

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 08 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
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	39
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
8 基金份额持有人信息	55

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	55
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
9	开放式基金份额变动	56
10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	58
11	影响投资者决策的其他重要信息	58
12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 500ETF
场内简称	国泰中证 500ETF
基金主代码	561350
交易代码	561350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	223,700,000.00 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 9 月 1 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>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	张立学
	联系电话	021-31081600转	010-68858113
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95580
传真		021-31081800	010-68858120
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200082	100808
法定代表人		周向勇	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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 15-20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（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	-14,282,198.15
本期利润	-10,074,386.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0418
本期加权平均净值利润率	-5.30%
本期基金份额净值增长率	-7.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)

期末可供分配利润	-54,929,124.74
期末可供分配基金份额利润	-0.2455
期末基金资产净值	168,770,875.26
期末基金份额净值	0.7545
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-24.55%

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。

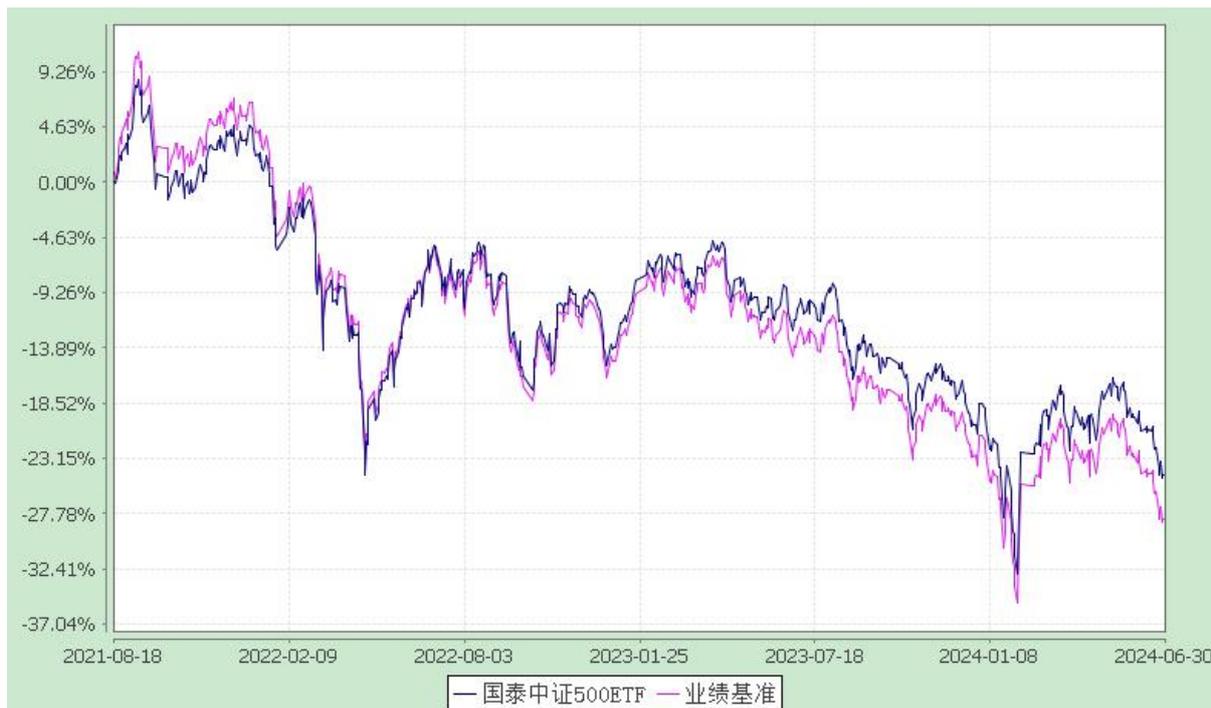
3.2 基金净值表现

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	-6.06%	0.94%	-6.89%	0.96%	0.83%	-0.02%
过去三个月	-5.07%	1.12%	-6.50%	1.14%	1.43%	-0.02%
过去六个月	-7.41%	1.57%	-8.96%	1.61%	1.55%	-0.04%
过去一年	-15.55%	1.25%	-17.60%	1.27%	2.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-24.55%	1.17%	-28.31%	1.20%	3.76%	-0.03%

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 500 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 8 月 18 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为 2021 年 8 月 18 日，本基金的建仓期为六个月，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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 266 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		
黄岳	国泰中证生物医药 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF、国泰中证科创创业 50ETF、国泰中证 500ETF、国泰中证 500ETF 发起联接、国泰中证消费电子主题 ETF、国泰中证消费电子主题 ETF 发起联接、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证光伏产业 ETF 的基金经理	2021-08-18	-	9 年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 2 月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资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，2021 年 2 月至 2023 年 9 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的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 4 月任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 11 月任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 4 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证港股通

				50 交易型开放式指数证券投资基金和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，2023 年 5 月至 2024 年 6 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、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和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。
--	--	--	--	--

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法律法规及行业协会的相关规定。

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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资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。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年一季度 A 股波动率大幅提升，1 月市场大幅下挫，呈现流动性冲击下恐慌抛售的特征，上证指数一度跌至 2635 点。春节前宽基 ETF 迎来巨额申购，市场信心逐渐恢复，并在春节前后发动反攻，2-3 月市场大幅反弹，上证指数收复 3000 点大关。一季度出口和制造业投资带动经济复苏，3 月制造业 PMI 在今年以来首次站上荣枯线。

2024 年二季度 A 股冲高回落，上证指数在 5 月到达 3174.27，随后在 6 月出现连续调整，收于 2967.4。二季度地产政策频出，一线城市相继放松贷款及限购措施，市场成交小幅回暖。制造业 PMI 从 5 月以来回到荣枯线之下。央行禁止手工补息后，4-5 月金融数据出现回落。作为指数基金，本基金旨在为看好中盘股的投资者提供投资工具。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复牌的分析判断，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-7.41%，同期业绩比较基准收益率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国泰中证 500ETF 跟踪中证 500 指数，中证 500 指数代表中盘股的表现，成分股多属于各细分行业龙头公司。行业分布来看，化工、医药生物、电子、计算机、有色金属、电气设备居前列，周期+成长风格占比高。中证 500 成分股集中度低，行业分布均衡，能够更好的分散行业和个股风险。

中证 500 估值水平处于历史低位，配置性价比凸显。

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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,865,785.56	2,037,823.31
结算备付金		170,259.29	494,066.33
存出保证金		203,899.93	362,855.23
交易性金融资产	6.4.7.2	167,350,933.11	218,818,806.38
其中：股票投资		167,350,933.11	218,818,806.38
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		271,224.64	480,659.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		169,862,102.53	222,194,210.41
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		40,991.04	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		66,882.63	90,324.48
应付托管费		13,376.53	18,064.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30.27	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	969,946.80	688,934.69
负债合计		1,091,227.27	797,324.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	223,700,000.00	271,700,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-54,929,124.74	-50,303,113.67
净资产合计		168,770,875.26	221,396,886.33
负债和净资产总计		169,862,102.53	222,194,210.41

