

# 国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2020 年中期报告

### 2020 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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

## 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
<b>4 管理人报告</b>	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>5 托管人报告</b>	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
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	18
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b>	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
<b>7 投资组合报告</b>	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
<b>8 基金份额持有人信息</b>	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
8.3 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 .....	57
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>57</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>59</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰中证 500 指数增强	
基金主代码	003760	
交易代码	003760	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 17 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,825,264.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	003760	003761
报告期末下属分级基金的份额总额	7,003,457.35 份	30,821,807.13 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>（1）指数化投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。</p> <p>（2）指数增强策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，在复制标的指数的基础上，主要利用指数增强量化投资策略，优选标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与指数成份股相关度高的股票，力求获取超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略以国泰量化多因子模型为基础，结合组合优化模型，精选具有较高投资价值的股票构建投资组合。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会。</p> <p>1) 精选内地个股</p> <p>国泰量化多因子模型基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、收益因子、成长性因子、风险因子和流动性因子等六大类对股票超额收益具有较强解释度的因子，</p>

	<p>通过构建多因子模型进行量化分析，建立股票价值评估体系。</p> <p>①价值因子 价值因子可以参考以下指标：市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）等。</p> <p>②盈利质量因子 本基金考察投资标的的盈利质量，可以参考以下指标：总资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）、销售毛利率、资产负债率、自由现金流等。</p> <p>③收益因子 收益因子可以参考以下指标：派息率等。</p> <p>④成长性因子 成长性因子可以参考以下指标：PEG、营业收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、可持续增长率（留存收益率*净资产收益率）等。</p> <p>⑤风险因子 风险因子可以参考以下指标：股价波动率、价格动量等。</p> <p>⑥流动性因子 流动性因子可以参考以下指标：成交量、换手率、流通市值等。 根据评价结果优选股票，构建股票投资组合。此外，基金管理人将依据市场环境的变化，定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，动态调整并更新各类因子的具体组合及权重。</p> <p>2) 精选港股通标的股票 本基金将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将运用量化模型和基本面研究相结合的方式，根据高质量、高成长、高盈利等因子精选港股通标的股票。</p> <p>(3) 风险控制与调整 本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。 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 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、债券投资策略 本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。</p> <p>3、中小企业私募债投资策略 本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还</p>
--	---

	<p>率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>5、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。</p> <p>7、股票期权投资策略 本基金投资于股票期权按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。</p> <p>8、融资与转融通证券出借投资策略 本基金在参与融资与转融通证券出借业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模与转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑融资与转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	朱广科
	联系电话	021-31081600转	0574-87050338
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	0574-83895886
传真		021-31081800	0574-89103213
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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345号
邮政编码		200082	315100

法定代表人	陈勇胜	陆华裕
-------	-----	-----

## 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 16 层-19 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中心	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

## 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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	703,360.42	5,972,635.72
本期利润	1,007,520.35	5,288,755.42
加权平均基金份额本期利润	0.2299	0.1138
本期加权平均净值利润率	20.82%	10.58%
本期基金份额净值增长率	13.65%	13.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	416,817.79	1,356,059.56
期末可供分配基金份额利润	0.0595	0.0440
期末基金资产净值	8,498,116.77	36,912,604.79
期末基金份额净值	1.2134	1.1976
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	21.46%	20.27%

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

国泰中证 500 指数增强 A

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	10.22%	0.82%	8.04%	0.84%	2.18%	-0.02%
过去三个月	19.24%	1.00%	15.47%	1.08%	3.77%	-0.08%
过去六个月	13.65%	1.61%	10.84%	1.70%	2.81%	-0.09%
过去一年	16.95%	1.29%	17.63%	1.39%	-0.68%	-0.10%
自基金合同生效起至今	21.46%	1.25%	14.19%	1.38%	7.27%	-0.13%

国泰中证 500 指数增强 C

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	10.23%	0.82%	8.04%	0.84%	2.19%	-0.02%
过去三个月	19.24%	1.00%	15.47%	1.08%	3.77%	-0.08%
过去六个月	13.64%	1.61%	10.84%	1.70%	2.80%	-0.09%
过去一年	15.86%	1.29%	17.63%	1.39%	-1.77%	-0.10%
自基金合同生效起至今	20.27%	1.25%	14.19%	1.38%	6.08%	-0.13%

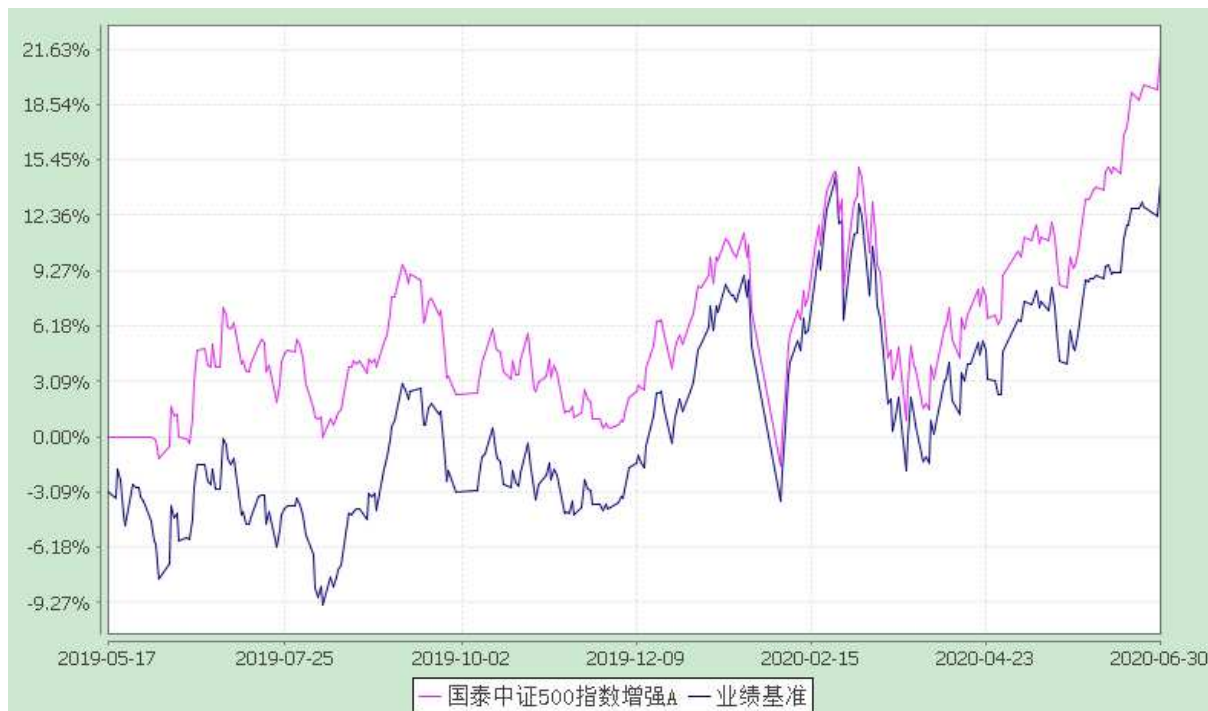
#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

