国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2025 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2024 年 09 月 26 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
6.1 审计意见 15
6.2 形成审计意见的基础 15
6.3 其他信息 16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 16
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 19
7.3 净资产变动表 20
7.4 报表附注 21
§8 投资组合报告 47
8.1 期末基金资产组合情况 47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 48
8.3 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 50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 63
8.6 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 63
8.7 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 63
8.8 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 63
8.9 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 63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 64
8.12 投资组合报告附注 64
§9 基金份额持有人信息 66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 66
9.2 期末上市基金前十名持有人 66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 67
§10 开放式基金份额变动 67
§11 重大事件揭示 67
11.1 基金份额持有人大会决议 67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 67
11.4 基金投资策略的改变 68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 68
11.8 其他重大事件 69
§12 备查文件目录 70
12.1 备查文件目录 70
12.2 存放地点 70
12.3 查阅方式 70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF
基金主代码	159338
交易代码	159338
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,516,086,664.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略 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。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 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、金融衍生品投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	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，跟踪中证 A500 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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘国华	李双均
	联系电话	021-31081600转	025-83389842
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	-
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95597
传真		021-31081800	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路228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	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		200082	210009
法定代表人		周向勇	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层及基金托管人住所或办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日**
本期已实现收益	128,464,441.63
本期利润	-277,008,152.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0136
本期加权平均净值利润率	-1.41%
本期基金份额净值增长率	-4.62%
3.1.2 期末数据和指标	**2024 年末**
期末可供分配利润	-1,364,078,172.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0462
期末基金资产净值	28,152,008,491.71
期末基金份额净值	0.9538
3.1.3 累计期末指标	**2024 年末**
基金份额累计净值增长率	-4.62%

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

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

(3)本基金合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，截至 2024 年 12 月 31 日本基金成立尚未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

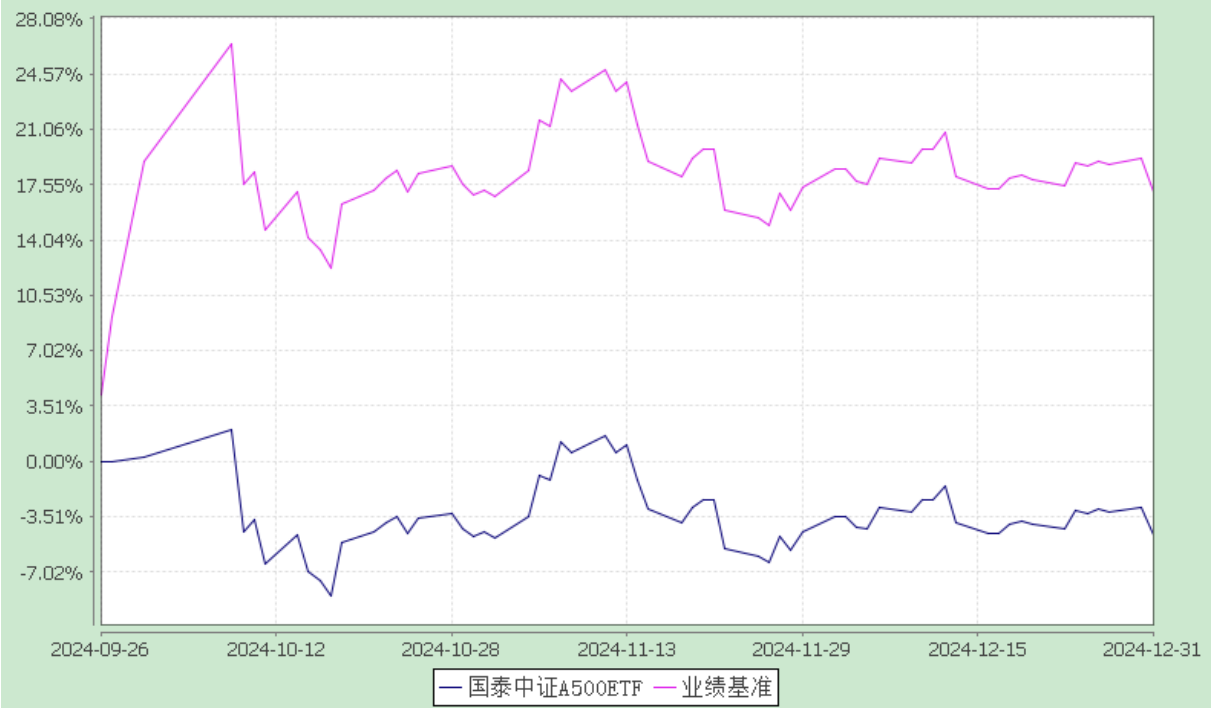
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.83%	1.55%	-1.62%	1.78%	-3.21%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-4.62%	1.51%	17.06%	2.21%	-21.68%	-0.70%

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 9 月 26 日至 2024 年 12 月 31 日)



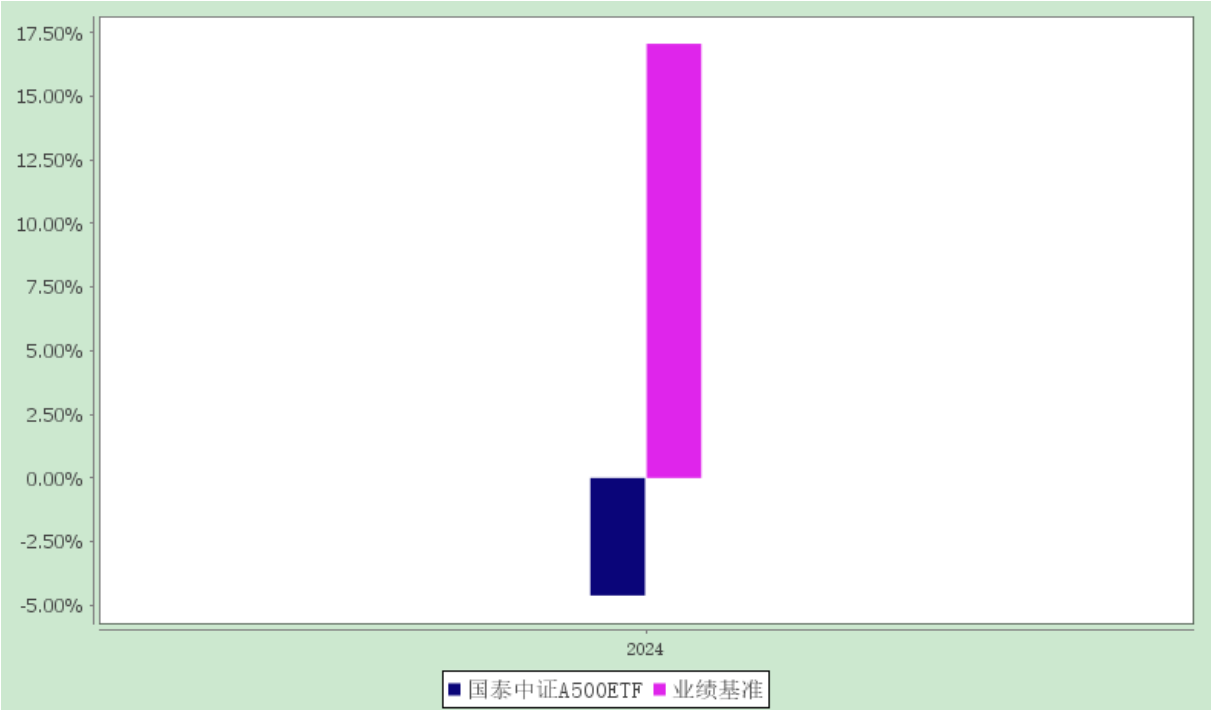
注：(1)本基金合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，截至 2024 年 12 月 31 日本基金成立尚未满一年。