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7545 元，基金份额总额 223,700,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-9,414,235.55	11,726,206.40
1.利息收入		25,604.31	24,151.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,464.70	24,151.97
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		-	-
其他利息收入		10,139.61	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,213,122.66	14,066,944.22
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-16,279,027.06	9,546,556.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	28,866.77
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	2,065,904.40	4,491,521.32
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	4,207,812.04	-2,701,560.58
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	565,470.76	336,670.79
减：二、营业总支出		660,150.56	1,067,874.21
1. 管理人报酬		481,663.51	819,554.68
2. 托管费		96,332.69	163,910.95

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		37.91	0.10
8. 其他费用	6.4.7.16	82,116.45	84,408.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,074,386.11	10,658,332.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,074,386.11	10,658,332.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,074,386.11	10,658,332.19

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	271,700,000.00	-50,303,113.67	221,396,886.33
二、本期期初净资产	271,700,000.00	-50,303,113.67	221,396,886.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,000,000.00	-4,626,011.07	-52,626,011.07
（一）、综合收益总额	-	-10,074,386.11	-10,074,386.11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-48,000,000.00	5,448,375.04	-42,551,624.96
其中：1.基金申购款	426,000,000.00	-99,478,336.31	326,521,663.69
2.基金赎回款	-474,000,000.00	104,926,711.35	-369,073,288.65
（三）、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	223,700,000.00	-54,929,124.74	168,770,875.26
项目	上年度可比期间 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	202,700,000.00	-28,175,629.86	174,524,370.14
二、本期期初净资产	202,700,000.00	-28,175,629.86	174,524,370.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	417,000,000.00	-37,858,454.52	379,141,545.48
（一）、综合收益总额	-	10,658,332.19	10,658,332.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	417,000,000.00	-48,516,786.71	368,483,213.29
其中：1.基金申购款	1,038,000,000.00	-95,519,741.32	942,480,258.68
2.基金赎回款	-621,000,000.00	47,002,954.61	-573,997,045.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	619,700,000.00	-66,034,084.38	553,665,915.62

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：李昇，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 500 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[2021]1958 号《关于准予国泰中证 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 727,700,000.00 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 0821 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 727,700,000.00 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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]366 号文核准,本基金于 2021 年 9 月 1 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 500 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(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准:中证 500 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 500 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 500ETF 联接基金”)。国泰中证 500ETF 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 2024 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》、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 500 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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的说明

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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,865,785.56
等于：本金	1,865,335.25
加：应计利息	450.31
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,865,785.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	178,117,771.73	-	167,350,933.11	-10,766,838.62
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	178,117,771.73	-	167,350,933.11	-10,766,838.62

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	51,462.59
其中：交易所市场	51,462.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,049.24
可退替代款	7,235.40
应付替代款	829,199.57
合计	969,946.80

注：1、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。

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	271,700,000.00	271,700,000.00
本期申购	426,000,000.00	426,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-474,000,000.00	-474,000,000.00
本期末	223,700,000.00	223,700,000.00

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	-33,853,427.54	-16,449,686.13	-50,303,113.67
本期期初	-33,853,427.54	-16,449,686.13	-50,303,113.67
本期利润	-14,282,198.15	4,207,812.04	-10,074,386.11
本期基金份额交易产生的变动数	7,931,898.37	-2,483,523.33	5,448,375.04
其中：基金申购款	-74,349,902.08	-25,128,434.23	-99,478,336.31
基金赎回款	82,281,800.45	22,644,910.90	104,926,711.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,203,727.32	-14,725,397.42	-54,929,124.74

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,560.19
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	3,998.16
其他	1,906.35
合计	15,464.70

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,669,867.84
股票投资收益——赎回差价收入	-6,609,159.22
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	-16,279,027.06

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	203,973,924.77
减：卖出股票成本总额	213,428,401.76
减：交易费用	215,390.85
买卖股票差价收入	-9,669,867.84

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	369,073,288.65
减：现金支付赎回款总额	184,665,831.65
减：赎回股票成本总额	191,016,616.22
减：交易费用	-
赎回差价收入	-6,609,159.22

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,065,904.40
其中：证券出借权益补偿收入	29,082.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,065,904.40

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,207,812.04
——股票投资	4,207,812.04
——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	4,207,812.04

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	565,470.76
合计	565,470.76

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
存托服务费	67.21
合计	82,116.45

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 500 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 500ETF 发起联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	481,663.51	819,554.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	312.51	-
应支付基金管理人的净管理费	481,351.00	819,554.68

注：支付基金管理人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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	96,332.69	163,910.95
----------------	-----------	------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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 500ETF 发起联接	20,496,272.00	9.16%	18,831,543.00	6.93%

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国邮政储蓄银行	1,865,785.56	9,560.19	2,859,803.40	14,750.99

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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（2024 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
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	网下中签流通受限	20.56	20.56	834.00	17,147.04	17,147.04	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	网下中签流通受限	18.65	18.65	751.00	14,006.15	14,006.15	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	16.16	32.27	367.00	5,930.72	11,843.09	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.90	16.97	550.00	4,895.00	9,333.50	-
301392	汇成真真空	2024-05-28	6 个月以上	新股锁定流通	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-

				受限						
30159 1	肯特 股份	2024-0 2-20	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	19.43	36.98	219.00	4,255. 17	8,098. 62	-
68869 2	达梦 数据	2024-0 6-04	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	86.96	174.93	46.00	4,000. 16	8,046. 78	-
68869 1	灿芯 股份	2024-0 4-02	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	19.86	42.51	170.00	3,376. 20	7,226. 70	-
30153 9	宏鑫 科技	2024-0 4-03	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	10.64	19.82	361.00	3,841. 04	7,155. 02	-
30156 5	中仑 新材	2024-0 6-13	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	11.88	18.98	343.00	4,074. 84	6,510. 14	-
68870 9	成都 华微	2024-0 1-31	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	15.69	18.79	335.00	5,256. 15	6,294. 65	-
68869 5	中创 股份	2024-0 3-06	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	22.43	31.55	186.00	4,171. 98	5,868. 30	-
30158 0	爱迪 特	2024-0 6-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	44.95	65.93	84.00	3,775. 80	5,538. 12	-
30158 8	美新 科技	2024-0 3-06	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	14.50	21.25	257.00	3,726. 50	5,461. 25	-
30150 2	华阳 智能	2024-0 1-26	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	28.01	37.83	132.00	3,697. 32	4,993. 56	-
00138 9	广合 科技	2024-0 3-26	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	17.43	34.56	137.00	2,387. 91	4,734. 72	-