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

(2019 年 5 月 17 日至 2020 年 6 月 30 日)

国泰中证 500 指数增强 A



注：本基金的合同生效日为 2019 年 5 月 17 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定；

国泰中证 500 指数增强 C



注：本基金的合同生效日为 2019 年 5 月 17 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定；

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 141 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指

数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金

(由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来)、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金(由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来)、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、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来)、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来)、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金。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		
谢东旭	本基金的基金经理、国泰沪深 300 指数增强、国泰中证新能源汽车指数（LOF）、国泰中证有色金属行业指数分级的基金经理	2019-11-01	-	9 年	硕士研究生。曾任职于中信证券、华安基金管理有限公司、创金合信基金管理有限公司。2018 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，任基金经理助理。2019 年 11 月起兼任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰中证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰中证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 1 次。本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度受新冠肺炎疫情自国内至欧美持续蔓延的冲击，全球金融市场各类资产大幅波动，A 股市场大幅震荡。年初，受全面决胜小康收官之年的各项利好政策预期，市场延续去年四季度的良好走势，尤其是以 5G 大规模建设、国产替代等为核心的包括半导体、通信、计算机，以及受特斯拉强劲表现带动的新能源汽车等板块表现持续走强；1 月下旬受武汉出现新冠肺炎传闻影响，市场开始震荡走弱，尤其是春节后第一天受国内疫情的持续大幅冲击，沪深两市个股大面积跌停，在国内果断采取严格的防控措施，疫情逐步得到控制的情况下，受新基金发行持续火爆影响，科技股引领

A 股走出了一波快速上涨的行情；随着疫情在境外的逐步蔓延扩大，以及境外防控措施的乏力，全球金融市场经受大幅冲击，各类资产均大幅下挫，欧美股市一周之内屡屡熔断，A 股市场也不能独善其身，北向资金短期内持续大幅净流出，上证指数最低下探到 2646 点，前期涨幅过快的半导体、通信、计算机、新能源汽车等强势板块大幅回调。

二季度受创业板改革并试点注册制、新冠肺炎疫情在境外持续蔓延影响，A 股市场结构性行情纷呈。受创业板改革并试点注册制影响，创业板指数持续走强，二季度涨幅超过 30%；受益新冠肺炎疫苗研发进展，包括原料药、疫苗类上市公司大幅走强，医药生物行业季度涨幅接近 30%，中证生物医药指数季度涨幅超过 40%。科技方面，受苹果新机型预计推出的预期，以及包括中芯国际即将科创板上市带动，中华半导体芯片指数季度涨幅亦超过 30%。海南自贸港一系列改革措施的推进落地带动免税相关概念大幅走强。临近季末，上证指数编制方案修改、科创板 50 指数即将推出，带动市场风险偏好逐步提升。

上半年上证指数下跌 2.15%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 3.95%，沪深 300 指数上涨 1.64%，成长性中小盘股表征指数如中证 500 上涨 11.33%，板块上科技股占比较多的中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.6%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的医药生物、休闲服务、电子，涨幅分别为 40.28%、30.07%、24.49%，表现落后的为采掘、银行、非银金融，分别下跌了 18.62%、13.97%、11.7%。

组合主要在中证 500 成分股内进行量化选股；在价值、成长之间保持平衡的同时，坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰中证 500 指数增强 A 在 2020 年上半年的净值增长率为 13.65%，同期业绩比较基准收益率为 10.84%。

国泰中证 500 指数增强 C 在 2020 年上半年的净值增长率为 13.64%，同期业绩比较基准收益率为 10.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度随着上证指数采用新修订的编制方案，上证指数有望更加全面客观的反映 A 股市场的投资机会，作为最有影响力的 A 股指数，新修订后的指数有望稳步上行，有助于提升投资者的风险偏好，在当前市场资金利率持续下行的环境下，包括银行理财资金在内的各类资产有望持续配置 A 股；受新冠疫情影响，得益于国内严格的防控措施，国内经济在全球经济体的吸引力更加凸显，有望带动外资加大 A 股资产的配置力度；受科创板 50 指数的推出以及相关 ETF 的发行上市所带动，包括



半导体芯片、计算机、通信等行业有望持续受到资金的青睐。在国内疫情受控的情况下，中央层面达到全面实现小康的总体目标仍然不变，预计国内稳增长政策力度将持续加码，以 5G、工业互联网、大数据等为主的新基建将是政策的主要着力点，也是政策弹性更大的方向。行业表现上在疫情后周期稳增长政策的刺激下，预计表现相对均衡。

在中美科技竞争长期化的背景下，包括自主可控、国产替代有望带来包括半导体芯片、通信、计算机等行业的营收持续改善，相关领域公司的竞争力有望大幅提升。中长期我们仍然看好受益于中国经济结构转型的消费龙头，受益医疗支出加大所带动的生物医药医疗，5G 等新基建领域的半导体、通信、计算机以及军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工。

