

国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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。

由于中华证券交易服务有限公司自 2020 年 6 月 15 日起将“中华交易服务半导体行业指数”名称变更为“中华交易服务半导体芯片行业指数”，根据本基金基金合同的有关约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2020 年 6 月 16 日起对本基金变更基金名称、标的指数名称及业绩比较基准，并对本基金的基金合同和托管协议作相应修改。

自 2020 年 6 月 16 日起，本基金标的指数名称由原“中华交易服务半导体行业指数”变更为“中华交易服务半导体芯片行业指数”。国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金的基金名称变更为“国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金”，基金简称变更为“芯片 ETF”，基金扩位简称变更为“芯片 ETF”，基金申赎简称变更为“芯片 ETF”，基金代码保持不变。国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金的业绩比较基准由原“中华交易服务半导体行业指数收益率”变更为“中华交易服务半导体芯片行业指数收益率”。修订后的基金合同、托管协议自 2020 年 6 月 16 日起生效。具体可查阅本基金管理人于 2020 年 6 月 11 日发布的《关于国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金及联接基金变更基金名称及标的指数名称并修改基金合同与托管协议的公告》。

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

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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
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	56
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61

8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	63
9 开放式基金份额变动	64
10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
11 影响投资者决策的其他重要信息	67
12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	68

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰 CES 半导体芯片行业 ETF
场内简称	芯片 ETF
基金主代码	512760
交易代码	512760
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 16 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,104,661,386.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 6 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>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，基于本基金流动性管理的需要投资于政府债券、央行票据和金融债等固定收益类品种，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>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</p>

	<p>对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>4、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>5、权证投资策略 本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，以追求较稳定的当期收益，并降低组合跟踪误差。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。</p> <p>7、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	中华交易服务半导体芯片行业指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。</p> <p>本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中华交易服务半导体芯片行业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	许俊
	联系电话	021-31081600转	010-66594319
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200082	100818

法定代表人	陈勇胜	刘连舸
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	932,031,441.24
本期利润	1,849,013,429.68
加权平均基金份额本期利润	0.3633
本期加权平均净值利润率	18.17%
本期基金份额净值增长率	44.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,569,364,759.79
期末可供分配基金份额利润	0.6992
期末基金资产净值	11,491,010,191.84
期末基金份额净值	2.2511
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	125.11%

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

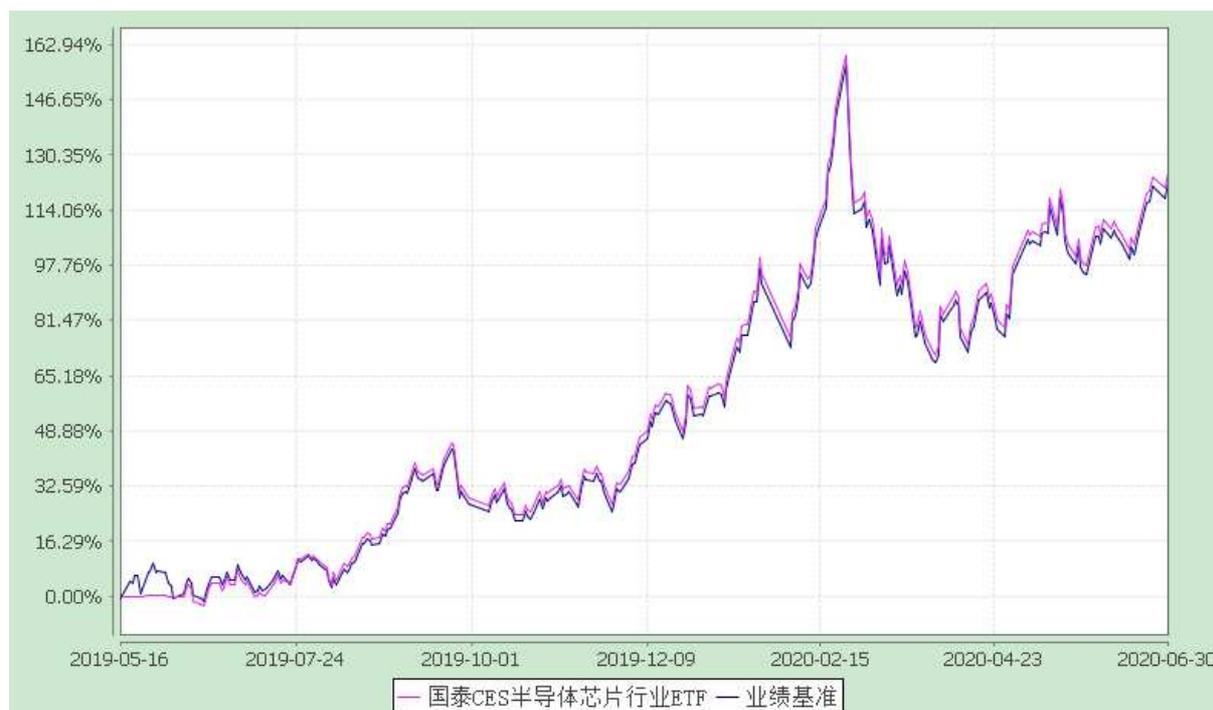
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	13.84%	1.89%	13.92%	1.90%	-0.08%	-0.01%
过去三个月	31.36%	2.54%	31.67%	2.58%	-0.31%	-0.04%
过去六个月	44.58%	3.19%	45.05%	3.23%	-0.47%	-0.04%
过去一年	118.05%	2.71%	112.00%	2.74%	6.05%	-0.03%
自基金合同生 效起至今	125.11%	2.59%	122.28%	2.71%	2.83%	-0.12%