(2)本基金的建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：2024 年计算期间为基金合同生效日 2024 年 9 月 26 日至 2024 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2024 年 9 月 26 日）至本报告期末未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

北京和深圳设有分公司。

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 270 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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 500ETF、国泰中证科创创业 50ETF 发起联接、国泰中证 500ETF 发起联接、国泰中证消费电子主题 ETF、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、国泰策略价值灵活配置混合、	2024-09-26	-	10 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和国泰中证科创创业 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 月至

	国泰中证 A500ETF 的基金经理				2024 年 10 月任国泰中证 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 月至 2025 年 2 月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，2024 年 9 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金和国泰中证 A500 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遵规守信情况的说明

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所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

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

的不同投资组合同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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年 A 股跌宕起伏，年初由于融资盘、雪球衍生品、量化 DMA 等杠杆资金被动去杠杆，引发了市场的大幅下跌，上证指数下探至 2635 点。春节前国家队通过买入 ETF 支撑市场，市场出现大幅反弹，上证指数震荡上行至 5 月，回升至 3174 点。

下半年基本面压力逐渐呈现，M1、PPI 等经济指标转负并加速下行，投资者信心严重缺失，全市场成交额大幅缩量至 5000 亿附近，上证指数在 9 月下跌至 2689 点。随后一系列提振资本市场的政策陆续推出，货币政策和财政政策相继发力。9 月下旬 A 股呈现大幅上涨，国庆期间市场情绪热烈发酵，国庆后上证指数创下全年高点 3674。

国庆后，市场情绪开始降温，但小微盘股投机逐渐盛行，中证 2000 指数在 10 月后震荡上行至 12 月中旬，代表大盘股的中证 A500 指数则从 10 月后呈现震荡下行。12 月底随着美国新任总统即将上任，市场担忧贸易摩擦即将重启，全市场风险偏好下降，市场出现整体向下调整。作为指数基金，本基金旨在为看好 A 股大盘股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

本基金自 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日期间的净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准收益率为 17.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 A500ETF 跟踪中证 A500 指数，覆盖了 A 股 500 家龙头上市公司。相比现有跟踪大盘股的宽基指数，中证 A500 指数的编制规则更加合理，行业分布更加均衡，能够更好的表征 A 股核心资产的整体表现。中证 A500 指数目前估值水平处于历史较低位置，配置价值凸显。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2024 年年度报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2502899 号

国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”) 财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2024 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则 (以下简称“审计准则”) 的规定执行了审计工作。审计报告的

“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

叶凯韵　欧梦溦

北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	83,733,883.37
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	28,132,259,481.80
其中：股票投资		28,132,259,481.80
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		425,796.06
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		28,216,419,161.23
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 日**
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,582,825.17
应付托管费		1,194,275.07
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-

应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	59,633,569.28
负债合计		64,410,669.52
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	29,516,086,664.00
未分配利润	7.4.7.8	-1,364,078,172.29
净资产合计		28,152,008,491.71
负债和净资产总计		28,216,419,161.23

注:(1)报告截止日 2024 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9538 元,基金份额总额 29,516,086,664.00 份。

(2)本财务报表的实际编制期间为 2024 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-267,165,075.28
1.利息收入		637,790.37
其中：存款利息收入	7.4.7.9	183,840.83
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		444,463.64
其他利息收入		9,485.90
2.投资收益（损失以“-”填列）		100,747,646.15
其中：股票投资收益	7.4.7.10	52,726,519.19
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	48,021,126.96
其他投资收益		-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-405,472,594.60
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	36,922,082.80
减：二、营业总支出		9,843,077.69
1．管理人报酬		7,292,608.21
2．托管费		2,430,869.41
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		1,600.07
8．其他费用	7.4.7.16	118,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-277,008,152.97**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-277,008,152.97**
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-277,008,152.97

注：本基金的合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，因此无上年度可比期间数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	2,000,086,664.00	-	2,000,086,664.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,516,000,000.00	-1,364,078,172.29	26,151,921,827.71
（一）、综合收益总额	-	-277,008,152.97	-277,008,152.97

（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）	27,516,000,000.00	-1,087,070,019.32	26,428,929,980.68
其中：1.基金申购款	31,932,000,000.00	-1,232,035,876.32	30,699,964,123.68
2.基金赎回款	-4,416,000,000.00	144,965,857.00	-4,271,034,143.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	29,516,086,664.00	-1,364,078,172.29	28,152,008,491.71

注：本基金的合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，因此无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇主管会计工作负责人：倪莹 会计机构负责人：吴洪涛

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰中证 A500 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[2024]1270 号《关于准予国泰中证 A500 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 A500 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 2,000,000,515.00 元，基金合同于 2024 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,086,664.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,149.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2024]第 831 号文审核同意，本基金 2,000,086,664.00 份基金份额于 2024 年 10 月 15 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本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 A500 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 A500 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 A500ETF 发起联接”)。国泰中证 A500ETF 发起联接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 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业

协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、自 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅

为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7实收基金

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8损益平准金

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

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。收益评价日核定的基金净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配。当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《关于企

业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	596,875.68
等于：本金	596,595.57
加：应计利息	280.11
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	83,137,007.69
等于：本金	83,135,210.94
加：应计利息	1,796.75
合计	83,733,883.37

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		28,537,732,076.40	-	28,132,259,481.80	-405,472,594.60
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		28,537,732,076.40	-	28,132,259,481.80	-405,472,594.60

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,000.00
可退替代款	463,468.45
应付替代款	59,052,100.83
合计	59,633,569.28

注：（1）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。

（2）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。

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,000,086,664.00	2,000,086,664.00
本期申购	31,932,000,000.00	31,932,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,416,000,000.00	-4,416,000,000.00
本期末	29,516,086,664.00	29,516,086,664.00

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。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期期初	-	-	-
本期利润	128,464,441.63	-405,472,594.60	-277,008,152.97
本期基金份额交易产生的变动数	279,358,223.37	-1,366,428,242.69	-1,087,070,019.32
其中：基金申购款	332,759,237.59	-1,564,795,113.91	-1,232,035,876.32
基金赎回款	-53,401,014.22	198,366,871.22	144,965,857.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	407,822,665.00	-1,771,900,837.29	-1,364,078,172.29

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	97,530.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	86,309.87
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	183,840.83

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	42,747,763.52
股票投资收益——赎回差价收入	9,978,755.67
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	52,726,519.19

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,809,578,007.77
减：卖出股票成本总额	5,756,633,913.70
减：交易费用	10,196,330.55
买卖股票差价收入	42,747,763.52

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	4,271,034,143.00
减：现金支付赎回款总额	2,444,604,786.00
减：赎回股票成本总额	1,816,450,601.33
减：交易费用	-
赎回差价收入	9,978,755.67

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	48,021,126.96
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	48,021,126.96

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日

1.交易性金融资产	-405,472,594.60
——股票投资	-405,472,594.60
——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	-405,472,594.60

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	36,922,082.80
合计	36,922,082.80

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。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	78,000.00
信息披露费	40,000.00