风格上，估值和成长相对均衡的成分股以及细分行业的龙头股值得期待。我们的投资组合仍然会维持价值、成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2020 年 2 月 14 日至 2020 年 4 月 21 日期间和 2020 年 5 月 21 日至本报告期末期间存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## 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，本托管人在对国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，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，对国泰基金管理有限公司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，未发现国泰基金管理有限公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,944,296.48	148,634.54
结算备付金		863,594.00	2,339,215.48
存出保证金		205,909.85	103,868.40
交易性金融资产	6.4.7.2	41,690,098.67	91,752,047.79
其中：股票投资		41,670,598.67	86,957,691.79
基金投资		-	-
债券投资		19,500.00	4,794,356.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,558,932.15
应收利息	6.4.7.5	1,332.96	72,915.57
应收股利		-	-
应收申购款		129,672.88	34,703.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>45,834,904.84</b>	<b>97,010,317.65</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,249.40	2,189,136.22
应付赎回款		46,459.10	412,367.43
应付管理人报酬		35,628.21	84,354.96
应付托管费		3,562.81	8,435.49
应付销售服务费		290.28	792.08
应付交易费用	6.4.7.7	196,419.94	310,766.14
应交税费		0.07	3,035.09
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	139,573.47	147,156.93
负债合计		424,183.28	3,156,044.34
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	37,825,264.48	88,993,426.20
未分配利润	6.4.7.10	7,585,457.08	4,860,847.11
所有者权益合计		45,410,721.56	93,854,273.31
负债和所有者权益总计		45,834,904.84	97,010,317.65

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金的份额净值 1.2134 元，国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类基金的份额净值 1.1976 元。国泰中证 500 指数增强型证券投资基金份额总额 37,825,264.48 份，其中国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金的份额总额 7,003,457.35 份，国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类基金的份额总额 30,821,807.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 5 月 17 日 (基 金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>7,605,977.69</b>	<b>226,915.39</b>
1.利息收入		66,048.85	18,786.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,523.38	18,786.62
债券利息收入		46,525.47	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,914,093.23	142,973.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,389,183.65	120,931.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	25,183.04	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	82,446.60	-
股利收益	6.4.7.15	417,279.94	22,041.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-379,720.37	64,635.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,555.98	520.44
<b>减：二、费用</b>		<b>1,309,701.92</b>	<b>64,731.64</b>
1. 管理人报酬		277,374.25	17,833.28
2. 托管费		27,737.42	1,783.31
3. 销售服务费		2,531.05	6,895.69
4. 交易费用	6.4.7.18	812,254.80	12,228.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		296.80	-
7. 其他费用	6.4.7.19	189,507.60	25,991.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>6,296,275.77</b>	<b>162,183.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>6,296,275.77</b>	<b>162,183.75</b>

注：比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	88,993,426.20	4,860,847.11	93,854,273.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,296,275.77	6,296,275.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-51,168,161.72	-3,571,665.80	-54,739,827.52
其中：1.基金申购款	6,797,733.35	505,724.91	7,303,458.26
2.基金赎回款	-57,965,895.07	-4,077,390.71	-62,043,285.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	37,825,264.48	7,585,457.08	45,410,721.56
项目	上年度可比期间 2019 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	53,039,545.75	-220,061.10	52,819,484.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	162,183.75	162,183.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-49,653,394.22	173,867.94	-49,479,526.28
其中：1.基金申购款	2,169,073.36	-5,274.01	2,163,799.35
2.基金赎回款	-51,822,467.58	179,141.95	-51,643,325.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,386,151.53	115,990.59	3,502,142.12

注：比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据经持有人大会表决通过的《关于国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》以及相关法律法规的相关规定，由原国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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[2016]2485 号《关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定。根据《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，原基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起(含基金合同生效日)或者每一个开放期结束之日次日起(含该日)6 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。原基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 205,444,053.27 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 721 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 205,449,700.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 5,647.26 份基金份额。

本基金已经中国证监会许可[2018]1593 号(文《关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》)准予变更注册。根据本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2019 年 4 月 16 日发布的《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》自 2019 年 5 月 17 日起生效，原《国泰宁益定期开放灵活配置混合

型证券投资基金基金合同》、《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。原基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 52,819,484.65 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费、销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资人申购基金时收取申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资人申购基金时不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、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)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权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。本基金可以根据有关法律法规和政策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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%)，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

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 2020 年 8 月 27 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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：



(a)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。

(b)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。

(c)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。

(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。

(e)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,944,296.48
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,944,296.48

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	39,173,966.73	41,670,598.67	2,496,631.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	19,500.00	19,500.00	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	19,500.00	19,500.00	0.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	39,193,466.73	41,690,098.67	2,496,631.94	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	1,127,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,127,840.00	-	-	-

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有股指期货 IC2007，持仓为 1，合约市值为 1,159,880.00，公允价值变动为 32,040.00。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	785.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	516.54
应收债券利息	1.20
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.86
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	27.00
合计	1,332.96

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	196,419.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	196,419.94

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	65.87
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	50,000.00

预提费用	89,507.60
合计	139,573.47

#### 6.4.7.9 实收基金

国泰中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	4,668,901.09	4,668,901.09
本期申购	5,520,960.91	5,520,960.91
本期赎回（以“-”号填列）	-3,186,404.65	-3,186,404.65
本期末	7,003,457.35	7,003,457.35

国泰中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	84,324,525.11	84,324,525.11
本期申购	1,276,772.44	1,276,772.44
本期赎回（以“-”号填列）	-54,779,490.42	-54,779,490.42
本期末	30,821,807.13	30,821,807.13

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

国泰中证 500 指数增强 A

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	-271,040.13	587,276.22	316,236.09
本期利润	703,360.42	304,159.93	1,007,520.35
本期基金份额交易产生的变动数	-15,502.50	186,405.48	170,902.98
其中：基金申购款	-63,432.72	499,526.59	436,093.87
基金赎回款	47,930.22	-313,121.11	-265,190.89