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 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2019 年 5 月 16 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2019 年 5 月 16 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
艾小军	本基金的基金经理、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰沪深 300 指数、国泰上证 180 金融 ETF、上证 10 年期国债 ETF、国泰黄金 ETF、国泰深证 TMT50 指数分级、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合、国泰黄金 ETF 联接、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、国泰量化成长优选混合、上证 5 年期国债 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监	2019-04-02	-	19 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化

				<p>收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金(由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金(由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来)的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)的基金经理，2019 年 7 月起兼任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。</p>
--	--	--	--	--

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

同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同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 ≥ 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 16 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%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2020 年上半年的净值增长率为 44.58%，同期业绩比较基准收益率为 45.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	76,778,324.24	89,465,276.78
结算备付金		101,147,236.61	8,042,786.19
存出保证金		8,237,888.83	574,281.07
交易性金融资产	6.4.7.2	11,383,122,403.11	3,036,836,039.99
其中：股票投资		11,383,122,403.11	3,036,836,039.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		20,216,905.63	353,989.69
应收利息	6.4.7.5	313,241.86	18,277.33
应收股利		227,434.70	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,590,043,434.98	3,135,290,651.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,100,065.43	30,956,808.06
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,723,294.79	914,198.60
应付托管费		944,658.95	182,839.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,842,644.51	1,209,310.20
应交税费		18,627.07	1.54
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	87,403,952.39	57,087,775.76
负债合计		99,033,243.14	90,350,933.89
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	5,104,661,386.00	1,955,661,386.00
未分配利润	6.4.7.10	6,386,348,805.84	1,089,278,331.16
所有者权益合计		11,491,010,191.84	3,044,939,717.16
负债和所有者权益总计		11,590,043,434.98	3,135,290,651.05

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2511 元，基金份额总额 5,104,661,386.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金

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 16 日 (基 金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,923,145,756.09	11,308,881.60
1.利息收入		2,480,192.77	283,862.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,119,733.93	106,252.41
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		-	177,610.31
证券出借利息收入		1,360,458.84	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,054,175,358.97	6,286,691.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,034,340,041.81	6,199,337.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	19,835,317.16	87,353.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	916,981,988.44	4,176,659.40
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	-50,491,784.09	561,668.43
减：二、费用		74,132,326.41	697,243.52
1. 管理人报酬		24,977,188.90	148,809.53
2. 托管费		4,995,437.81	29,761.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	42,534,341.92	464,354.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		4,897.71	-
7. 其他费用	6.4.7.19	1,620,460.07	54,317.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,849,013,429.68	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,849,013,429.68	10,611,638.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金