证券出借违约金	-
合计	118,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

根据本基金管理人于 2024 年 12 月 7 日发布的公告，经基金管理人股东会决议，并经中国证券监督管理委员会《关于核准国泰基金管理有限公司变更持股 5%以上股东的批复》（证监许可〔2024〕1560 号）核准，基金管理人原股东中国电力财务有限公司将其所持有的本公司 10%的全部股权转让给国网英大国际控股集团有限公司。

7.4.9.2 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
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰中证 A500 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 A500ETF 发起联接 ”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	29,164,758,002.26	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	1,541,519,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	5,421,620.92	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费等手续费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	7,292,608.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,091,122.28
应支付基金管理人的净管理费	6,201,485.93

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,430,869.41

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 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
国泰中证 A500ETF 发起联接	1,743,000,000.00	5.91%
华泰证券股份有限公司	710,490,394.00	2.41%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年9月26日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券	596,875.68	97,530.96

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰证券保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001391	国货航	2024-12-23	6 个月以上	新股锁定流通受限	2.30	6.80	4,686.00	10,777.80	31,864.80	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1 个月内（含）	网下中签流通受限	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月以上	新股锁定	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-

				流通受限						

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。此外，证券投资基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	5,744,600.00	42,776,458.33	41,476,012.00	-

注：本基金截至 2024 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，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，跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人华泰证券开立于具有基金托管资格的银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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时间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 7.4.12。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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管

理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	83,733,883.37	-	-	-	83,733,883.37
交易性金融资产	-	-	-	28,132,259,481.80	28,132,259,481.80
应收清算款	-	-	-	425,796.06	425,796.06
资产总计	83,733,883.37	-	-	28,132,685,277.86	28,216,419,161.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,582,825.17	3,582,825.17
应付托管费	-	-	-	1,194,275.07	1,194,275.07
其他负债	-	-	-	59,633,569.28	59,633,569.28
负债总计	-	-	-	64,410,669.52	64,410,669.52
利率敏感度缺口	83,733,883.37	-	-	28,068,274,608.34	28,152,008,491.71

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	28,132,259,481.80	99.93
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	-	-
合计	28,132,259,481.80	99.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	28,090,723,868.50
第二层次	41,503,748.50
第三层次	31,864.80
合计	28,132,259,481.80

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	10,777.80	10,777.80
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	21,087.00	21,087.00
其中：计入损益的利得或损失	-	21,087.00	21,087.00
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	31,864.80	31,864.80
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值	-	21,087.00	21,087.00

变动损益			

注：于2024年12月31日，本基金持有的第三层次 的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	31,864.80	平均价格亚式期权模型	预期波动率	200.14%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 30,699,964,123.68 元，其中包括以股票支付的申购款 12,755,501,103.14 元和以现金支付的申购款 17,944,463,020.54 元。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,132,259,481.80	99.70
	其中：股票	28,132,259,481.80	99.70
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	83,733,883.37	0.30
8	其他各项资产	425,796.06	0.00
9	合计	28,216,419,161.23	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	145,069,207.60	0.52
B	采矿业	1,305,234,772.67	4.64
C	制造业	16,728,878,663.83	59.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	954,868,592.00	3.39
E	建筑业	579,001,919.00	2.06
F	批发和零售业	185,683,402.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	999,244,933.57	3.55
H	住宿和餐饮业	27,647,069.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,779,350,688.55	6.32
J	金融业	4,251,896,652.72	15.10
K	房地产业	301,952,311.00	1.07

L	租赁和商务服务业	306,260,317.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	278,886,856.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	75,244,932.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,857,300.00	0.07
Q	卫生和社会工作	121,333,493.27	0.43
R	文化、体育和娱乐业	70,787,914.60	0.25
S	综合	-	-
	合计	28,132,199,024.81	99.93

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	27,736.50	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	257.04	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	32,463.45	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	60,456.99	0.00

8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	783,570	1,194,160,680.00	4.24
2	300750	宁德时代	3,282,105	873,039,930.00	3.10
3	601318	中国平安	13,391,447	705,059,684.55	2.50
4	600036	招商银行	15,399,400	605,196,420.00	2.15
5	000333	美的集团	6,079,498	457,299,839.56	1.62
6	600900	长江电力	15,212,000	449,514,600.00	1.60
7	300059	东方财富	15,706,541	405,542,888.62	1.44
8	600030	中信证券	12,137,705	354,056,854.85	1.26
9	601166	兴业银行	18,083,636	346,482,465.76	1.23
10	000858	五 粮 液	2,397,500	335,745,900.00	1.19
11	002594	比亚迪	1,125,800	318,218,628.00	1.13
12	601899	紫金矿业	20,489,600	309,802,752.00	1.10
13	601398	工商银行	43,592,600	301,660,792.00	1.07
14	002475	立讯精密	6,288,909	256,335,930.84	0.91
15	600276	恒瑞医药	5,558,100	255,116,790.00	0.91
16	000651	格力电器	5,565,712	252,961,610.40	0.90
17	600887	伊利股份	7,917,700	238,956,186.00	0.85
18	688981	中芯国际	2,478,700	234,534,594.00	0.83
19	601328	交通银行	29,295,640	227,627,122.80	0.81
20	601816	京沪高铁	36,684,100	225,974,056.00	0.80
21	601288	农业银行	39,708,900	212,045,526.00	0.75
22	000725	京东方 A	45,961,100	201,769,229.00	0.72
23	300760	迈瑞医疗	756,500	192,907,500.00	0.69
24	600919	江苏银行	18,267,800	179,389,796.00	0.64
25	601088	中国神华	4,101,100	178,315,828.00	0.63
26	688041	海光信息	1,165,691	174,608,854.89	0.62

27	603259	药明康德	3,110,010	171,174,950.40	0.61
28	688256	寒武纪	256,600	168,842,800.00	0.60
29	600309	万华化学	2,342,200	167,115,970.00	0.59
30	000063	中兴通讯	4,006,600	161,866,640.00	0.57
31	002371	北方华创	402,900	157,533,900.00	0.56
32	300124	汇川技术	2,687,494	157,433,398.52	0.56
33	601668	中国建筑	25,874,900	155,249,400.00	0.55
34	600000	浦发银行	14,605,566	150,291,274.14	0.53
35	601601	中国太保	4,255,500	145,027,440.00	0.52
36	601988	中国银行	26,219,900	144,471,649.00	0.51
37	000001	平安银行	12,064,700	141,156,990.00	0.50
38	002415	海康威视	4,597,075	141,130,202.50	0.50
39	601728	中国电信	19,316,000	139,461,520.00	0.50
40	300308	中际旭创	1,115,000	137,713,650.00	0.49
41	300274	阳光电源	1,806,720	133,390,137.60	0.47
42	600690	海尔智家	4,670,600	132,971,982.00	0.47
43	600941	中国移动	1,122,400	132,622,784.00	0.47
44	603019	中科曙光	1,821,600	131,738,112.00	0.47
45	002714	牧原股份	3,393,540	130,447,677.60	0.46
46	601766	中国中车	15,127,200	126,765,936.00	0.45
47	601857	中国石油	14,094,600	126,005,724.00	0.45
48	600406	国电南瑞	4,995,381	125,983,508.82	0.45
49	601127	赛力斯	939,500	125,319,905.00	0.45
50	600660	福耀玻璃	1,992,800	124,350,720.00	0.44
51	601919	中远海控	7,935,500	123,000,250.00	0.44
52	601985	中国核电	11,744,600	122,496,178.00	0.44
53	600031	三一重工	7,384,700	121,699,856.00	0.43
54	600028	中国石化	18,136,240	121,150,083.20	0.43
55	002352	顺丰控股	2,994,400	120,674,320.00	0.43
56	600104	上汽集团	5,761,300	119,604,588.00	0.42
57	601012	隆基绿能	7,545,300	118,536,663.00	0.42
58	000100	TCL 科技	23,358,746	117,494,492.38	0.42
59	000568	泸州老窖	916,100	114,695,720.00	0.41
60	601225	陕西煤业	4,825,200	112,234,152.00	0.40
61	002230	科大讯飞	2,296,300	110,957,216.00	0.39
62	603501	韦尔股份	1,058,424	110,510,049.84	0.39
63	600050	中国联通	19,778,300	105,022,773.00	0.37
64	300502	新易盛	882,700	102,022,466.00	0.36
65	688012	中微公司	535,588	101,311,826.08	0.36
66	600150	中国船舶	2,783,700	100,101,852.00	0.36
67	688008	澜起科技	1,427,600	96,934,040.00	0.34
68	603288	海天味业	2,074,200	95,205,780.00	0.34
69	000338	潍柴动力	6,750,900	92,487,330.00	0.33
70	002625	光启技术	1,876,800	89,711,040.00	0.32