本期已分配利润	-	-	-
本期末	416,817.79	1,077,841.63	1,494,659.42

## 国泰中证 500 指数增强 C

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	-6,069,591.20	10,614,202.22	4,544,611.02
本期利润	5,972,635.72	-683,880.30	5,288,755.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,453,015.04	-5,195,583.82	-3,742,568.78
其中：基金申购款	-20,343.61	89,974.65	69,631.04
基金赎回款	1,473,358.65	-5,285,558.47	-3,812,199.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,356,059.56	4,734,738.10	6,090,797.66

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	6,762.87
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	11,793.68
其他	966.83
合计	19,523.38

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	321,738,212.83
减：卖出股票成本总额	314,349,029.18
买卖股票差价收入	7,389,183.65

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,925,225.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	7,724,759.00

成本总额	
减：应收利息总额	175,283.02
买卖债券差价收入	25,183.04

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
买卖股指期货差价收入	82,446.60

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	417,279.94
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	417,279.94

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-411,760.37
——股票投资	-406,782.37
——债券投资	-4,978.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	32,040.00
——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	-379,720.37

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,351.01
转换费收入	204.97
合计	5,555.98

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 50%归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	812,254.80
银行间市场交易费用	-
合计	812,254.80

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	189,507.60

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

### 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、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年5月17日（基金合同 生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	277,374.25	17,833.28
其中：支付销售机构的客户维护费	7,725.24	2.43

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年5月17日（基金合同 生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,737.42	1,783.31

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元



获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C	合计
国泰基金管理有限公司	-	2,396.04	2,396.04
合计	-	2,396.04	2,396.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年5月17日（基金合同生效日）至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C	合计
国泰基金管理有限公司	-	2.03	2.03
合计	-	2.03	2.03

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年5月17日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C
基金合同生效日 (2019年5月17日) 持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份	-	-	-	-

额				
期间申购/买入总份 额	4,196,045.51	-	-	-
期间因拆分变动份 额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份 额	4,196,045.51	-	-	-
期末持有的基金份 额占基金总份额比 例	11.09%	-	-	-

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年5月17日（基金合同生效 日）至2019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
宁波银行	2,944,296.48	6,762.87	1,005,191.17	18,751.43

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配的情况。

#### 6.4.12 期末（2020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	可流通日	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
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	5.94	5.94	806.00	4,787.64	4,787.64	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	网下中签	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	网下中签	17.63	17.63	360.00	6,346.80	6,346.80	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	网下中签	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
688158	优刻得	2020-01-10	2020-07-20	新股锁定	33.23	68.38	3,105.00	103,179.15	212,319.90	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	老股配债	100.00	100.00	195.00	19,500.00	19,500.00	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 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

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
600317	营口港	2020-06-22	重大事项	2.21	2020-07-08	2.43	9,400.00	20,119.91	20,774.00	-
601880	大连港	2020-06-22	重大事项	1.72	2020-07-08	1.89	31,400.00	54,030.00	54,008.00	-

注：本基金截至 2020 年 6 月 30 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，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。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 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。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、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、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宁波银行股份有限公司，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 2020 年 06 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.04%(2019 年 12 月 31 日：本基金持有信用类债券 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,944,296.48	-	-	-	2,944,296.48
结算备付金	863,594.00	-	-	-	863,594.00
存出保证金	205,909.85	-	-	-	205,909.85
交易性金融资产	-	-	19,500.00	41,670,598.67	41,690,098.67
应收利息	-	-	-	1,332.96	1,332.96
应收申购款	107,513.35	-	-	22,159.53	129,672.88
资产总计	4,121,313.68	-	19,500.00	41,694,091.16	45,834,904.84
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,249.40	2,249.40
应付赎回款	-	-	-	46,459.10	46,459.10
应付管理人报酬	-	-	-	35,628.21	35,628.21
应付托管费	-	-	-	3,562.81	3,562.81
应付销售服务费	-	-	-	290.28	290.28
应付交易费用	-	-	-	196,419.94	196,419.94
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
其他负债	-	-	-	139,573.47	139,573.47
负债总计	-	-	-	424,183.28	424,183.28
利率敏感度缺口	4,121,313.68	-	19,500.00	41,269,907.88	45,410,721.56
上年度末 2019 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	148,634.54	-	-	-	148,634.54
结算备付金	2,339,215.48	-	-	-	2,339,215.48
存出保证金	103,868.40	-	-	-	103,868.40
交易性金融资产	4,791,256.00	-	3,100.00	86,957,691.79	91,752,047.79
应收利息	-	-	-	72,915.57	72,915.57
应收申购款	780.00	-	-	33,923.72	34,703.72
应收证券清算款	-	-	-	2,558,932.15	2,558,932.15
资产总计	7,383,754.42	-	3,100.00	89,623,463.23	97,010,317.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,189,136.22	2,189,136.22
应付赎回款	-	-	-	412,367.43	412,367.43
应付管理人报酬	-	-	-	84,354.96	84,354.96
应付托管费	-	-	-	8,435.49	8,435.49
应付销售服务费	-	-	-	792.08	792.08
应付交易费用	-	-	-	310,766.14	310,766.14
应交税费	-	-	-	3,035.09	3,035.09
其他负债	-	-	-	147,156.93	147,156.93
负债总计	-	-	-	3,156,044.34	3,156,044.34
利率敏感度缺口	7,383,754.42	-	3,100.00	86,467,418.89	93,854,273.31

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 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.04%(2019 年 12 月 31 日:5.11%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易



的股票和债券，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。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，本基金的基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 90%。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	41,670,598.67	91.76	86,957,691.79	92.65
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>41,670,598.67</b>	<b>91.76</b>	<b>86,957,691.79</b>	<b>92.65</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基准指数外其他市场变量不变	
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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
中证 500 指数上升 5%	增加约 195	增加约 68
中证 500 指数下降 5%	减少约 195	减少约 68