60334 1	龙旗 科技	2024-0 2-23	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	26.00	37.49	123.00	3,198. 00	4,611. 27	-
60103 3	永兴 股份	2024-0 1-11	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	16.20	15.96	262.00	4,244. 40	4,181. 52	-
00135 9	平安 电工	2024-0 3-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	17.39	20.60	129.00	2,243. 31	2,657. 40	-
60308 2	北自 科技	2024-0 1-23	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	21.28	29.49	85.00	1,808. 80	2,506. 65	-
60334 4	星德 胜	2024-0 3-13	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	19.18	22.66	104.00	1,994. 72	2,356. 64	-
60332 5	博隆 技术	2024-0 1-03	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	72.46	68.06	33.00	2,391. 18	2,245. 98	-
00137 9	腾达 科技	2024-0 1-11	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	16.98	13.48	152.00	2,580. 96	2,048. 96	-
60337 5	盛景 微	2024-0 1-17	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	38.18	38.90	50.00	1,909. 00	1,945. 00	-
60331 2	西典 新能	2024-0 1-04	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	29.02	25.36	73.00	2,118. 46	1,851. 28	-
00138 7	雪祺 电气	2024-0 1-04	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	15.38	15.25	120.00	1,845. 60	1,830. 00	-
60338 1	永臻 股份	2024-0 6-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	23.35	25.13	63.00	1,471. 05	1,583. 19	-
00138	雪祺	2024-0	1-6 个	送股	-	15.25	36.00	-	549.00	-

7	电气	6-03	月 (含)							
---	----	------	----------	--	--	--	--	--	--	--

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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是通过紧密跟踪标的指数，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邮储银行，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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2023 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，由于组合资产流动性差，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 2024 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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	1,865,785.56	-	-	-	1,865,785.56
结算备付金	170,259.29	-	-	-	170,259.29
存出保证金	203,899.93	-	-	-	203,899.93
交易性金融资产	-	-	-	167,350,933.11	167,350,933.11
应收清算款	-	-	-	271,224.64	271,224.64
资产总计	2,239,944.78	-	-	167,622,157.75	169,862,102.53
负债					
应付清算款	-	-	-	40,991.04	40,991.04
应付管理人报酬	-	-	-	66,882.63	66,882.63
应付托管费	-	-	-	13,376.53	13,376.53
应交税费	-	-	-	30.27	30.27
其他负债	-	-	-	969,946.80	969,946.80
负债总计	-	-	-	1,091,227.27	1,091,227.27
利率敏感度缺口	2,239,944.78	-	-	166,530,930.48	168,770,875.26
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,037,823.31	-	-	-	2,037,823.31
结算备付金	494,066.33	-	-	-	494,066.33
存出保证金	362,855.23	-	-	-	362,855.23
交易性金融资产	-	-	-	218,818,806.38	218,818,806.38
应收清算款	-	-	-	480,659.16	480,659.16
资产总计	2,894,744.87	-	-	219,299,465.54	222,194,210.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	90,324.48	90,324.48
应付托管费	-	-	-	18,064.91	18,064.91
其他负债	-	-	-	688,934.69	688,934.69
负债总计	-	-	-	797,324.08	797,324.08

利率敏感度缺口	2,894,744.87	-	-	218,502,141.46	221,396,886.33
---------	--------------	---	---	----------------	----------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 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%（2023 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（2023 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	167,350,933.11	99.16	218,818,806.3 8	98.84
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	167,350,933.11	99.16	218,818,806.3 8	98.84

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 828	增加约 1,091
	业绩比较基准下降 5%	减少约 828	减少约 1,091

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	167,191,185.04	218,327,725.63
第二层次	31,153.19	-
第三层次	128,594.88	491,080.75
合计	167,350,933.11	218,818,806.38

6.4.14.2 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 2024 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(2023 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 942,480,258.68 元，其中包括以股票支付的申购款 460,975,273.18 元和以现金支付的申购款 481,504,985.50 元。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	167,350,933.11	98.52
	其中：股票	167,350,933.11	98.52
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	2,036,044.85	1.20
8	其他各项资产	475,124.57	0.28
9	合计	169,862,102.53	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，本基金无参与转融通证券出借业务借出的股票。

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	1,034,587.00	0.61
B	采矿业	7,713,389.84	4.57
C	制造业	104,574,697.28	61.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,645,599.27	3.94
E	建筑业	1,681,163.90	1.00
F	批发和零售业	3,515,643.76	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	3,310,582.30	1.96
H	住宿和餐饮业	525,089.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,734,318.40	6.95
J	金融业	15,350,919.77	9.10

K	房地产业	1,865,467.56	1.11
L	租赁和商务服务业	1,258,771.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	1,325,934.12	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	747,441.22	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	183,906.00	0.11
Q	卫生和社会工作	1,023,164.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	2,483,357.00	1.47
S	综合	296,384.00	0.18
	合计	165,270,415.42	97.93

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	3,093.00	0.00
C	制造业	230,603.39	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	596,960.00	0.35
E	建筑业	828,944.00	0.49
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	131,646.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,141.78	0.01
J	金融业	263,872.00	0.16
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	4,181.52	0.00
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	2,080,441.69	1.23

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	300502	新易盛	19,800	2,089,890.00	1.24
2	002028	思源电气	17,100	1,143,990.00	0.68
3	601058	赛轮轮胎	73,200	1,024,800.00	0.61
4	688169	石头科技	2,580	1,012,908.00	0.60
5	600066	宇通客车	37,000	954,600.00	0.57
6	002340	格林美	143,100	911,547.00	0.54
7	000933	神火股份	43,900	888,097.00	0.53
8	601077	渝农商行	172,600	866,452.00	0.51
9	000988	华工科技	28,000	838,040.00	0.50
10	601168	西部矿业	46,400	832,880.00	0.49
11	300394	天孚通信	9,200	813,464.00	0.48
12	000423	东阿阿胶	12,600	788,760.00	0.47
13	002384	东山精密	38,100	788,670.00	0.47
14	000630	铜陵有色	213,900	772,179.00	0.46
15	600418	江淮汽车	48,700	771,408.00	0.46
16	600988	赤峰黄金	46,300	756,542.00	0.45
17	601233	桐昆股份	46,900	748,524.00	0.44
18	600157	永泰能源	618,900	730,302.00	0.43
19	002625	光启技术	42,000	728,700.00	0.43
20	600096	云天化	35,700	693,294.00	0.41
21	601567	三星医疗	19,700	689,500.00	0.41
22	000400	许继电气	19,900	684,759.00	0.41
23	688777	中控技术	17,600	663,520.00	0.39
24	002156	通富微电	29,500	660,505.00	0.39
25	002128	电投能源	31,200	658,320.00	0.39
26	002273	水晶光电	38,700	657,126.00	0.39
27	601555	东吴证券	110,760	653,484.00	0.39
28	002078	太阳纸业	46,600	650,070.00	0.39
29	600885	宏发股份	23,220	642,729.60	0.38