71	603986	兆易创新	827,800	88,409,040.00	0.31
72	002027	分众传媒	12,575,800	88,407,874.00	0.31
73	601628	中国人寿	2,071,400	86,833,088.00	0.31
74	000625	长安汽车	6,173,549	82,478,614.64	0.29
75	600418	江淮汽车	2,183,100	81,866,250.00	0.29
76	601390	中国中铁	12,776,400	81,641,196.00	0.29
77	000425	徐工机械	10,292,900	81,622,697.00	0.29
78	688111	金山办公	284,331	81,429,555.09	0.29
79	601888	中国中免	1,213,700	81,330,037.00	0.29
80	600089	特变电工	6,281,100	80,021,214.00	0.28
81	600436	片仔癀	370,900	79,558,050.00	0.28
82	000938	紫光股份	2,846,897	79,229,143.51	0.28
83	600048	保利发展	8,933,600	79,151,696.00	0.28
84	601658	邮储银行	13,809,500	78,437,960.00	0.28
85	002241	歌尔股份	3,025,300	78,082,993.00	0.28
86	000792	盐湖股份	4,731,934	77,887,633.64	0.28
87	600905	三峡能源	17,798,800	77,780,756.00	0.28
88	601006	大秦铁路	11,362,000	77,034,360.00	0.27
89	600938	中国海油	2,607,300	76,941,423.00	0.27
90	300015	爱尔眼科	5,801,211	76,866,045.75	0.27
91	600019	宝钢股份	10,937,100	76,559,700.00	0.27
92	300033	同花顺	264,400	76,015,000.00	0.27
93	600438	通威股份	3,358,300	74,252,013.00	0.26
94	600584	长电科技	1,782,700	72,841,122.00	0.26
95	601600	中国铝业	9,860,300	72,473,205.00	0.26
96	300014	亿纬锂能	1,536,000	71,792,640.00	0.26
97	600585	海螺水泥	2,984,900	70,980,922.00	0.25
98	600760	中航沈飞	1,370,060	69,489,443.20	0.25
99	600893	航发动力	1,661,500	68,869,175.00	0.24
100	601989	中国重工	14,176,400	68,188,484.00	0.24
101	600111	北方稀土	3,146,500	66,768,730.00	0.24
102	000538	云南白药	1,109,104	66,490,784.80	0.24
103	000977	浪潮信息	1,278,156	66,310,733.28	0.24
104	002463	沪电股份	1,669,300	66,187,745.00	0.24
105	002050	三花智控	2,787,100	65,524,721.00	0.23
106	300408	三环集团	1,671,900	64,384,869.00	0.23
107	605499	东鹏饮料	258,160	64,157,923.20	0.23
108	688271	联影医疗	506,590	64,032,976.00	0.23
109	002179	中航光电	1,586,093	62,333,454.90	0.22
110	600886	国投电力	3,711,700	61,688,454.00	0.22
111	000002	万　科A	8,470,300	61,494,378.00	0.22
112	601669	中国电建	10,714,500	58,501,170.00	0.21
113	603993	洛阳钼业	8,790,100	58,454,165.00	0.21
114	002028	思源电气	772,700	56,175,290.00	0.20

115	002049	紫光国微	846,900	54,514,953.00	0.19
116	300433	蓝思科技	2,484,200	54,403,980.00	0.19
117	000988	华工科技	1,249,800	54,116,340.00	0.19
118	688036	传音控股	566,330	53,801,350.00	0.19
119	600570	恒生电子	1,885,900	52,786,341.00	0.19
120	600009	上海机场	1,541,200	52,631,980.00	0.19
121	600010	包钢股份	28,241,600	52,529,376.00	0.19
122	601186	中国铁建	5,725,900	52,506,503.00	0.19
123	601727	上海电气	6,294,200	51,045,962.00	0.18
124	600547	山东黄金	2,247,100	50,851,873.00	0.18
125	600795	国电电力	11,089,200	50,788,536.00	0.18
126	002384	东山精密	1,700,400	49,651,680.00	0.18
127	300339	润和软件	990,400	49,549,712.00	0.18
128	603799	华友钴业	1,692,200	49,513,772.00	0.18
129	002456	欧菲光	4,112,300	49,265,354.00	0.17
130	002460	赣锋锂业	1,403,860	49,149,138.60	0.17
131	000768	中航西飞	1,732,524	48,926,477.76	0.17
132	002422	科伦药业	1,602,700	47,968,811.00	0.17
133	601058	赛轮轮胎	3,270,500	46,866,265.00	0.17
134	601800	中国交建	4,431,800	46,312,310.00	0.16
135	001979	招商蛇口	4,512,300	46,205,952.00	0.16
136	600989	宝丰能源	2,738,900	46,123,076.00	0.16
137	600415	小商品城	3,405,400	45,666,414.00	0.16
138	601360	三六零	4,348,300	45,004,905.00	0.16
139	000157	中联重科	6,175,800	44,651,034.00	0.16
140	600839	四川长虹	4,597,200	44,362,980.00	0.16
141	600066	宇通客车	1,656,100	43,687,918.00	0.16
142	600489	中金黄金	3,621,624	43,568,136.72	0.15
143	600029	南方航空	6,708,000	43,534,920.00	0.15
144	600115	中国东航	10,645,900	42,583,600.00	0.15
145	600487	亨通光电	2,466,100	42,466,242.00	0.15
146	002466	天齐锂业	1,285,200	42,411,600.00	0.15
147	300782	卓胜微	471,220	42,268,434.00	0.15
148	002001	新 和 成	1,922,600	42,239,522.00	0.15
149	301236	软通动力	714,200	41,930,682.00	0.15
150	600674	川投能源	2,423,900	41,812,275.00	0.15
151	002340	格林美	6,370,200	41,597,406.00	0.15
152	002252	上海莱士	5,744,600	41,476,012.00	0.15
153	600745	闻泰科技	1,069,400	41,471,332.00	0.15
154	300418	昆仑万维	1,071,767	41,241,594.16	0.15
155	601689	拓普集团	840,500	41,184,500.00	0.15
156	601633	长城汽车	1,559,138	41,052,103.54	0.15
157	300207	欣旺达	1,838,000	41,005,780.00	0.15
158	600160	巨化股份	1,682,500	40,581,900.00	0.14

