
292	002063	远光软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	8.68	16,100.00	139,748.00
293	000555	神州信息	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	12.30	11,300.00	138,990.00
294	688568	中科星图	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	80.58	1,700.00	136,986.00
295	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	12.37	10,800.00	133,596.00
296	688088	虹软科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	42.75	3,100.00	132,525.00
297	300369	绿盟科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	12.37	10,700.00	132,359.00
298	300348	长亮科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	10.44	12,400.00	129,456.00
299	300348	长亮科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	10.44	12,100.00	126,324.00
300	000555	神州信息	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	12.30	10,200.00	125,460.00
301	300348	长亮科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	10.44	12,000.00	125,280.00
302	300379	东方通	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	20.57	6,000.00	123,420.00
303	688225	亚信安全	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	20.95	5,800.00	121,510.00
304	688568	中科星图	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	80.58	1,500.00	120,870.00
305	600536	中国软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	46.88	2,400.00	112,512.00
306	000555	神州信息	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	12.30	9,000.00	110,700.00
307	002063	远光软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	8.68	12,000.00	104,160.00
308	000555	神州信息	2023 年 6 月 19 日	12.30	8,000.00	98,400.00

			-2023 年 7 月 3 日			
309	002405	四维图新	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	11.58	8,000.00	92,640.00
310	601519	大智慧	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	7.16	12,800.00	91,648.00
311	300166	东方国信	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	11.24	8,000.00	89,920.00
312	002987	京北方	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 4 日	21.92	4,000.00	87,680.00
313	600845	宝信软件	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 4 日	50.81	1,680.00	85,360.80
314	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	20.79	4,000.00	83,160.00
315	688088	虹软科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	42.75	1,800.00	76,950.00
316	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	20.79	3,600.00	74,844.00
317	300803	指南针	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	48.59	1,300.00	63,167.00
318	300348	长亮科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	10.44	6,000.00	62,640.00
319	000555	神州信息	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	12.30	5,000.00	61,500.00
320	300188	美亚柏科	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	20.79	2,900.00	60,291.00
321	300348	长亮科技	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	10.44	4,700.00	49,068.00
322	300348	长亮科技	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	10.44	4,600.00	48,024.00
323	002987	京北方	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	21.92	2,000.00	43,840.00
324	300036	超图软件	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	23.71	1,600.00	37,936.00
325	300348	长亮科技	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	10.44	3,500.00	36,540.00
326	000948	南天信息	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	16.90	2,000.00	33,800.00
327	300579	数字认证	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	28.90	1,000.00	28,900.00
328	300348	长亮科技	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	10.44	2,700.00	28,188.00
合计	-	-	-	-	7,599,820.00	223,549,858.80

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。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%。同时，本基金紧密跟踪标的指数，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平安银行，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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	13,815,519.12	-	-	-	13,815,519.12
结算备付金	4,689,525.40	-	-	-	4,689,525.40
存出保证金	1,012,797.46	-	-	-	1,012,797.46
交易性金融资产	-	-	-	1,416,720,338.94	1,416,720,338.94
应收清算款	-	-	-	2,393,350.90	2,393,350.90
应收股利	-	-	-	61,359.50	61,359.50
其他资产	-	-	-	160,819.32	160,819.32
资产总计	19,517,841.98	-	-	1,419,335,868.66	1,438,853,710.64
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	652,144.23	652,144.23
应付托管费	-	-	-	130,428.87	130,428.87
应交税费	-	-	-	13,083.32	13,083.32
其他负债	-	-	-	9,210,706.03	9,210,706.03
负债总计	-	-	-	10,006,362.45	10,006,362.45

					45
利率敏感度缺口	19,517,841.98	-	-	1,409,329,506.21	1,428,847,348.19
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	4,905,268.50	-	-	-	4,905,268.50
结算备付金	2,512,893.27	-	-	-	2,512,893.27
存出保证金	335,104.84	-	-	-	335,104.84
交易性金融资产	-	-	-	608,196,812.99	608,196,812.99
应收清算款	-	-	-	388,265.09	388,265.09
其他资产	-	-	-	39,342.53	39,342.53
资产总计	7,753,266.61	-	-	608,624,420.61	616,377,687.22
负债					
应付清算款	-	-	-	81,809.89	81,809.89
应付管理人报酬	-	-	-	266,413.52	266,413.52
应付托管费	-	-	-	53,282.69	53,282.69
应交税费	-	-	-	5,387.27	5,387.27
其他负债	-	-	-	1,586,254.22	1,586,254.22
负债总计	-	-	-	1,993,147.59	1,993,147.59
利率敏感度缺口	7,753,266.61	-	-	606,631,273.02	614,384,539.63