30	688617	惠泰医疗	1,400	638,540.00	0.38
31	601128	常熟银行	84,200	637,394.00	0.38
32	002532	天山铝业	77,700	630,147.00	0.37
33	300207	欣旺达	41,500	629,555.00	0.37
34	002223	鱼跃医疗	16,700	627,920.00	0.37
35	600352	浙江龙盛	72,600	623,634.00	0.37
36	600398	海澜之家	66,800	617,232.00	0.37
37	002138	顺络电子	22,400	615,104.00	0.36
38	002966	苏州银行	81,610	612,075.00	0.36
39	002353	杰瑞股份	17,100	599,868.00	0.36
40	601108	财通证券	90,580	598,733.80	0.35
41	600765	中航重机	28,880	589,152.00	0.35
42	002185	华天科技	71,400	581,910.00	0.34
43	002517	恺英网络	59,900	572,045.00	0.34
44	600879	航天电子	73,400	570,318.00	0.34
45	603606	东方电缆	11,500	561,315.00	0.33
46	301236	软通动力	15,900	559,839.00	0.33
47	688099	晶晨股份	9,418	558,675.76	0.33
48	600873	梅花生物	55,600	557,112.00	0.33
49	600177	雅戈尔	77,476	551,629.12	0.33
50	601577	长沙银行	67,100	548,878.00	0.33
51	002738	中矿资源	20,400	546,720.00	0.32
52	600079	人福医药	31,800	546,006.00	0.32
53	600109	国金证券	72,300	545,865.00	0.32
54	300003	乐普医疗	36,600	543,144.00	0.32
55	600060	海信视像	21,800	539,332.00	0.32
56	300017	网宿科技	67,900	536,410.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	99,276	530,133.84	0.31
58	300136	信维通信	27,000	528,660.00	0.31
59	603160	汇顶科技	7,600	522,500.00	0.31
60	603979	金诚信	10,300	520,459.00	0.31
61	002202	金风科技	77,000	517,440.00	0.31
62	689009	九号公司	14,036	516,665.16	0.31
63	002739	万达电影	42,600	515,034.00	0.31
64	000932	华菱钢铁	115,300	510,779.00	0.30
65	002465	海格通信	48,500	502,460.00	0.30
66	000683	远兴能源	72,700	502,357.00	0.30
67	600985	淮北矿业	30,000	502,200.00	0.30
68	600536	中国软件	16,756	501,339.52	0.30
69	600348	华阳股份	50,250	500,490.00	0.30
70	002281	光迅科技	13,300	497,021.00	0.29
71	002409	雅克科技	7,900	496,989.00	0.29
72	002444	巨星科技	20,100	496,470.00	0.29
73	688120	华海清科	2,605	493,855.90	0.29

74	000009	中国宝安	57,400	493,640.00	0.29
75	002008	大族激光	23,400	486,720.00	0.29
76	688122	西部超导	12,700	486,664.00	0.29
77	002436	兴森科技	47,100	486,072.00	0.29
78	000878	云南铜业	39,000	485,940.00	0.29
79	300474	景嘉微	7,650	483,709.50	0.29
80	600642	申能股份	54,400	480,352.00	0.28
81	601615	明阳智能	50,600	477,664.00	0.28
82	002797	第一创业	93,800	477,442.00	0.28
83	300054	鼎龙股份	21,000	476,280.00	0.28
84	000039	中集集团	51,300	475,038.00	0.28
85	601990	南京证券	61,600	473,088.00	0.28
86	300012	华测检测	46,800	470,808.00	0.28
87	000066	中国长城	53,800	470,750.00	0.28
88	600529	山东药玻	18,500	468,790.00	0.28
89	688525	佰维存储	7,300	468,295.00	0.28
90	600298	安琪酵母	16,700	466,431.00	0.28
91	600839	四川长虹	102,900	462,021.00	0.27
92	002673	西部证券	74,600	461,774.00	0.27
93	603596	伯特利	11,840	460,576.00	0.27
94	601179	中国西电	57,100	459,084.00	0.27
95	601666	平煤股份	40,800	456,960.00	0.27
96	000831	中国稀土	17,700	448,695.00	0.27
97	000783	长江证券	92,400	446,292.00	0.26
98	300395	菲利华	14,500	445,875.00	0.26
99	603816	顾家家居	13,760	444,310.40	0.26
100	601717	郑煤机	30,000	444,000.00	0.26
101	300002	神州泰岳	54,500	442,540.00	0.26
102	000728	国元证券	73,000	442,380.00	0.26
103	002432	九安医疗	10,900	441,886.00	0.26
104	000738	航发控制	22,000	441,540.00	0.26
105	600862	中航高科	23,300	437,574.00	0.26
106	000703	恒逸石化	61,200	433,908.00	0.26
107	688180	君实生物	14,900	432,845.00	0.26
108	601198	东兴证券	54,000	429,840.00	0.25
109	601997	贵阳银行	81,500	429,505.00	0.25
110	603338	浙江鼎力	7,100	428,982.00	0.25
111	002595	豪迈科技	11,200	427,504.00	0.25
112	000960	锡业股份	27,500	425,975.00	0.25
113	603345	安井食品	5,700	423,567.00	0.25
114	002155	湖南黄金	23,400	423,540.00	0.25
115	300866	安克创新	5,940	422,987.40	0.25
116	601696	中银证券	46,500	422,220.00	0.25
117	600863	内蒙华电	90,700	420,848.00	0.25

118	601162	天风证券	192,930	420,587.40	0.25
119	300037	新宙邦	14,700	419,832.00	0.25
120	002472	双环传动	18,900	416,178.00	0.25
121	600521	华海药业	24,400	416,020.00	0.25
122	000921	海信家电	12,900	415,896.00	0.25
123	300724	捷佳伟创	7,700	415,877.00	0.25
124	600038	中直股份	10,100	415,211.00	0.25
125	300001	特锐德	20,600	414,472.00	0.25
126	603939	益丰药房	16,824	413,029.20	0.24
127	002294	信立泰	15,500	412,765.00	0.24
128	002984	森麒麟	17,100	411,939.00	0.24
129	600141	兴发集团	21,500	410,220.00	0.24
130	688188	柏楚电子	2,216	408,962.80	0.24
131	600549	厦门钨业	23,630	407,617.50	0.24
132	600699	均胜电子	27,500	407,550.00	0.24
133	002407	多氟多	33,300	407,259.00	0.24
134	002850	科达利	5,300	404,814.00	0.24
135	600546	山煤国际	27,600	403,512.00	0.24
136	300699	光威复材	16,180	401,749.40	0.24
137	600820	隧道股份	61,200	399,636.00	0.24
138	301358	湖南裕能	12,700	399,542.00	0.24
139	002262	恩华药业	16,800	398,832.00	0.24
140	600895	张江高科	21,507	397,449.36	0.24
141	002064	华峰化学	55,400	397,218.00	0.24
142	002195	岩山科技	157,900	396,329.00	0.23
143	300285	国瓷材料	22,200	396,270.00	0.23
144	600872	中炬高新	17,400	394,806.00	0.23
145	000021	深科技	26,100	394,632.00	0.23
146	600369	西南证券	109,500	392,010.00	0.23
147	603589	口子窖	10,000	391,900.00	0.23
148	603087	甘李药业	8,400	389,088.00	0.23
149	601000	唐山港	82,600	388,220.00	0.23
150	300073	当升科技	11,300	387,703.00	0.23
151	600021	上海电力	39,200	387,688.00	0.23
152	300146	汤臣倍健	28,400	384,820.00	0.23
153	600486	扬农化工	6,811	384,480.95	0.23
154	000513	丽珠集团	10,200	379,542.00	0.22
155	601966	玲珑轮胎	20,600	378,422.00	0.22
156	300058	蓝色光标	69,300	376,992.00	0.22
157	600704	物产中大	86,656	376,087.04	0.22
158	002756	永兴材料	10,500	375,690.00	0.22
159	600153	建发股份	41,900	374,167.00	0.22
160	603179	新泉股份	9,500	372,780.00	0.22
161	688065	凯赛生物	8,200	372,198.00	0.22