159	000661	长春高新	406,900	40,462,136.00	0.14
160	003816	中国广核	9,784,900	40,411,637.00	0.14
161	600346	恒力石化	2,630,600	40,379,710.00	0.14
162	688169	石头科技	183,495	40,238,618.55	0.14
163	688777	中控技术	806,658	40,066,702.86	0.14
164	600426	华鲁恒升	1,850,230	39,983,470.30	0.14
165	002236	大华股份	2,464,730	39,435,680.00	0.14
166	600196	复星医药	1,586,100	39,414,585.00	0.14
167	002648	卫星化学	2,094,120	39,348,514.80	0.14
168	300122	智飞生物	1,494,000	39,292,200.00	0.14
169	002156	通富微电	1,320,400	39,017,820.00	0.14
170	688126	沪硅产业	2,049,618	38,573,810.76	0.14
171	002273	水晶光电	1,732,200	38,489,484.00	0.14
172	600256	广汇能源	5,718,800	38,487,524.00	0.14
173	000786	北新建材	1,260,000	38,190,600.00	0.14
174	601117	中国化学	4,563,300	37,829,757.00	0.13
175	000963	华东医药	1,090,500	37,731,300.00	0.13
176	300394	天孚通信	412,640	37,698,790.40	0.13
177	600460	士兰微	1,447,769	37,670,949.38	0.13
178	002920	德赛西威	341,100	37,558,521.00	0.13
179	600372	中航机载	3,008,667	37,096,864.11	0.13
180	600011	华能国际	5,476,700	37,077,259.00	0.13
181	002185	华天科技	3,187,200	37,003,392.00	0.13
182	601868	中国能建	16,129,900	36,937,471.00	0.13
183	601111	中国国航	4,664,700	36,897,777.00	0.13
184	002601	龙佰集团	2,076,800	36,697,056.00	0.13
185	600183	生益科技	1,520,300	36,563,215.00	0.13
186	001965	招商公路	2,572,000	35,879,400.00	0.13
187	600096	云天化	1,601,300	35,708,990.00	0.13
188	002129	TCL 中环	4,021,753	35,672,949.11	0.13
189	300347	泰格医药	649,630	35,482,790.60	0.13
190	000423	东阿阿胶	565,400	35,461,888.00	0.13
191	002202	金风科技	3,432,900	35,461,857.00	0.13
192	601100	恒立液压	670,750	35,395,477.50	0.13
193	688223	晶科能源	4,977,228	35,388,091.08	0.13
194	601021	春秋航空	612,800	35,340,176.00	0.13
195	000807	云铝股份	2,591,957	35,069,178.21	0.12
196	000066	中国长城	2,405,900	35,053,963.00	0.12
197	300832	新产业	494,197	35,013,857.45	0.12
198	002180	纳思达	1,236,100	34,820,937.00	0.12
199	600085	同仁堂	854,400	34,680,096.00	0.12
200	600741	华域汽车	1,960,800	34,529,688.00	0.12
201	300896	爱美客	187,874	34,287,005.00	0.12
202	600482	中国动力	1,399,500	34,245,765.00	0.12

203	002493	荣盛石化	3,779,700	34,206,285.00	0.12
204	300661	圣邦股份	417,270	34,124,340.60	0.12
205	002459	晶澳科技	2,475,200	34,034,000.00	0.12
206	600176	中国巨石	2,987,100	34,023,069.00	0.12
207	600219	南山铝业	8,670,400	33,901,264.00	0.12
208	603392	万泰生物	477,900	33,672,834.00	0.12
209	601168	西部矿业	2,074,100	33,330,787.00	0.12
210	600352	浙江龙盛	3,236,000	33,298,440.00	0.12
211	300759	康龙化成	1,292,800	33,224,960.00	0.12
212	002709	天赐材料	1,679,700	33,123,684.00	0.12
213	000933	神火股份	1,958,300	33,095,270.00	0.12
214	600885	宏发股份	1,037,300	33,006,886.00	0.12
215	600988	赤峰黄金	2,069,100	32,298,651.00	0.11
216	600515	海南机场	8,531,400	32,248,692.00	0.11
217	300017	网宿科技	3,035,000	32,079,950.00	0.11
218	300476	胜宏科技	760,300	32,001,027.00	0.11
219	002738	中矿资源	898,300	31,889,650.00	0.11
220	002916	深南电路	254,700	31,837,500.00	0.11
221	000975	山金国际	2,071,400	31,837,418.00	0.11
222	002938	鹏鼎控股	866,400	31,606,272.00	0.11
223	002138	顺络电子	1,002,600	31,561,848.00	0.11
224	600188	兖矿能源	2,224,775	31,525,061.75	0.11
225	600845	宝信软件	1,073,897	31,422,226.22	0.11
226	002271	东方雨虹	2,418,800	31,396,024.00	0.11
227	601877	正泰电器	1,335,600	31,266,396.00	0.11
228	002281	光迅科技	596,600	31,124,622.00	0.11
229	688396	华润微	657,266	31,016,382.54	0.11
230	002078	太阳纸业	2,084,600	30,998,002.00	0.11
231	000630	铜陵有色	9,549,700	30,845,531.00	0.11
232	300136	信维通信	1,202,700	30,596,688.00	0.11
233	600233	圆通速递	2,141,903	30,393,603.57	0.11
234	600161	天坛生物	1,481,280	30,366,240.00	0.11
235	300474	景嘉微	324,400	30,328,156.00	0.11
236	601319	中国人保	3,973,300	30,276,546.00	0.11
237	002555	三七互娱	1,931,200	30,203,968.00	0.11
238	002085	万丰奥威	1,588,800	30,107,760.00	0.11
239	600879	航天电子	3,282,000	29,406,720.00	0.10
240	601618	中国中冶	8,882,000	29,310,600.00	0.10
241	300058	蓝色光标	3,141,500	29,153,120.00	0.10
242	002517	恺英网络	2,139,700	29,121,317.00	0.10
243	601607	上海医药	1,385,000	29,085,000.00	0.10
244	002444	巨星科技	898,300	29,060,005.00	0.10
245	300223	北京君正	425,600	29,025,920.00	0.10
246	000999	华润三九	648,290	28,745,178.60	0.10