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	1,416,720,338.94	99.15	608,196,812.99	98.99
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	1,416,720,338.94	99.15	608,196,812.99	98.99

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 6,999	增加约 3,007
业绩比较基准下降 5%	减少约 6,999	减少约 3,007	

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	1,415,460,453.30	607,621,360.56
第二层次	183,835.94	-
第三层次	1,076,049.70	575,452.43
合计	1,416,720,338.94	608,196,812.99

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 2,903,745,330.73 元，其中包括以股票支付的申购款 1,145,442,733.18 元和以现金支付的申购款 1,758,302,597.55 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	1,416,720,338.94	98.46
	其中：股票	1,416,720,338.94	98.46
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	18,505,044.52	1.29
8	其他各项资产	3,628,327.18	0.25
9	合计	1,438,853,710.64	100.00

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不

存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 223,549,858.80 元，占基金资产净值比例为 15.65%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,255,203.00	1.63
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	1,305,641,009.09	91.38
J	金融业	86,541,393.56	6.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,415,437,605.65	99.06

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	1,095,732.90	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	20,056.68	0.00
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	59,955.10	0.00
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	37,242.13	0.00
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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,282,733.29	0.09

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	002230	科大讯飞	2,732,200	185,680,312.00	13.00
2	688111	金山办公	274,770	129,751,889.40	9.08
3	600570	恒生电子	2,273,790	100,706,159.10	7.05

4	601360	三六零	5,320,503	66,719,107.62	4.67
5	002410	广联达	2,000,600	64,999,494.00	4.55
6	600588	用友网络	3,019,799	61,905,879.50	4.33
7	300033	同花顺	323,592	56,719,205.76	3.97
8	600845	宝信软件	1,081,542	54,953,149.02	3.85
9	300496	中科创达	479,150	46,166,102.50	3.23
10	300454	深信服	384,672	43,564,104.00	3.05
11	600536	中国软件	901,335	42,254,584.80	2.96
12	002405	四维图新	3,538,830	40,979,651.40	2.87
13	002439	启明星辰	990,900	29,489,184.00	2.06
14	300339	润和软件	1,132,419	27,132,759.24	1.90
15	600271	航天信息	1,698,700	23,255,203.00	1.63
16	300682	朗新科技	990,906	23,068,291.68	1.61
17	300229	拓尔思	849,300	22,056,321.00	1.54
18	603927	中科软	566,260	21,834,985.60	1.53
19	300803	指南针	384,300	18,673,137.00	1.31
20	002153	石基信息	1,238,710	17,341,940.00	1.21
21	688066	航天宏图	283,111	17,241,459.90	1.21
22	300036	超图软件	707,800	16,781,938.00	1.17
23	002212	天融信	1,698,700	16,477,390.00	1.15
24	002063	远光软件	1,840,207	15,972,996.76	1.12
25	300166	东方国信	1,415,500	15,910,220.00	1.11
26	688088	虹软科技	367,663	15,717,593.25	1.10
27	300188	美亚柏科	732,120	15,220,774.80	1.07
28	300674	宇信科技	849,271	15,015,111.28	1.05
29	300379	东方通	707,760	14,558,623.20	1.02
30	300075	数字政通	581,200	14,460,256.00	1.01
31	600446	金证股份	990,844	14,406,871.76	1.01
32	600718	东软集团	1,274,000	13,580,840.00	0.95
33	300525	博思软件	849,360	13,029,182.40	0.91
34	688083	中望软件	89,812	13,012,860.68	0.91
35	688568	中科星图	160,253	12,913,186.74	0.90
36	300687	赛意信息	424,680	11,797,610.40	0.83
37	688023	安恒信息	64,160	11,209,393.60	0.78
38	601519	大智慧	1,557,130	11,149,050.80	0.78
39	300369	绿盟科技	849,358	10,506,558.46	0.74
40	000555	神州信息	849,300	10,446,390.00	0.73
41	300348	长亮科技	849,375	8,867,475.00	0.62
42	688232	新点软件	160,300	8,625,743.00	0.60
43	300634	彩讯股份	313,800	8,284,320.00	0.58
44	301153	中科江南	95,640	7,169,174.40	0.50
45	002987	京北方	303,540	6,653,596.80	0.47
46	603171	税友股份	151,800	6,068,964.00	0.42
47	000948	南天信息	303,502	5,129,183.80	0.36