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 41,361,033.35 元，属于第二层次的余额为 329,065.32 元，无属于第三层次的余额。（2019 年 12 月 31 日：第一层次 86,951,113.75 元，第二层次 4,800,934.04 元，无第三层次）。

##### (ii) 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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。(2019 年 12 月 31 日,同)

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	41,670,598.67	90.91
	其中：股票	41,670,598.67	90.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,500.00	0.04
	其中：债券	19,500.00	0.04
	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	3,807,890.48	8.31
8	其他各项资产	336,915.69	0.74
9	合计	45,834,904.84	100.00

## 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	1,781,777.68	3.92
C	制造业	23,839,291.09	52.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,429,967.71	3.15
E	建筑业	238,216.00	0.52
F	批发和零售业	862,961.26	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,291,307.21	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,838,760.89	6.25
J	金融业	980,207.00	2.16
K	房地产业	1,417,024.36	3.12
L	租赁和商务服务业	244,162.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	88,920.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	270,651.20	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,184.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,233,821.76	2.72
S	综合	141,426.00	0.31
	合计	36,681,678.16	80.78

### 7.2.2 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	3,286,932.86	7.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	187,946.28	0.41
E	建筑业	49,915.00	0.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	249,387.00	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	771,379.37	1.70
J	金融业	396,134.00	0.87
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	47,226.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	4,988,920.51	10.99

### 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	603444	吉比特	1,000	549,010.00	1.21
2	600201	生物股份	19,300	537,312.00	1.18
3	300253	卫宁健康	22,760	522,114.40	1.15
4	002821	凯莱英	2,100	510,300.00	1.12
5	002507	涪陵榨菜	12,200	439,322.00	0.97
6	002019	亿帆医药	18,085	415,412.45	0.91
7	300285	国瓷材料	11,200	375,312.00	0.83
8	603707	健友股份	5,800	374,506.00	0.82
9	600161	天坛生物	8,058	365,269.14	0.80
10	600563	法拉电子	5,888	363,878.40	0.80
11	600008	首创股份	119,865	360,793.65	0.79

12	600167	联美控股	25,000	358,500.00	0.79
13	300274	阳光电源	24,700	355,433.00	0.78
14	000997	新大陆	22,200	354,756.00	0.78
15	600256	广汇能源	129,220	348,894.00	0.77
16	603866	桃李面包	6,760	344,016.40	0.76
17	300482	万孚生物	3,300	343,200.00	0.76
18	000598	兴蓉环境	74,600	343,160.00	0.76
19	002815	崇达技术	16,700	337,841.00	0.74
20	601689	拓普集团	12,000	334,800.00	0.74
21	600273	嘉化能源	38,200	333,868.00	0.74
22	600875	东方电气	37,600	332,760.00	0.73
23	600120	浙江东方	48,400	332,508.00	0.73
24	601799	星宇股份	2,600	330,200.00	0.73
25	002233	塔牌集团	27,083	325,808.49	0.72
26	000830	鲁西化工	43,600	325,256.00	0.72
27	600643	爱建集团	40,800	324,360.00	0.71
28	002191	劲嘉股份	36,309	323,513.19	0.71
29	000778	新兴铸管	94,300	323,449.00	0.71
30	601000	唐山港	143,600	320,228.00	0.71
31	002440	闰土股份	34,865	318,666.10	0.70
32	601717	郑煤机	53,900	317,471.00	0.70
33	000825	太钢不锈	94,845	314,885.40	0.69
34	600642	申能股份	53,266	314,802.06	0.69
35	600717	天津港	71,016	313,890.72	0.69
36	002203	海亮股份	35,810	313,337.50	0.69
37	002124	天邦股份	24,300	312,255.00	0.69
38	002244	滨江集团	72,700	310,429.00	0.68
39	603659	璞泰来	3,000	309,060.00	0.68
40	300558	贝达药业	2,200	307,956.00	0.68
41	000559	万向钱潮	63,058	305,200.72	0.67
42	601928	凤凰传媒	44,600	303,280.00	0.67
43	600195	中牧股份	18,500	300,255.00	0.66
44	002013	中航机电	38,000	300,200.00	0.66
45	600064	南京高科	30,863	299,988.36	0.66
46	000848	承德露露	42,464	297,248.00	0.65
47	300630	普利制药	4,000	295,800.00	0.65
48	601678	滨化股份	68,038	288,481.12	0.64
49	002635	安洁科技	11,500	286,350.00	0.63
50	000937	冀中能源	94,722	286,060.44	0.63
51	300296	利亚德	46,550	282,558.50	0.62
52	600623	华谊集团	54,185	279,594.60	0.62
53	600757	长江传媒	53,671	273,185.39	0.60
54	600885	宏发股份	6,800	272,816.00	0.60
55	603568	伟明环保	11,666	270,651.20	0.60