162	600155	华创云信	62,935	371,945.85	0.22
163	300114	中航电测	8,200	371,050.00	0.22
164	000830	鲁西化工	32,000	370,880.00	0.22
165	300529	健帆生物	13,500	367,335.00	0.22
166	600118	中国卫星	16,400	364,572.00	0.22
167	600583	海油工程	61,600	364,056.00	0.22
168	002558	巨人网络	38,400	362,496.00	0.21
169	002152	广电运通	34,600	361,916.00	0.21
170	000591	太阳能	76,200	358,902.00	0.21
171	601156	东航物流	17,600	358,160.00	0.21
172	000623	吉林敖东	26,600	356,440.00	0.21
173	600970	中材国际	29,465	355,347.90	0.21
174	300373	扬杰科技	9,100	353,990.00	0.21
175	002385	大北农	91,600	352,660.00	0.21
176	002025	航天电器	7,600	352,488.00	0.21
177	002439	启明星辰	20,400	352,104.00	0.21
178	300144	宋城演艺	43,800	351,714.00	0.21
179	600380	健康元	31,100	347,387.00	0.21
180	601216	君正集团	94,000	346,860.00	0.21
181	000729	燕京啤酒	39,188	346,030.04	0.21
182	605358	立昂微	14,900	344,786.00	0.20
183	300251	光线传媒	40,900	343,969.00	0.20
184	600998	九州通	70,461	343,849.68	0.20
185	600143	金发科技	52,000	343,720.00	0.20
186	000723	美锦能源	72,200	343,672.00	0.20
187	600637	东方明珠	56,370	342,729.60	0.20
188	600282	南钢股份	68,700	342,126.00	0.20
189	000519	中兵红箭	23,300	341,811.00	0.20
190	000636	风华高科	25,900	338,254.00	0.20
191	600516	方大炭素	78,437	338,063.47	0.20
192	300677	英科医疗	12,600	337,806.00	0.20
193	300383	光环新网	39,900	337,155.00	0.20
194	300024	机器人	34,520	336,224.80	0.20
195	600392	盛和资源	38,977	335,981.74	0.20
196	600763	通策医疗	6,200	335,110.00	0.20
197	000818	航锦科技	15,100	333,408.00	0.20
198	002958	青农商行	123,700	331,516.00	0.20
199	601665	齐鲁银行	67,400	330,934.00	0.20
200	600909	华安证券	78,500	330,485.00	0.20
201	688213	思特威	6,800	329,800.00	0.20
202	002044	美年健康	87,000	328,860.00	0.19
203	600008	首创环保	122,600	328,568.00	0.19
204	000883	湖北能源	54,300	326,343.00	0.19
205	000629	钒钛股份	129,800	324,500.00	0.19

206	601016	节能风电	108,390	324,086.10	0.19
207	600566	济川药业	10,200	323,442.00	0.19
208	600511	国药股份	10,482	322,740.78	0.19
209	600867	通化东宝	38,500	322,245.00	0.19
210	300088	长信科技	68,500	321,950.00	0.19
211	601456	国联证券	33,300	321,012.00	0.19
212	600170	上海建工	148,300	318,845.00	0.19
213	000997	新大陆	22,900	318,539.00	0.19
214	600582	天地科技	46,052	317,298.28	0.19
215	600498	烽火通信	19,900	316,410.00	0.19
216	600499	科达制造	37,300	314,439.00	0.19
217	600004	白云机场	33,100	313,788.00	0.19
218	601933	永辉超市	126,400	313,472.00	0.19
219	600535	天士力	24,900	313,242.00	0.19
220	600129	太极集团	10,800	312,336.00	0.19
221	600580	卧龙电驱	25,700	312,255.00	0.19
222	000598	兴蓉环境	41,500	312,080.00	0.18
223	002120	韵达股份	40,300	311,922.00	0.18
224	601991	大唐发电	103,500	311,535.00	0.18
225	300567	精测电子	5,500	310,805.00	0.18
226	000750	国海证券	106,800	310,788.00	0.18
227	000060	中金岭南	73,000	309,520.00	0.18
228	002261	拓维信息	27,900	308,853.00	0.18
229	603000	人民网	15,400	307,846.00	0.18
230	300568	星源材质	37,500	307,500.00	0.18
231	300118	东方日升	25,300	306,130.00	0.18
232	002430	杭氧股份	13,700	304,825.00	0.18
233	002429	兆驰股份	63,000	303,030.00	0.18
234	603486	科沃斯	6,400	301,952.00	0.18
235	002939	长城证券	44,900	300,830.00	0.18
236	600166	福田汽车	133,700	300,825.00	0.18
237	603156	养元饮品	14,100	299,907.00	0.18
238	603658	安图生物	6,500	299,455.00	0.18
239	600325	华发股份	46,000	299,000.00	0.18
240	601231	环旭电子	18,600	298,530.00	0.18
241	300765	新诺威	11,800	297,714.00	0.18
242	600816	建元信托	109,800	297,558.00	0.18
243	600673	东阳光	42,100	296,384.00	0.18
244	603228	景旺电子	9,300	295,740.00	0.18
245	600754	锦江酒店	12,800	294,144.00	0.17
246	002508	老板电器	13,300	293,930.00	0.17
247	000893	亚钾国际	18,100	292,496.00	0.17
248	300487	蓝晓科技	7,000	292,320.00	0.17
249	603927	中科软	16,140	291,972.60	0.17