48	300579	数字认证	176,500	5,100,850.00	0.36
49	688225	亚信安全	137,400	2,878,530.00	0.20

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	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.02
2	688249	晶合集成	5,393	97,397.58	0.01
3	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
4	688472	阿特斯	4,459	75,981.36	0.01
5	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
6	688469	中芯集成	10,040	54,316.40	0.00
7	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
8	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
9	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
10	688484	南芯科技	815	29,918.65	0.00
11	688352	硕中科技	2,228	26,891.96	0.00
12	301358	湖南裕能	584	25,047.76	0.00
13	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
14	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
15	688507	索辰科技	186	22,712.46	0.00
16	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
17	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
18	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
19	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
20	601061	中信金属	2,646	20,056.68	0.00
21	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
22	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
23	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
24	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
25	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
26	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
27	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
28	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
29	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
30	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
31	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
32	301345	涛涛车业	262	12,219.68	0.00
33	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
34	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
35	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00

36	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
37	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
38	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
39	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
40	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
41	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
42	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
43	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
44	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
45	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

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	002230	科大讯飞	317,118,803.83	51.62
2	002410	广联达	173,345,046.53	28.21
3	300454	深信服	116,686,584.38	18.99
4	300033	同花顺	100,787,775.42	16.40
5	300496	中科创达	92,194,384.41	15.01
6	002405	四维图新	89,277,993.21	14.53
7	002439	启明星辰	64,404,328.95	10.48
8	300339	润和软件	56,491,123.94	9.19
9	300168	万达信息	49,438,532.33	8.05
10	300229	拓尔思	44,728,492.65	7.28
11	300682	朗新科技	44,456,303.65	7.24
12	002065	东华软件	44,063,836.78	7.17
13	002212	天融信	39,081,852.91	6.36
14	300803	指南针	37,744,700.11	6.14
15	300379	东方通	35,605,041.28	5.80
16	002153	石基信息	35,544,769.57	5.79
17	002063	远光软件	33,529,657.77	5.46
18	300166	东方国信	31,879,828.45	5.19
19	300036	超图软件	31,233,705.90	5.08
20	300188	美亚柏科	30,428,150.23	4.95
21	300674	宇信科技	29,280,925.48	4.77
22	300075	数字政通	29,101,775.27	4.74
23	300773	拉卡拉	29,049,192.21	4.73
24	300687	赛意信息	27,904,073.39	4.54
25	601360	三六零	27,773,800.54	4.52

26	300079	数码视讯	25,257,299.51	4.11
27	300369	绿盟科技	22,839,695.14	3.72
28	300348	长亮科技	20,826,476.50	3.39
29	000158	常山北明	20,721,607.00	3.37
30	000555	神州信息	20,667,540.99	3.36
31	300525	博思软件	17,930,253.40	2.92
32	300271	华宇软件	17,319,225.95	2.82
33	300663	科蓝软件	15,878,674.50	2.58
34	300377	赢时胜	14,511,168.69	2.36