247	688120	华海清科	176,300	28,735,137.00	0.10
248	688099	晶晨股份	415,883	28,562,844.44	0.10
249	601615	明阳智能	2,259,300	28,489,773.00	0.10
250	002405	四维图新	2,952,700	28,464,028.00	0.10
251	002074	国轩高科	1,340,500	28,445,410.00	0.10
252	002353	杰瑞股份	766,500	28,352,835.00	0.10
253	300002	神州泰岳	2,439,534	28,274,199.06	0.10
254	605117	德业股份	331,200	28,085,760.00	0.10
255	002195	岩山科技	7,064,095	28,044,457.15	0.10
256	300024	机器人	1,562,360	28,044,362.00	0.10
257	300346	南大光电	719,300	27,757,787.00	0.10
258	300496	中科创达	463,600	27,612,016.00	0.10
259	002128	电投能源	1,402,100	27,453,118.00	0.10
260	600588	用友网络	2,555,000	27,415,150.00	0.10
261	002223	鱼跃医疗	750,700	27,393,043.00	0.10
262	002532	天山铝业	3,476,600	27,360,842.00	0.10
263	300450	先导智能	1,362,600	27,279,252.00	0.10
264	601567	三星医疗	886,700	27,274,892.00	0.10
265	000408	藏格矿业	982,800	27,253,044.00	0.10
266	603606	东方电缆	518,600	27,252,430.00	0.10
267	002465	海格通信	2,478,600	27,215,028.00	0.10
268	688617	惠泰医疗	72,531	27,005,467.23	0.10
269	000301	东方盛虹	3,287,626	26,991,409.46	0.10
270	600362	江西铜业	1,289,900	26,623,536.00	0.09
271	688072	拓荆科技	172,790	26,552,639.30	0.09
272	600765	中航重机	1,289,000	26,385,830.00	0.09
273	688047	龙芯中科	199,100	26,336,948.00	0.09
274	300114	中航电测	366,700	26,321,726.00	0.09
275	688599	天合光能	1,362,399	26,294,300.70	0.09
276	600862	中航高科	1,039,400	26,255,244.00	0.09
277	002008	大族激光	1,046,500	26,162,500.00	0.09
278	300383	光环新网	1,790,500	26,123,395.00	0.09
279	300316	晶盛机电	816,200	26,036,780.00	0.09
280	002131	利欧股份	8,426,000	26,036,340.00	0.09
281	300012	华测检测	2,092,200	26,006,046.00	0.09
282	601872	招商轮船	4,050,600	25,964,346.00	0.09
283	000831	中国稀土	924,500	25,932,225.00	0.09
284	600895	张江高科	963,400	25,819,120.00	0.09
285	002472	双环传动	842,800	25,806,536.00	0.09
286	601238	广汽集团	2,759,300	25,771,862.00	0.09
287	300866	安克创新	263,808	25,758,213.12	0.09
288	600177	雅戈尔	2,876,500	25,600,850.00	0.09
289	300699	光威复材	726,700	25,180,155.00	0.09
290	600803	新奥股份	1,155,200	25,044,736.00	0.09

291	300413	芒果超媒	931,200	25,039,968.00	0.09
292	603605	珀莱雅	295,200	25,003,440.00	0.09
293	600332	白云山	875,700	24,887,394.00	0.09
294	603260	合盛硅业	447,400	24,857,544.00	0.09
295	601233	桐昆股份	2,098,800	24,765,840.00	0.09
296	300037	新宙邦	660,000	24,710,400.00	0.09
297	300395	菲利华	653,300	24,570,613.00	0.09
298	000400	许继电气	888,135	24,450,356.55	0.09
299	300628	亿联网络	632,700	24,422,220.00	0.09
300	300054	鼎龙股份	934,100	24,305,282.00	0.09
301	300999	金龙鱼	744,410	24,275,210.10	0.09
302	688122	西部超导	564,571	24,174,930.22	0.09
303	300142	沃森生物	1,988,800	24,024,704.00	0.09
304	300604	长川科技	539,400	23,803,722.00	0.08
305	603596	伯特利	533,400	23,784,306.00	0.08
306	600027	华电国际	4,233,000	23,747,130.00	0.08
307	601799	星宇股份	177,300	23,666,004.00	0.08
308	600039	四川路桥	3,249,700	23,657,816.00	0.08
309	000009	中国宝安	2,570,600	23,520,990.00	0.08
310	002436	兴森科技	2,100,600	23,337,666.00	0.08
311	002812	恩捷股份	727,700	23,279,123.00	0.08
312	600153	建发股份	2,198,500	23,128,220.00	0.08
313	688235	百济神州	142,800	22,993,656.00	0.08
314	002007	华兰生物	1,363,800	22,980,030.00	0.08
315	600549	厦门钨业	1,182,600	22,788,702.00	0.08
316	600143	金发科技	2,632,600	22,745,664.00	0.08
317	300724	捷佳伟创	356,000	22,502,760.00	0.08
318	002821	凯莱英	295,600	22,492,204.00	0.08
319	600398	海澜之家	2,986,500	22,398,750.00	0.08
320	601216	君正集团	4,197,100	22,076,746.00	0.08
321	000738	航发控制	981,400	21,826,336.00	0.08
322	000617	中油资本	3,143,500	21,658,715.00	0.08
323	002294	信立泰	696,549	21,544,260.57	0.08
324	000932	华菱钢铁	5,153,700	21,542,466.00	0.08
325	002558	巨人网络	1,687,600	21,415,644.00	0.08
326	600529	山东药玻	827,300	21,319,521.00	0.08
327	600018	上港集团	3,480,600	21,301,272.00	0.08
328	000878	云南铜业	1,746,900	21,294,711.00	0.08
329	300919	中伟股份	587,263	21,211,939.56	0.08
330	600497	驰宏锌锗	3,801,200	21,172,684.00	0.08
331	603659	璞泰来	1,328,300	21,133,253.00	0.08
332	688002	睿创微纳	445,412	20,938,818.12	0.07
333	002607	中公教育	6,134,500	20,857,300.00	0.07
334	600141	兴发集团	960,800	20,849,360.00	0.07

335	000733	振华科技	492,200	20,756,074.00	0.07
336	000034	神州数码	587,500	20,591,875.00	0.07
337	000623	吉林敖东	1,189,000	20,534,030.00	0.07
338	300073	当升科技	509,400	20,518,632.00	0.07
339	002409	雅克科技	351,100	20,346,245.00	0.07
340	002312	川发龙蟒	1,405,054	20,331,131.38	0.07
341	002065	东华软件	2,792,500	20,273,550.00	0.07
342	002064	华峰化学	2,474,200	20,238,956.00	0.07
343	300001	特锐德	919,800	20,189,610.00	0.07
344	600118	中国卫星	738,300	20,155,590.00	0.07
345	688009	中国通号	3,216,009	20,132,216.34	0.07
346	002318	久立特材	859,800	20,127,918.00	0.07
347	002432	九安医疗	493,300	20,116,774.00	0.07
348	300459	汤姆猫	3,503,500	20,110,090.00	0.07
349	600026	中远海能	1,731,700	20,087,720.00	0.07
350	300088	长信科技	3,052,600	19,964,004.00	0.07
351	600563	法拉电子	167,600	19,930,992.00	0.07
352	688188	柏楚电子	102,003	19,814,082.75	0.07
353	688303	大全能源	820,615	19,809,646.10	0.07
354	002739	万达电影	1,630,150	19,790,021.00	0.07
355	603087	甘李药业	447,700	19,743,570.00	0.07
356	600820	隧道股份	2,739,900	19,699,881.00	0.07
357	600704	物产中大	3,875,900	19,612,054.00	0.07
358	601179	中国西电	2,577,900	19,566,261.00	0.07
359	600521	华海药业	1,094,300	19,555,141.00	0.07
360	600637	东方明珠	2,514,000	19,508,640.00	0.07
361	002410	广联达	1,647,300	19,372,248.00	0.07
362	002841	视源股份	524,600	19,362,986.00	0.07
363	600699	均胜电子	1,225,900	19,209,853.00	0.07
364	603806	福斯特	1,297,100	19,197,080.00	0.07
365	601018	宁波港	4,884,500	18,805,325.00	0.07
366	601677	明泰铝业	1,552,000	18,670,560.00	0.07
367	300315	掌趣科技	3,391,200	18,651,600.00	0.07
368	300003	乐普医疗	1,641,000	18,608,940.00	0.07
369	300454	深信服	323,400	18,563,160.00	0.07
370	603568	伟明环保	849,700	18,379,011.00	0.07
371	603939	益丰药房	756,700	18,259,171.00	0.06
372	300751	迈为股份	173,400	18,233,010.00	0.06
373	688180	君实生物	666,000	18,201,780.00	0.06
374	000683	远兴能源	3,254,000	18,189,860.00	0.06
375	300144	宋城演艺	1,957,140	18,181,830.60	0.06
376	300763	锦浪科技	297,500	18,168,325.00	0.06
377	002152	广电运通	1,549,100	18,062,506.00	0.06
378	600008	首创环保	5,483,800	17,986,864.00	0.06