250	300601	康泰生物	18,700	291,907.00	0.17
251	603568	伟明环保	14,159	291,392.22	0.17
252	000027	深圳能源	39,675	289,627.50	0.17
253	600563	法拉电子	3,800	289,484.00	0.17
254	601636	旗滨集团	44,800	288,960.00	0.17
255	002926	华西证券	43,800	288,642.00	0.17
256	000998	隆平高科	29,300	288,019.00	0.17
257	688052	纳芯微	2,800	287,784.00	0.17
258	603298	杭叉集团	14,600	286,744.00	0.17
259	002624	完美世界	37,700	286,520.00	0.17
260	002497	雅化集团	32,100	286,332.00	0.17
261	600737	中粮糖业	29,778	285,571.02	0.17
262	002653	海思科	9,300	285,510.00	0.17
263	603290	斯达半导	3,300	284,163.00	0.17
264	603077	和邦生物	172,100	283,965.00	0.17
265	300253	卫宁健康	48,100	283,790.00	0.17
266	002299	圣农发展	20,800	283,712.00	0.17
267	600131	国网信通	16,800	283,416.00	0.17
268	002056	横店东磁	22,700	283,069.00	0.17
269	300604	长川科技	10,400	282,568.00	0.17
270	002500	山西证券	60,100	282,470.00	0.17
271	601958	金钼股份	27,100	282,111.00	0.17
272	002065	东华软件	62,400	282,048.00	0.17
273	688385	复旦微电	8,986	281,980.68	0.17
274	688772	珠海冠宇	18,900	281,610.00	0.17
275	300390	天华新能	16,370	281,236.60	0.17
276	002414	高德红外	47,700	280,953.00	0.17
277	688002	睿创微纳	10,042	280,874.74	0.17
278	600655	豫园股份	54,500	280,675.00	0.17
279	600373	中文传媒	18,900	280,476.00	0.17
280	688114	华大智造	5,900	279,719.00	0.17
281	300009	安科生物	32,700	279,258.00	0.17
282	300763	锦浪科技	6,700	278,988.00	0.17
283	603893	瑞芯微	4,700	278,099.00	0.16
284	601866	中远海发	107,000	276,060.00	0.16
285	002507	涪陵榨菜	22,460	275,135.00	0.16
286	002368	太极股份	12,200	275,110.00	0.16
287	002372	伟星新材	17,700	272,934.00	0.16
288	601611	中国核建	33,700	272,633.00	0.16
289	688390	固德威	4,852	272,294.24	0.16
290	600707	彩虹股份	39,900	271,719.00	0.16
291	000887	中鼎股份	22,000	269,280.00	0.16
292	603885	吉祥航空	24,340	267,496.60	0.16
293	002203	海亮股份	33,400	266,532.00	0.16

294	603225	新凤鸣	17,000	265,030.00	0.16
295	603379	三美股份	6,760	264,586.40	0.16
296	002831	裕同科技	10,300	263,577.00	0.16
297	688521	芯原股份	9,802	262,203.50	0.16
298	600755	厦门国贸	36,400	260,988.00	0.15
299	600859	王府井	22,200	260,628.00	0.15
300	600995	南网储能	26,700	257,922.00	0.15
301	600416	湘电股份	25,900	257,446.00	0.15
302	600801	华新水泥	18,700	257,125.00	0.15
303	600329	达仁堂	7,900	255,881.00	0.15
304	002683	广东宏大	12,700	255,651.00	0.15
305	600390	五矿资本	63,000	255,150.00	0.15
306	600884	杉杉股份	31,400	254,968.00	0.15
307	601880	辽港股份	206,500	253,995.00	0.15
308	300070	碧水源	60,500	253,495.00	0.15
309	002019	亿帆医药	20,500	253,380.00	0.15
310	300296	利亚德	56,300	253,350.00	0.15
311	600435	北方导航	29,325	252,781.50	0.15
312	002506	协鑫集成	130,100	252,394.00	0.15
313	002244	滨江集团	34,600	251,196.00	0.15
314	600483	福能股份	21,400	249,524.00	0.15
315	600739	辽宁成大	29,800	249,426.00	0.15
316	000050	深天马 A	34,200	248,976.00	0.15
317	300748	金力永磁	19,200	248,832.00	0.15
318	600598	北大荒	19,900	248,551.00	0.15
319	601098	中南传媒	20,000	248,400.00	0.15
320	300803	指南针	6,800	247,588.00	0.15
321	002572	索菲亚	16,100	246,813.00	0.15
322	601598	中国外运	43,800	246,594.00	0.15
322	600399	抚顺特钢	43,800	246,594.00	0.15
324	002568	百润股份	14,600	245,718.00	0.15
325	300676	华大基因	7,000	245,070.00	0.15
326	000155	川能动力	22,700	244,479.00	0.14
327	600848	上海临港	26,720	243,419.20	0.14
328	600901	江苏金租	48,057	242,687.85	0.14
329	002487	大金重工	10,600	242,528.00	0.14
330	002080	中材科技	18,800	242,520.00	0.14
331	002240	盛新锂能	18,000	241,560.00	0.14
332	001286	陕西能源	20,800	239,824.00	0.14
333	002557	洽洽食品	8,500	239,615.00	0.14
334	002373	千方科技	26,400	239,448.00	0.14
335	002936	郑州银行	137,659	238,150.07	0.14
336	603883	老百姓	12,846	235,852.56	0.14
337	000563	陕国投 A	85,700	235,675.00	0.14

338	300595	欧普康视	15,000	235,200.00	0.14
339	002268	电科网安	16,500	234,795.00	0.14
340	603712	七一二	12,900	234,651.00	0.14
341	600968	海油发展	56,800	234,016.00	0.14
342	603858	步长制药	15,400	233,310.00	0.14
343	000778	新兴铸管	66,800	232,464.00	0.14
344	600258	首旅酒店	18,700	230,945.00	0.14
345	601928	凤凰传媒	21,000	230,160.00	0.14
346	688017	绿的谐波	2,800	229,880.00	0.14
347	688234	天岳先进	4,889	229,391.88	0.14
348	688538	和辉光电	115,732	229,149.36	0.14
349	601212	白银有色	82,300	228,794.00	0.14
350	600271	航天信息	31,000	228,160.00	0.14
351	300558	贝达药业	7,000	227,850.00	0.14
352	688331	荣昌生物	5,269	227,620.80	0.13
353	600062	华润双鹤	11,600	227,128.00	0.13
354	600528	中铁工业	30,800	225,456.00	0.13
355	688301	奕瑞科技	1,951	224,813.73	0.13
356	600977	中国电影	20,800	223,808.00	0.13
357	002531	天顺风能	25,000	223,500.00	0.13
358	000709	河钢股份	115,100	223,294.00	0.13
359	601155	新城控股	25,100	222,637.00	0.13
360	603688	石英股份	7,500	222,075.00	0.13
361	688220	翱捷科技	5,926	221,987.96	0.13
362	000739	普洛药业	16,300	221,191.00	0.13
363	688005	容百科技	9,500	221,160.00	0.13
364	002408	齐翔腾达	39,460	220,976.00	0.13
365	600378	昊华科技	7,600	219,640.00	0.13
366	600959	江苏有线	82,700	218,328.00	0.13
367	688536	思瑞浦	2,212	216,355.72	0.13
368	000825	太钢不锈	63,900	215,982.00	0.13
369	601118	海南橡胶	47,100	214,305.00	0.13
370	603444	吉比特	1,200	213,612.00	0.13
371	603737	三棵树	5,860	212,542.20	0.13
372	603882	金城医学	7,800	212,082.00	0.13
373	600056	中国医药	20,920	211,710.40	0.13
374	000987	越秀资本	41,955	208,096.80	0.12
375	600517	国网英大	47,800	206,974.00	0.12
376	600906	财达证券	36,100	206,853.00	0.12
377	601399	国机重装	80,100	206,658.00	0.12
378	603456	九洲药业	15,000	205,800.00	0.12
379	601019	山东出版	17,400	205,668.00	0.12
380	600612	老凤祥	3,500	203,665.00	0.12
381	300212	易华录	12,100	203,643.00	0.12