56	000975	银泰黄金	17,200	269,696.00	0.59
57	300088	长信科技	23,600	264,320.00	0.58
58	002701	奥瑞金	62,600	262,294.00	0.58
59	300357	我武生物	4,200	261,450.00	0.58
60	000528	柳 工	41,300	260,603.00	0.57
61	300418	昆仑万维	10,300	257,088.00	0.57
62	601098	中南传媒	24,100	254,978.00	0.56
63	603806	福斯特	5,066	252,844.06	0.56
64	002901	大博医疗	2,100	250,509.00	0.55
65	600811	东方集团	56,530	249,862.60	0.55
66	600017	日照港	97,800	243,522.00	0.54
67	002368	太极股份	5,500	240,295.00	0.53
68	002818	富森美	18,990	233,577.00	0.51
69	600216	浙江医药	12,100	233,046.00	0.51
70	600486	扬农化工	2,800	231,000.00	0.51
71	000039	中集集团	31,440	227,311.20	0.50
72	002557	洽洽食品	4,100	222,179.00	0.49
73	603338	浙江鼎力	2,900	219,733.00	0.48
74	300207	欣旺达	11,600	219,240.00	0.48
75	300009	安科生物	12,220	218,738.00	0.48
76	600675	中华企业	52,600	214,082.00	0.47
77	600062	华润双鹤	15,700	207,554.00	0.46
78	601811	新华文轩	20,161	205,037.37	0.45
79	002138	顺络电子	8,200	204,590.00	0.45
80	603556	海兴电力	13,900	200,716.00	0.44
81	002444	巨星科技	16,700	198,396.00	0.44
82	300166	东方国信	15,900	197,319.00	0.43
83	600582	天地科技	67,300	197,189.00	0.43
84	002625	光启技术	26,810	194,372.50	0.43
85	601699	潞安环能	34,260	190,828.20	0.42
86	600787	中储股份	43,191	189,608.49	0.42
87	000636	风华高科	6,400	186,816.00	0.41
88	600649	城投控股	30,900	183,546.00	0.40
89	600567	山鹰纸业	61,600	181,720.00	0.40
90	600528	中铁工业	20,442	180,298.44	0.40
91	600529	山东药玻	3,100	179,800.00	0.40
92	000090	天健集团	25,600	176,896.00	0.39
93	000869	张 裕 A	4,943	168,803.45	0.37
94	002266	浙富控股	43,500	168,345.00	0.37
95	002595	豪迈科技	8,400	163,464.00	0.36
96	002867	周大生	7,245	160,621.65	0.35
97	600060	海信视像	13,100	159,165.00	0.35
98	600094	大名城	26,600	158,270.00	0.35
99	601865	福莱特	8,403	157,976.40	0.35

100	000813	德展健康	25,337	157,089.40	0.35
101	002217	合力泰	29,700	155,925.00	0.34
102	600291	西水股份	17,200	155,660.00	0.34
103	002439	启明星辰	3,700	155,659.00	0.34
104	603328	依顿电子	14,800	154,364.00	0.34
105	300134	大富科技	10,767	150,522.66	0.33
106	002212	南洋股份	5,600	148,848.00	0.33
107	002563	森马服饰	20,900	147,345.00	0.32
108	002690	美亚光电	2,800	147,280.00	0.32
109	600862	中航高科	8,600	145,512.00	0.32
110	600277	亿利洁能	43,400	141,484.00	0.31
111	601019	山东出版	22,564	141,025.00	0.31
112	000046	泛海控股	36,600	137,982.00	0.30
113	600770	综艺股份	28,600	137,280.00	0.30
114	600639	浦东金桥	8,500	135,830.00	0.30
115	600985	淮北矿业	17,400	135,546.00	0.30
116	603228	景旺电子	3,820	134,425.80	0.30
117	000301	东方盛虹	23,600	131,216.00	0.29
118	000758	中色股份	31,000	129,580.00	0.29
119	600497	驰宏锌锗	37,266	128,195.04	0.28
120	002396	星网锐捷	3,600	127,188.00	0.28
121	600779	水井坊	2,000	124,840.00	0.27
122	002511	中顺洁柔	5,539	123,519.70	0.27
123	603712	七一二	3,200	122,816.00	0.27
124	603198	迎驾贡酒	5,400	117,558.00	0.26
125	000999	华润三九	4,000	116,760.00	0.26
126	000089	深圳机场	15,200	116,432.00	0.26
127	600410	华胜天成	8,500	115,600.00	0.25
128	600380	健康元	7,100	115,304.00	0.25
129	600823	世茂股份	25,700	114,879.00	0.25
130	002434	万里扬	13,200	114,576.00	0.25
131	603816	顾家家居	2,500	112,525.00	0.25
132	600160	巨化股份	15,900	109,551.00	0.24
133	600171	上海贝岭	6,300	109,494.00	0.24
134	002648	卫星石化	6,700	109,009.00	0.24
135	000983	西山煤电	28,340	106,275.00	0.23
136	002465	海格通信	8,000	103,520.00	0.23
137	000012	南玻 A	20,338	102,096.76	0.22
138	002831	裕同科技	3,700	101,787.00	0.22
139	600339	中油工程	42,500	96,475.00	0.21
140	600315	上海家化	2,000	95,800.00	0.21
141	603983	丸美股份	1,100	94,633.00	0.21
142	603355	莱克电气	3,800	94,582.00	0.21
143	000513	丽珠集团	1,939	93,091.39	0.20



144	601958	金钼股份	14,600	90,228.00	0.20
145	300012	华测检测	4,500	88,920.00	0.20
146	600782	新钢股份	21,600	88,128.00	0.19
147	600597	光明乳业	5,900	87,674.00	0.19
148	600694	大商股份	3,439	82,501.61	0.18
149	600521	华海药业	2,400	81,432.00	0.18
150	002416	爱施德	11,330	81,349.40	0.18
151	000988	华工科技	3,300	80,619.00	0.18
152	300113	顺网科技	3,100	78,740.00	0.17
153	002242	九阳股份	2,100	78,267.00	0.17
154	300271	华宇软件	2,700	76,167.00	0.17
155	600827	百联股份	5,000	72,250.00	0.16
156	002640	跨境通	10,200	66,198.00	0.15
157	000623	吉林敖东	4,115	64,728.95	0.14
158	002268	卫士通	3,000	64,020.00	0.14
159	002093	国脉科技	7,200	63,720.00	0.14
160	000060	中金岭南	16,500	61,380.00	0.14
161	002375	亚厦股份	6,000	61,320.00	0.14
162	600282	南钢股份	18,900	61,047.00	0.13
163	300474	景嘉微	900	60,570.00	0.13
164	000501	鄂武商 A	3,800	59,584.00	0.13
165	600557	康缘药业	4,200	58,464.00	0.13
166	002925	盈趣科技	1,000	57,940.00	0.13
167	600633	浙数文化	5,900	57,702.00	0.13
168	600500	中化国际	11,400	57,684.00	0.13
169	603486	科沃斯	1,900	57,399.00	0.13
170	000156	华数传媒	5,200	56,316.00	0.12
171	600729	重庆百货	1,800	56,196.00	0.12
172	002048	宁波华翔	3,600	55,584.00	0.12
173	600580	卧龙电驱	4,900	55,076.00	0.12
174	601966	玲珑轮胎	2,700	54,540.00	0.12
175	600801	华新水泥	2,300	54,533.00	0.12
176	601880	大连港	31,400	54,008.00	0.12
177	600026	中远海能	8,300	53,618.00	0.12
178	000685	中山公用	6,800	52,360.00	0.12
179	603025	大豪科技	7,000	50,890.00	0.11
180	601003	柳钢股份	11,400	50,502.00	0.11
181	603000	人民网	2,500	49,575.00	0.11
182	600835	上海机电	2,900	49,097.00	0.11
183	002223	鱼跃医疗	1,300	47,320.00	0.10
184	002429	兆驰股份	9,200	45,540.00	0.10
185	603868	飞科电器	900	44,397.00	0.10
186	000717	韶钢松山	11,200	42,560.00	0.09
187	000887	中鼎股份	5,400	42,390.00	0.09