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	002230	科大讯飞	253,687,825.27	41.29
2	002410	广联达	137,500,112.70	22.38
3	300454	深信服	97,166,510.98	15.82
4	300033	同花顺	75,377,272.69	12.27
5	002405	四维图新	69,900,140.96	11.38
6	300496	中科创达	69,203,277.90	11.26
7	300168	万达信息	62,907,908.26	10.24
8	002065	东华软件	57,774,683.00	9.40
9	002439	启明星辰	50,696,202.21	8.25
10	300339	润和软件	45,289,891.29	7.37
11	300773	拉卡拉	36,891,417.00	6.00
12	300229	拓尔思	34,708,390.66	5.65
13	300079	数码视讯	34,345,237.42	5.59
14	002212	天融信	30,975,284.27	5.04
15	300682	朗新科技	30,943,636.62	5.04
16	000158	常山北明	28,930,994.93	4.71
17	300379	东方通	28,018,266.05	4.56
18	002153	石基信息	27,134,809.12	4.42
19	002063	远光软件	26,505,152.80	4.31
20	300803	指南针	26,228,309.42	4.27
21	300036	超图软件	24,846,301.06	4.04
22	300166	东方国信	24,403,203.27	3.97
23	300188	美亚柏科	23,475,968.22	3.82
24	300271	华宇软件	23,283,752.78	3.79
25	300075	数字政通	22,656,215.19	3.69
26	300687	赛意信息	22,427,830.76	3.65

27	300674	宇信科技	21,472,349.43	3.49
28	300663	科蓝软件	20,510,540.24	3.34
29	300377	赢时胜	18,507,075.31	3.01
30	300369	绿盟科技	18,421,468.31	3.00
31	300348	长亮科技	16,713,988.26	2.72
32	000555	神州信息	15,110,807.22	2.46

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	1,920,809,412.88
卖出股票的收入（成交）总额	1,531,023,996.78

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。

7.11.2 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	1,012,797.46
2	应收清算款	2,393,350.90
3	应收股利	61,359.50
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	160,819.32
9	合计	3,628,327.18

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	002230	科大讯飞	41,081,820.00	2.88	转融通证券 出借业务的 股票
2	688111	金山办公	28,522,088.00	2.00	转融通证券 出借业务的 股票
3	601360	三六零	14,172,708.00	0.99	转融通证券 出借业务的 股票
4	600570	恒生电子	13,433,157.00	0.94	转融通证券 出借业务的

					股票
5	300033	同花顺	9,324,896.00	0.65	转融通证券出借业务的股票
6	300496	中科创达	8,931,645.00	0.63	转融通证券出借业务的股票
7	600845	宝信软件	5,674,460.80	0.40	转融通证券出借业务的股票
8	002410	广联达	5,643,513.00	0.39	转融通证券出借业务的股票
9	600588	用友网络	5,250,050.00	0.37	转融通证券出借业务的股票
10	300454	深信服	3,295,575.00	0.23	转融通证券出借业务的股票

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688502	茂莱光学	269,492.31	0.02	新股锁定
2	688249	晶合集成	97,397.58	0.01	新股锁定
3	301202	朗威股份	79,009.20	0.01	网下中签
4	688472	阿特斯	75,981.36	0.01	新股锁定
5	301261	恒工精密	72,803.70	0.01	网下中签

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		软件 ETF 联接	
		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
13,381	107,517.4	926,209,7	64.38%	375,218,	26.08%	137,262,601	9.54%

	4	66.00		505.00		.00	
--	---	-------	--	--------	--	-----	--

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	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	141,886,300.00	9.86%
2	中国人寿保险股份有限公司	137,107,100.00	9.53%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	105,051,100.00	7.30%
4	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	100,538,800.00	6.99%
5	中国人寿资产管理有限公司	41,941,200.00	2.92%
6	兴业证券股份有限公司	38,000,000.00	2.64%
7	中国工商银行股份有限公司—华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF—LOF）	31,743,000.00	2.21%
8	新华人寿保险股份有限公司	25,000,000.00	1.74%
9	唐菊珍	22,498,700.00	1.56%
10	中国工商银行股份有限公司—民生加银积极配置6个月持有期混合型基金中基金（FOF）	21,100,000.00	1.47%
-	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	137,262,601.00	9.54%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海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	988,800.00	0.07%

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	50~100
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（2021年2月3日）基金份额总额	449,690,872.00
本报告期期初基金份额总额	782,690,872.00
本报告期基金总申购份额	2,921,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,265,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,438,690,872.00

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	
川财证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	4	3,442,651,241.81	100.00%	647,544.09	100.00%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，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
川财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

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