382	002266	浙富控股	72,600	202,554.00	0.12
383	688200	华峰测控	2,200	201,850.00	0.12
384	600316	洪都航空	12,100	201,223.00	0.12
385	603650	彤程新材	6,700	197,985.00	0.12
386	000937	冀中能源	29,400	196,980.00	0.12
387	688567	孚能科技	20,436	196,185.60	0.12
388	603529	爱玛科技	7,150	195,409.50	0.12
389	600871	石化油服	111,900	194,706.00	0.12
390	688063	派能科技	4,900	194,579.00	0.12
391	600925	苏能股份	38,300	193,415.00	0.11
392	002423	中粮资本	25,800	193,242.00	0.11
393	688297	中无人机	5,800	191,574.00	0.11
394	000032	深桑达 A	12,700	190,246.00	0.11
395	601965	中国汽研	11,200	189,168.00	0.11
396	603728	鸣志电器	4,700	189,081.00	0.11
397	001227	兰州银行	79,200	188,496.00	0.11
398	600098	广州发展	29,300	187,520.00	0.11
399	601298	青岛港	19,500	186,420.00	0.11
400	601608	中信重工	48,600	185,166.00	0.11
401	600208	新湖中宝	116,500	184,070.00	0.11
402	002607	中公教育	120,200	183,906.00	0.11
403	600663	陆家嘴	20,800	183,456.00	0.11
404	603233	大参林	12,779	182,739.70	0.11
405	688516	奥特维	4,359	182,249.79	0.11
406	002670	国盛金控	21,500	182,105.00	0.11
407	688561	奇安信	7,700	181,874.00	0.11
408	600578	京能电力	55,800	180,792.00	0.11
409	600022	山东钢铁	146,800	179,096.00	0.11
410	300438	鹏辉能源	9,700	177,898.00	0.11
411	300776	帝尔激光	3,860	177,405.60	0.11
412	003031	中瓷电子	3,820	176,636.80	0.10
413	300357	我武生物	8,700	175,914.00	0.10
414	601106	中国一重	76,100	175,791.00	0.10
415	600377	宁沪高速	13,900	175,140.00	0.10
416	600500	中化国际	49,970	174,395.30	0.10
417	002865	钧达股份	4,500	172,710.00	0.10
418	600967	内蒙一机	23,700	170,640.00	0.10
419	000785	居然之家	69,800	169,614.00	0.10
420	688349	三一重能	6,800	168,912.00	0.10
421	600350	山东高速	18,962	167,813.70	0.10
422	300888	稳健医疗	6,620	167,486.00	0.10
423	688475	萤石网络	4,900	167,139.00	0.10
424	600315	上海家化	9,400	167,132.00	0.10
425	600827	百联股份	22,330	164,795.40	0.10

426	000559	万向钱潮	36,900	164,574.00	0.10
427	601568	北元集团	44,340	164,501.40	0.10
428	000537	中绿电	17,239	164,287.67	0.10
429	000958	电投产融	44,800	163,968.00	0.10
430	688425	铁建重工	44,505	163,778.40	0.10
431	002608	江苏国信	21,000	162,750.00	0.10
432	000156	华数传媒	25,900	162,652.00	0.10
433	002690	美亚光电	9,800	161,700.00	0.10
434	603707	健友股份	13,523	160,653.24	0.10
435	002867	周大生	12,300	160,638.00	0.10
436	603517	绝味食品	10,400	160,160.00	0.09
437	688032	禾迈股份	1,392	159,773.76	0.09
438	601992	金隅集团	116,600	159,742.00	0.09
439	688029	南微医学	2,580	158,824.80	0.09
440	603826	坤彩科技	5,340	154,699.80	0.09
441	600126	杭钢股份	37,539	154,285.29	0.09
442	003022	联泓新科	11,200	153,552.00	0.09
443	300682	朗新集团	18,000	153,180.00	0.09
444	000967	盈峰环境	35,500	150,165.00	0.09
445	688778	厦钨新能	4,800	149,952.00	0.09
446	603218	日月股份	14,400	147,888.00	0.09
447	301267	华夏眼科	7,100	147,112.00	0.09
448	600361	创新新材	36,400	146,692.00	0.09
449	600481	双良节能	31,300	146,171.00	0.09
450	600032	浙江新能	20,000	145,600.00	0.09
451	688520	神州细胞	3,700	145,595.00	0.09
452	600339	中油工程	46,300	144,456.00	0.09
453	688248	南网科技	4,807	142,431.41	0.08
454	000898	鞍钢股份	66,700	141,404.00	0.08
455	600095	湘财股份	23,700	141,252.00	0.08
456	603786	科博达	2,200	141,130.00	0.08
457	003035	南网能源	31,700	139,480.00	0.08
458	603127	昭衍新药	10,473	138,976.71	0.08
459	688281	华秦科技	1,620	134,978.40	0.08
460	600808	马钢股份	66,800	134,936.00	0.08
461	002563	森马服饰	22,600	131,306.00	0.08
462	002153	石基信息	22,730	130,242.90	0.08
463	603185	弘元绿能	7,500	128,175.00	0.08
464	601228	广州港	41,600	126,880.00	0.08
465	000539	粤电力 A	24,700	125,476.00	0.07
466	001872	招商港口	6,516	125,433.00	0.07
467	688779	长远锂科	26,897	124,533.11	0.07
468	600928	西安银行	37,200	121,644.00	0.07
469	001203	大中矿业	12,600	121,086.00	0.07

470	000401	冀东水泥	29,600	120,176.00	0.07
471	688006	杭可科技	6,820	119,009.00	0.07
472	000959	首钢股份	43,100	117,232.00	0.07
473	600764	中国海防	5,930	116,405.90	0.07
474	002518	科士达	6,500	115,050.00	0.07
475	603056	德邦股份	8,600	112,660.00	0.07
476	688172	燕东微	6,800	110,024.00	0.07
477	603305	旭升集团	10,400	109,824.00	0.07
478	600299	安迪苏	11,200	108,640.00	0.06
479	601139	深圳燃气	16,000	106,880.00	0.06
480	300861	美畅股份	5,300	102,555.00	0.06
481	603317	天味食品	8,880	101,320.80	0.06
482	688387	信科移动	19,317	97,357.68	0.06
483	688276	百克生物	3,400	96,458.00	0.06
484	301029	怡合达	4,820	94,761.20	0.06
485	688375	国博电子	1,300	91,832.00	0.05
486	002791	坚朗五金	3,500	90,545.00	0.05
487	600927	永安期货	8,100	90,315.00	0.05
488	688819	天能股份	3,700	88,282.00	0.05
489	688153	唯捷创芯	2,300	85,100.00	0.05
490	000031	大悦城	36,000	84,240.00	0.05
491	601858	中国科传	4,400	84,128.00	0.05
492	688107	安路科技	3,237	82,284.54	0.05
493	601828	美凯龙	30,200	77,010.00	0.05
494	601158	重庆水务	16,000	76,800.00	0.05
495	688348	昱能科技	1,300	76,700.00	0.05
496	002945	华林证券	7,500	74,850.00	0.04
497	600956	新天绿能	8,500	69,445.00	0.04
498	688295	中复神鹰	2,700	54,810.00	0.03
499	301165	锐捷网络	1,800	53,712.00	0.03
500	603868	飞科电器	1,300	49,920.00	0.03