188	601005	重庆钢铁	28,400	42,316.00	0.09
189	300180	华峰超纤	4,500	38,520.00	0.08
190	603515	欧普照明	1,321	36,155.77	0.08
191	002544	杰赛科技	2,556	33,611.40	0.07
192	600808	马钢股份	12,500	32,250.00	0.07
193	002491	通鼎互联	5,900	30,208.00	0.07
194	600901	江苏租赁	5,700	29,697.00	0.07
195	600549	厦门钨业	2,000	23,680.00	0.05
196	603377	东方时尚	1,400	23,184.00	0.05
197	002078	太阳纸业	2,200	20,944.00	0.05
198	600298	安琪酵母	400	19,792.00	0.04
199	600751	海航科技	5,800	18,154.00	0.04
200	603233	大参林	200	16,244.00	0.04
201	300496	中科创达	200	15,540.00	0.03
202	002399	海普瑞	600	15,024.00	0.03
203	600329	中新药业	700	12,124.00	0.03
204	000581	威孚高科	570	11,787.60	0.03
205	002127	南极电商	500	10,585.00	0.02
206	600845	宝信软件	100	5,908.00	0.01
207	600673	东阳光	600	4,146.00	0.01
208	002195	二三四五	689	1,936.09	0.00
209	000883	湖北能源	100	352.00	0.00

### 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	300014	亿纬锂能	9,787	468,307.95	1.03
2	603383	顶点软件	5,760	256,838.40	0.57
3	688158	优刻得	3,105	212,319.90	0.47
4	601238	广汽集团	22,600	203,400.00	0.45
5	300741	华宝股份	5,100	188,088.00	0.41
6	002608	江苏国信	28,600	180,180.00	0.40
7	300059	东方财富	7,900	159,580.00	0.35
8	600390	五矿资本	21,700	153,202.00	0.34
9	600519	贵州茅台	100	146,288.00	0.32
10	002049	紫光国微	1,901	138,297.75	0.30
11	300559	佳发教育	6,200	131,564.00	0.29
12	300327	中颖电子	3,700	119,880.00	0.26
13	300529	健帆生物	1,580	109,810.00	0.24
14	601231	环旭电子	5,010	109,418.40	0.24
15	001696	宗申动力	14,300	92,092.00	0.20

16	603369	今世缘	2,300	91,517.00	0.20
17	603160	汇顶科技	400	89,160.00	0.20
18	000900	现代投资	22,500	86,175.00	0.19
19	300577	开润股份	3,100	83,607.00	0.18
20	000666	经纬纺机	9,200	83,352.00	0.18
21	002320	海峡股份	7,000	77,000.00	0.17
22	601100	恒立液压	900	72,180.00	0.16
23	002214	大立科技	2,400	67,632.00	0.15
24	603258	电魂网络	1,100	61,116.00	0.13
25	002463	沪电股份	2,400	59,952.00	0.13
26	600517	国网英大	8,700	58,116.00	0.13
27	600611	大众交通	14,600	54,896.00	0.12
28	603826	坤彩科技	1,600	53,712.00	0.12
29	600872	中炬高新	900	52,677.00	0.12
30	600309	万华化学	1,000	49,990.00	0.11
31	002482	广田集团	14,900	49,915.00	0.11
32	000915	山大华特	1,500	49,125.00	0.11
33	300196	长海股份	4,600	48,668.00	0.11
34	300624	万兴科技	600	48,300.00	0.11
35	002376	新北洋	4,700	47,893.00	0.11
36	603848	好太太	3,500	47,775.00	0.11
37	603688	石英股份	2,000	47,640.00	0.10
38	600880	博瑞传播	10,200	47,226.00	0.10
39	000651	格力电器	800	45,256.00	0.10
40	000596	古井贡酒	300	45,072.00	0.10
41	300365	恒华科技	4,414	45,022.80	0.10
42	300458	全志科技	1,200	44,160.00	0.10
43	000661	长春高新	100	43,530.00	0.10
44	600809	山西汾酒	300	43,500.00	0.10
45	300082	奥克股份	6,100	39,162.00	0.09
46	300726	宏达电子	1,400	38,934.00	0.09
47	600867	通化东宝	2,200	38,346.00	0.08
48	002327	富安娜	5,200	36,608.00	0.08
49	002516	旷达科技	11,600	35,728.00	0.08
50	603679	华体科技	900	35,379.00	0.08
51	600961	株冶集团	6,001	34,565.76	0.08
52	600104	上汽集团	1,900	32,281.00	0.07
53	603823	百合花	1,900	31,920.00	0.07
54	002568	百润股份	700	31,724.00	0.07
55	002304	洋河股份	300	31,542.00	0.07
56	603288	海天味业	200	24,880.00	0.05
57	605166	聚合顺	1,409	22,332.65	0.05
58	600317	营口港	9,400	20,774.00	0.05
59	600436	片仔癀	100	17,025.00	0.04