379	600392	盛和资源	1,746,700	17,956,076.00	0.06
380	002407	多氟多	1,495,300	17,943,600.00	0.06
381	002044	美年健康	3,894,988	17,877,994.92	0.06
382	000039	中集集团	2,290,000	17,793,300.00	0.06
383	603129	春风动力	112,800	17,717,496.00	0.06
384	300529	健帆生物	600,300	17,612,802.00	0.06
385	600170	上海建工	6,634,560	17,581,584.00	0.06
386	600486	扬农化工	302,980	17,533,452.60	0.06
387	601000	唐山港	3,721,300	17,527,323.00	0.06
388	300068	南都电源	1,085,000	17,511,900.00	0.06
389	002624	完美世界	1,692,100	17,479,393.00	0.06
390	300627	华测导航	415,500	17,367,900.00	0.06
391	600316	洪都航空	540,400	17,357,648.00	0.06
392	603979	金诚信	475,400	17,257,020.00	0.06
393	300251	光线传媒	1,825,900	17,236,496.00	0.06
394	600498	烽火通信	885,100	17,224,046.00	0.06
395	000960	锡业股份	1,227,500	17,221,825.00	0.06
396	600816	建元信托	4,898,700	17,145,450.00	0.06
397	600763	通策医疗	384,884	17,088,849.60	0.06
398	603816	顾家家居	617,600	17,033,408.00	0.06
399	600516	方大炭素	3,510,700	16,956,681.00	0.06
400	300285	国瓷材料	991,900	16,901,976.00	0.06
401	300558	贝达药业	311,700	16,809,981.00	0.06
402	603613	国联股份	631,400	16,782,612.00	0.06
403	002497	雅化集团	1,432,500	16,760,250.00	0.06
404	300390	天华新能	726,200	16,738,910.00	0.06
405	000830	鲁西化工	1,424,400	16,651,236.00	0.06
406	000629	钒钛股份	5,781,500	16,650,720.00	0.06
407	605358	立昂微	671,700	16,638,009.00	0.06
408	002603	以岭药业	1,038,600	16,627,986.00	0.06
409	002025	航天电器	340,300	16,524,968.00	0.06
410	601966	玲珑轮胎	911,100	16,436,244.00	0.06
411	300568	星源材质	1,673,800	16,269,336.00	0.06
412	300296	利亚德	2,521,923	16,241,184.12	0.06
413	601880	辽港股份	9,321,700	16,126,541.00	0.06
414	600535	天士力	1,114,400	16,114,224.00	0.06
415	600998	九州通	3,135,200	16,052,224.00	0.06
416	000069	华侨城A	5,996,900	16,011,723.00	0.06
417	600038	中直股份	414,500	15,983,120.00	0.06
418	600325	华发股份	2,747,600	15,826,176.00	0.06
419	002414	高德红外	2,123,850	15,780,205.50	0.06
420	002176	江特电机	2,121,600	15,721,056.00	0.06
421	603077	和邦生物	7,691,300	15,690,252.00	0.06
422	002389	航天彩虹	867,600	15,660,180.00	0.06

423	603833	欧派家居	226,816	15,636,695.04	0.06
424	300182	捷成股份	2,654,100	15,579,567.00	0.06
425	300253	卫宁健康	2,174,500	15,569,420.00	0.06
426	600655	豫园股份	2,416,900	15,540,667.00	0.06
427	002756	永兴材料	408,900	15,423,708.00	0.05
428	600754	锦江酒店	573,200	15,396,152.00	0.05
429	002245	蔚蓝锂芯	1,431,800	15,305,942.00	0.05
430	300567	精测电子	237,700	15,284,110.00	0.05
431	600859	王府井	988,300	15,229,703.00	0.05
432	603000	人民网	691,000	15,229,640.00	0.05
433	000519	中兵红箭	1,038,800	15,010,660.00	0.05
434	603885	吉祥航空	1,093,600	14,982,320.00	0.05
435	600166	福田汽车	5,908,700	14,830,837.00	0.05
436	300212	易华录	630,800	14,760,720.00	0.05
437	000998	隆平高科	1,309,000	14,621,530.00	0.05
438	002151	北斗星通	545,900	14,488,186.00	0.05
439	600323	瀚蓝环境	612,800	14,474,336.00	0.05
440	002439	启明星辰	910,000	14,396,200.00	0.05
441	300601	康泰生物	835,160	14,322,994.00	0.05
442	000708	中信特钢	1,254,300	14,311,563.00	0.05
443	002145	中核钛白	3,363,200	14,259,968.00	0.05
444	600131	国网信通	750,200	14,186,282.00	0.05
445	600004	白云机场	1,466,400	14,077,440.00	0.05
446	600867	通化东宝	1,728,200	13,929,292.00	0.05
447	603899	晨光股份	454,300	13,742,575.00	0.05
448	300070	碧水源	2,707,300	13,698,938.00	0.05
449	300118	东方日升	1,133,800	13,582,924.00	0.05
450	002120	韵达股份	1,804,700	13,571,344.00	0.05
451	601155	新城控股	1,124,200	13,445,432.00	0.05
452	603290	斯达半导	148,480	13,336,473.60	0.05
453	603486	科沃斯	282,900	13,296,300.00	0.05
454	688005	容百科技	419,822	13,245,384.10	0.05
455	300676	华大基因	309,700	12,998,109.00	0.05
456	000818	航锦科技	679,200	12,972,720.00	0.05
457	002368	太极股份	547,600	12,967,168.00	0.05
458	000887	中鼎股份	982,400	12,889,088.00	0.05
459	601866	中远海发	4,926,000	12,856,860.00	0.05
460	300595	欧普康视	672,700	12,747,665.00	0.05
461	002831	裕同科技	468,778	12,703,883.80	0.05
462	600667	太极实业	1,835,300	12,700,276.00	0.05
463	002508	老板电器	591,600	12,677,988.00	0.05
464	002240	盛新锂能	911,500	12,560,470.00	0.04
465	600755	厦门国贸	1,888,300	12,538,312.00	0.04
466	300438	鹏辉能源	444,500	12,494,895.00	0.04