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	601117	中国化学	100,600	828,944.00	0.49
2	600803	新奥股份	28,700	596,960.00	0.35
3	600908	无锡银行	49,600	263,872.00	0.16
4	001965	招商公路	11,100	131,646.00	0.08
5	301580	爱迪特	832	63,283.72	0.04
6	603381	永臻股份	622	17,235.19	0.01

7	603350	安乃达	834	17,147.04	0.01
8	603285	键邦股份	751	14,006.15	0.01
9	301536	星宸科技	367	11,843.09	0.01
10	301526	国际复材	3,107	10,346.31	0.01
11	301566	达利凯普	550	9,333.50	0.01
12	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
13	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
14	688692	达梦数据	46	8,046.78	0.00
15	688691	灿芯股份	170	7,226.70	0.00
16	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
17	301565	中仑新材	343	6,510.14	0.00
18	688709	成都华微	335	6,294.65	0.00
19	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
20	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
21	301578	辰奕智能	138	5,460.66	0.00
22	002085	万丰奥威	400	5,296.00	0.00
23	301502	华阳智能	132	4,993.56	0.00
24	001389	广合科技	137	4,734.72	0.00
25	603341	龙旗科技	123	4,611.27	0.00
26	601033	永兴股份	262	4,181.52	0.00
27	000983	山西焦煤	300	3,093.00	0.00
28	001359	平安电工	129	2,657.40	0.00
29	603082	北自科技	85	2,506.65	0.00
30	001387	雪祺电气	156	2,379.00	0.00
31	603344	星德胜	104	2,356.64	0.00
32	603325	博隆技术	33	2,245.98	0.00
33	001379	腾达科技	152	2,048.96	0.00
34	603375	盛景微	50	1,945.00	0.00
35	603312	西典新能	73	1,851.28	0.00
36	603004	鼎龙科技	99	1,678.05	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	300502	新易盛	2,933,853.56	1.33
2	002422	科伦药业	1,730,868.07	0.78
3	000423	东阿阿胶	1,708,146.00	0.77
4	300394	天孚通信	1,693,990.00	0.77
5	002028	思源电气	1,687,245.00	0.76

6	000988	华工科技	1,675,348.00	0.76
7	000933	神火股份	1,619,723.00	0.73
8	002340	格林美	1,561,000.00	0.71
9	002463	沪电股份	1,521,296.20	0.69
10	000630	铜陵有色	1,415,997.00	0.64
11	002966	苏州银行	1,380,596.00	0.62
12	000975	银泰黄金	1,329,633.00	0.60
13	002625	光启技术	1,320,676.00	0.60
14	300418	昆仑万维	1,287,149.00	0.58
15	002850	科达利	1,286,394.00	0.58
16	002517	恺英网络	1,249,880.00	0.56
17	000009	中国宝安	1,246,845.00	0.56
18	000932	华菱钢铁	1,208,528.00	0.55
19	002739	万达电影	1,202,855.75	0.54
20	300207	欣旺达	1,197,728.00	0.54

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	300502	新易盛	3,199,978.00	1.45
2	002463	沪电股份	3,079,419.40	1.39
3	002422	科伦药业	3,052,755.00	1.38
4	000975	银泰黄金	2,452,384.00	1.11
5	300418	昆仑万维	2,355,850.00	1.06
6	300394	天孚通信	2,037,635.00	0.92
7	002028	思源电气	1,915,745.00	0.87
8	000988	华工科技	1,910,769.00	0.86
9	000423	东阿阿胶	1,893,521.00	0.86
10	000933	神火股份	1,838,955.00	0.83
11	002340	格林美	1,797,607.00	0.81
12	002966	苏州银行	1,699,433.00	0.77
13	000630	铜陵有色	1,622,171.00	0.73
14	002625	光启技术	1,487,479.00	0.67
15	002517	恺英网络	1,393,347.00	0.63
16	000009	中国宝安	1,392,885.00	0.63
17	300144	宋城演艺	1,375,048.00	0.62
18	002156	通富微电	1,364,687.00	0.62
19	000932	华菱钢铁	1,351,377.00	0.61
20	300866	安克创新	1,348,005.14	0.61

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	192,180,921.72
卖出股票的收入（成交）总额	203,973,924.77

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“渝农商行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

渝农商行及其分支机构因贷款“三查”不尽职；监控不力贷款资金被挪用；贷款资金回流借款人等原因，受到监管机构公开处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司

经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	203,899.93
2	应收清算款	271,224.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	475,124.57

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301580	爱迪特	5,538.12	0.00	新股锁定

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		中证 500ETF 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
2,376	94,149.83	140,104,4 18.00	62.63%	63,099,3 10.00	28.21%	20,496,272. 00	9.16%

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	中国银河证券股份有限公司融券专用证券账户	21,905,800.00	9.79%
2	UBS AG	15,531,300.00	6.94%
3	华泰证券股份有限公司	14,380,866.00	6.43%
4	招商证券股份有限公司	12,929,347.00	5.78%
5	铸锋资产管理（北京）有限公司—铸锋国锋 9 号私募证券投资基金	10,667,000.00	4.77%
6	申万宏源证券有限公司	10,617,209.00	4.75%
7	广发证券股份有限公司	10,112,128.00	4.52%
8	中信建投证券有限责任公司	9,967,171.00	4.46%
9	铸锋资产管理（北京）有限公司—铸锋国锋 6 号私募证券投资基金	9,345,000.00	4.18%
10	方正证券股份有限公司	6,619,078.00	2.96%
-	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	20,496,272.00	9.16%

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	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（2021 年 8 月 18 日）基金份额总额	727,700,000.00
本报告期期初基金份额总额	271,700,000.00
本报告期基金总申购份额	426,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	474,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	223,700,000.00

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，本基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 3 月 27 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十六次会议审议通过，周向勇先生离任公司总经理、转任董事长并代为履行总经理职务。

2024 年 7 月 25 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十九次会议审议通过，聘任李昇先生担任本基金管理人总经理。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	395,356,527.11	100.00%	88,042.51	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
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2024-03-27

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	2024年02月07日至2024年02月07日	15,897,060.00	399,586,742.00	405,516,631.00	9,967,171.00	4.46%
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、关于准予国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

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 15-20 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

二〇二四年八月三十日