60	300842	帝科股份	394	16,043.68	0.04
61	603416	信捷电气	400	15,944.00	0.04
62	002029	七匹狼	3,100	15,686.00	0.03
63	300628	亿联网络	200	13,652.00	0.03
64	603087	甘李药业	129	12,938.70	0.03
65	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.03
66	601515	东风股份	1,900	11,609.00	0.03
67	601326	秦港股份	4,200	10,542.00	0.02
68	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.02
69	603877	太平鸟	500	7,100.00	0.02
70	600956	新天绿能	1,357	6,839.28	0.02
71	300845	捷安高科	360	6,346.80	0.01
72	002095	生意宝	300	6,060.00	0.01
73	300840	酷特智能	806	4,787.64	0.01
74	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01
75	603739	蔚蓝生物	100	2,731.00	0.01
76	600674	川投能源	100	927.00	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	600782	新钢股份	1,543,614.75	1.64
2	002049	紫光国微	1,534,177.59	1.63
3	300296	利亚德	1,504,421.00	1.60
4	300014	亿纬锂能	1,472,605.00	1.57
5	002281	光迅科技	1,452,272.00	1.55
6	600201	生物股份	1,439,313.00	1.53
7	600754	锦江酒店	1,424,335.00	1.52
8	603338	浙江鼎力	1,423,930.00	1.52
9	002368	太极股份	1,415,401.00	1.51
10	002013	中航机电	1,402,934.28	1.49
11	002831	裕同科技	1,370,051.08	1.46
12	601928	凤凰传媒	1,303,160.91	1.39
13	300166	东方国信	1,291,382.00	1.38
14	000825	太钢不锈	1,275,178.04	1.36
15	601678	滨化股份	1,256,565.40	1.34
16	002019	亿帆医药	1,250,696.75	1.33
17	002544	杰赛科技	1,249,894.40	1.33
18	002821	凯莱英	1,218,594.00	1.30

19	600718	东软集团	1,211,120.35	1.29
20	601717	郑煤机	1,198,284.00	1.28

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	002049	紫光国微	2,457,748.00	2.62
2	002463	沪电股份	2,092,167.60	2.23
3	002821	凯莱英	1,811,329.40	1.93
4	300253	卫宁健康	1,799,553.44	1.92
5	600298	安琪酵母	1,727,811.00	1.84
6	000623	吉林敖东	1,677,887.38	1.79
7	000401	冀东水泥	1,629,770.49	1.74
8	300207	欣旺达	1,626,164.00	1.73
9	600745	闻泰科技	1,625,366.00	1.73
10	002414	高德红外	1,604,522.72	1.71
11	000988	华工科技	1,603,512.69	1.71
12	600763	通策医疗	1,580,305.10	1.68
13	600143	金发科技	1,576,244.20	1.68
14	600060	海信视像	1,566,597.62	1.67
15	600782	新钢股份	1,538,630.50	1.64
16	000686	东北证券	1,537,514.36	1.64
17	601231	环旭电子	1,536,311.34	1.64
18	002690	美亚光电	1,517,561.94	1.62
19	600737	中粮糖业	1,510,081.00	1.61
20	300014	亿纬锂能	1,502,663.00	1.60

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	269,468,718.43
卖出股票的收入（成交）总额	321,738,212.83

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	19,500.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,500.00	0.04

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128115	巨星转债	195	19,500.00	0.04

#### 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股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2007	IC2007	1.00	1,159,880.00	32,040.00	套保
公允价值变动总额合计					32,040.00
股指期货投资本期收益					82,446.60
股指期货投资本期公允价值变动					32,040.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）相抵销后的净额为 0。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	205,909.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,332.96
5	应收申购款	129,672.88
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	336,915.69

#### 7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 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。

##### 7.12.5.2 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	688158	优刻得	212,319.90	0.47	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

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
国泰中证 500 指数增强 A	331	21,158.48	4,196,045.51	59.91%	2,807,411.84	40.09%
国泰中证 500 指数增强 C	145	212,564.19	29,011,604.64	94.13%	1,810,202.49	5.87%
合计	476	79,464.84	33,207,650.15	87.79%	4,617,614.33	12.21%



## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国泰中证 500 指数增强 A	23,589.55	0.34%
	国泰中证 500 指数增强 C	20,214.06	0.07%
	合计	43,803.61	0.12%

## 8.3 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	份额级别	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	国泰中证 500 指数增强 A	0~10
	国泰中证 500 指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰中证 500 指数增强 A	0
	国泰中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 17 日）基金份额总额	503,992.20	52,535,553.55
本报告期期初基金份额总额	4,668,901.09	84,324,525.11
本报告期基金总申购份额	5,520,960.91	1,276,772.44
减：本报告期基金总赎回份额	3,186,404.65	54,779,490.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,003,457.35	30,821,807.13

## 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：

2020 年 2 月 15 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》，经本基金管理人第七届董事会第二十八次会议审议通过，李永梅女士不再担任本基金管理人副总经理。

本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

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

## 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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	
华创证券	2	590,302,009.31	100.00%	437,094.28	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
华创证券	10,595,946.40	100.00%	-	-	-	-

### 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	国泰基金旗下基金在 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告	《中国证券报》	2020-01-29
2	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》	2020-02-15
3	国泰基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020-03-17
4	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2020-03-17
5	国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法份子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	《公司官网》	2020-04-04
6	国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	《公司官网》	2020-05-20

## 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	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	20,008,003.20	-	-	20,008,003.20	52.90%
	2	2020 年 02 月 18 日至 2020 年 04 月 21 日, 2020 年 05 月 21 日至 2020 年 06 月 30 日	9,003,601.44	-	-	9,003,601.44	23.80%
	3	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 02 月 13 日	30,105,368.79	-	30,105,368.79	-	-
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、关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- 2、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 500 指数增强型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 16 层-19 层。

### 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

二〇二〇年八月三十一日