467	002572	索菲亚	721,600	12,397,088.00	0.04
468	600258	首旅酒店	835,100	12,250,917.00	0.04
469	300573	兴齐眼药	174,020	12,143,115.60	0.04
470	600129	太极集团	490,700	12,130,104.00	0.04
471	002268	电科网安	739,000	12,008,750.00	0.04
472	000547	航天发展	1,594,700	11,657,257.00	0.04
473	600771	广誉远	613,200	11,564,952.00	0.04
474	600399	抚顺特钢	1,962,400	11,381,920.00	0.04
475	601636	旗滨集团	2,002,300	11,232,903.00	0.04
476	600499	科达制造	1,426,100	11,123,580.00	0.04
477	002544	普天科技	513,200	10,997,876.00	0.04
478	000035	中国天楹	2,176,500	10,599,555.00	0.04
479	600884	杉杉股份	1,400,400	10,432,980.00	0.04
480	603650	彤程新材	297,500	10,403,575.00	0.04
481	300769	德方纳米	278,260	10,262,228.80	0.04
482	002266	浙富控股	3,244,400	10,122,528.00	0.04
483	002372	伟星新材	794,200	10,030,746.00	0.04
484	603688	石英股份	336,200	9,659,026.00	0.03
485	002292	奥飞娱乐	1,103,100	9,541,815.00	0.03
486	603882	金域医学	345,100	9,500,603.00	0.03
487	300457	赢合科技	490,200	9,382,428.00	0.03
488	002541	鸿路钢构	520,300	9,328,979.00	0.03
489	603456	九洲药业	671,700	9,188,856.00	0.03
490	002091	江苏国泰	1,214,000	8,886,480.00	0.03
491	688390	固德威	210,814	8,622,292.60	0.03
492	688063	派能科技	213,205	8,538,860.25	0.03
493	603588	高能环境	1,521,100	7,970,564.00	0.03
494	000967	盈峰环境	1,579,900	7,852,103.00	0.03
495	002081	金 螳 螂	1,981,500	7,073,955.00	0.03
496	600315	上海家化	417,300	7,056,543.00	0.03
497	600167	联美控股	1,137,900	6,520,167.00	0.02
498	600007	中国国贸	250,100	6,117,446.00	0.02
499	001914	招商积余	532,800	5,631,696.00	0.02
500	600335	国机汽车	753,600	4,694,928.00	0.02

8.3.2 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	001391	国货航	4,751	32,463.45	0.00
2	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
3	000591	太阳能	54	257.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,749,326,004.66	6.21
2	601318	中国平安	902,146,897.05	3.20
3	600036	招商银行	697,213,365.63	2.48
4	600900	长江电力	510,672,129.45	1.81
5	600030	中信证券	430,790,038.94	1.53
6	601166	兴业银行	406,936,608.88	1.45
7	601899	紫金矿业	404,883,859.86	1.44
8	688041	海光信息	397,742,996.63	1.41
9	600276	恒瑞医药	333,341,743.91	1.18
10	601398	工商银行	315,262,312.84	1.12
11	688981	中芯国际	301,009,437.92	1.07
12	601328	交通银行	290,057,813.27	1.03
13	600887	伊利股份	257,884,668.00	0.92
14	601816	京沪高铁	242,911,799.70	0.86
15	601288	农业银行	224,756,173.00	0.80
16	000858	五 粮 液	215,260,050.11	0.76
17	600309	万华化学	207,432,094.64	0.74
18	601088	中国神华	195,207,127.30	0.69
19	600919	江苏银行	193,239,045.51	0.69
20	601668	中国建筑	189,189,675.80	0.67

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	523,060,925.18	1.86
2	688041	海光信息	252,270,915.10	0.90
3	300750	宁德时代	135,794,639.70	0.48
4	601318	中国平安	134,852,472.64	0.48
5	600036	招商银行	102,957,187.42	0.37
6	600900	长江电力	84,614,146.30	0.30
7	002304	洋河股份	82,506,397.66	0.29
8	688981	中芯国际	82,265,200.09	0.29

9	600030	中信证券	77,147,796.45	0.27
10	601328	交通银行	76,200,865.00	0.27
11	688008	澜起科技	68,562,342.79	0.24
12	601166	兴业银行	64,974,124.50	0.23
13	600276	恒瑞医药	59,153,037.17	0.21
14	600157	永泰能源	57,692,574.29	0.20
15	300760	迈瑞医疗	57,338,344.40	0.20
16	601899	紫金矿业	54,950,427.50	0.20
17	300782	卓胜微	48,244,599.00	0.17
18	300661	圣邦股份	47,974,531.40	0.17
19	601398	工商银行	46,705,442.00	0.17
20	603392	万泰生物	46,440,451.80	0.16

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	23,355,315,488.29
卖出股票的收入（成交）总额	5,809,578,007.77

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

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

招商银行及下属分支机构因理财业务未能有效穿透识别底层资产，信息披露不规范；贷前调查与贷后管理不尽职，贷款资金被挪用，贷款“三查”不到位、以存款作为发放贷款的前提条件，基金销售业务违规等情形等，受到金管局及分支机构、外管局分支机构罚款、整改通知，地方证监局警示。

中信证券及其分支机构因经纪业务管理存在不足，客户开户信息采集登记不规范，对分支机构员工的执业信息登记备案、手机号报备管理、违规信息报送不及时不到位，下属子公司微信公众号推送营销信息不当；场外衍生品业务管理存在不足，在衍生品交易准入环节，对于部分交易对手的真实身份识别、关联关系的核查不深入，落实适当性管理要求不到位；在交易对手的持续管理环节，部分交易对手的年度复核资料及定期回访记录缺失；在交易风险监测监控环节，对于风险提示跟踪处理不及时不完善；报送场外衍生品季度报告内容不完整的情况等原因，受到地方金监局等监管机构公开处罚。

兴业银行及其下属分支机构因贷款三查严重不尽职，延缓风险暴露、贷款风险分类不准确，违规发放个人消费贷款，信用证贸易背景不真实，违规以贷转存滚动办理存单质押贷款，未严格按照公布的收费价目名录收费，信贷业务管理不尽职，违规向借款人转嫁成本，委托未进行执业登记的人员从事保险代理业务及未按规定进行执业管理等原因，受到地方金监局等监管机构公开处罚。

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	425,796.06
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	425,796.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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	001391	国货航	31,864.80	0.00	新股锁定
2	603072	天和磁材	24,956.70	0.00	网下中签
3	603072	天和磁材	2,779.80	0.00	新股锁定

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中证 A500ETF 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
156,343	188,790.59	17,333,326,829.00	58.73%	10,439,759,835.00	35.37%	1,743,000,000.00	5.91%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	1,857,332,434.00	6.29%
2	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	979,258,770.00	3.32%
3	新华人寿保险股份有限公司	900,174,310.00	3.05%
4	华泰证券股份有限公司	710,490,394.00	2.41%
5	申万宏源证券有限公司	473,210,848.00	1.60%
6	工银安盛人寿保险有限公司	424,000,000.00	1.44%
7	中国国际金融股份有限公司	388,542,816.00	1.32%
8	中国人寿再保险有限责任公司	385,449,071.00	1.31%
9	中信证券股份有限公司	380,134,725.00	1.29%
10	方正证券股份有限公司	370,564,310.00	1.26%
-	国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,743,000,000.00	5.91%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	71,200.00	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2024 年 9 月 26 日)基金份额总额	2,000,086,664.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	31,932,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,416,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,516,086,664.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

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重大人事变动如下：

2024 年 3 月 26 日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 78,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	5	29,164,758,002.26	100.00%	5,421,620.92	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：

（1）实力雄厚、信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；

（3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；

（4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内所有席位均为新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	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
华泰证券	-	-	1,541,519,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	《证券日报》	2024-09-27
2	国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	公司官网	2024-10-10
3	国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购与赎回业务的公告	《证券日报》	2024-10-10
4	关于国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	《证券日报》	2024-10-15
5	国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	《证券日报》	2024-10-15
6	国泰基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	《中国证券报》	2024-12-07
7	关于国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	《证券日报》	2024-12-19
8	关于国泰中证A500交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	《证券日报》	2024-12-24
9	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	《中国证券报》	2024-12-24
10	国泰基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	《证券日报》	2024-12-27

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、关于准予国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复

2、国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、国泰中证 A500 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

二〇二五年三月二十九日