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）	1,955,661,386.00	1,089,278,331.16	3,044,939,717.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,849,013,429.68	1,849,013,429.68
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）	3,149,000,000.00	3,448,057,045.00	6,597,057,045.00
其中：1.基金申购款	25,565,000,000.00	26,550,905,342.98	52,115,905,342.98
2.基金赎回款	-22,416,000,000.00	-23,102,848,297.98	-45,518,848,297.98
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）	5,104,661,386.00	6,386,348,805.84	11,491,010,191.84
项目	上年度可比期间 2019 年 5 月 16 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）	277,661,386.00	-	277,661,386.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,611,638.08	10,611,638.08
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）	-122,000,000.00	-5,566,590.37	-127,566,590.37
其中：1.基金申购款	102,000,000.00	763,969.21	102,763,969.21
2.基金赎回款	-224,000,000.00	-6,330,559.58	-230,330,559.58
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）	155,661,386.00	5,045,047.71	160,706,433.71

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 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(原“国泰 CES 半导体行业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[2019]398 号《关于准予国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数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 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 277,661,386.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0304 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 277,661,386.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]第 102 号文审核同意,本基金于 2019 年 6 月 12 日在上交所挂牌交易。

由于中华证券交易服务有限公司自 2020 年 6 月 15 日起将“中华交易服务半导体行业指数”名称变更为“中华交易服务半导体芯片行业指数”,根据本基金基金合同的有关约定,经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,本公司决定自 2020 年 6 月 16 日起对本基金变更基金名称、标的指数名称及业绩比较基准,并对本基金的基金合同和托管协议作相应修改,修订后的基金合同、托管协议自 2020 年 6 月 16 日起生效。自 2020 年 6 月 16 日起,国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金的基金名称变更为国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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)。在法律法规允许的情况,在履行适当程序后,本基金可以参与融资和转融通证券出借。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，即中华交易服务半导体芯片行业指数收益率。

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 CES 半导体芯片行业交易型开放式证券投资基金发起式联接基金(以下简称“国泰 CES 半导体芯片 ETF 联接基金”)。国泰 CES 半导体芯片 ETF 联接基金为交易型开放式基金，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 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 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数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，以利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让非货物期货，按照实际买入价计算销售额。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	76,778,324.24
定期存款	-
其他存款	-
合计	76,778,324.24

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	10,335,264,940.86	11,383,122,403.11	1,047,857,462.25
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	10,335,264,940.86	11,383,122,403.11	1,047,857,462.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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	7,350.32
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	40,964.67
应收债券利息	-
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	261,590.57
其他	3,336.30
合计	313,241.86

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	3,842,644.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,842,644.51

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	-
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	870,375.66
可退替代款	25,821.56
应付替代款	86,398,356.79
预提费用	109,398.38
合计	87,403,952.39

注：1. 应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	1,955,661,386.00	1,955,661,386.00
本期申购	25,565,000,000.00	25,565,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,416,000,000.00	-22,416,000,000.00
本期末	5,104,661,386.00	5,104,661,386.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	765,977,191.16	323,301,140.00	1,089,278,331.16
本期利润	932,031,441.24	916,981,988.44	1,849,013,429.68
本期基金份额交易产生的变动数	1,871,356,127.39	1,576,700,917.61	3,448,057,045.00
其中：基金申购款	16,442,629,691.51	10,108,275,651.47	26,550,905,342.98
基金赎回款	-14,571,273,564.12	-8,531,574,733.86	-23,102,848,297.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,569,364,759.79	2,816,984,046.05	6,386,348,805.84

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
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	649,509.45
其他	38,879.44
合计	1,119,733.93

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	135,036,367.75

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	1,034,340,041.81

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	28,796,988,827.12
减：卖出股票成本总额	27,897,685,153.06
买卖股票差价收入	899,303,674.06

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	45,518,848,297.98
减：现金支付赎回款总额	27,930,850,962.98
减：赎回股票成本总额	17,452,960,967.25
赎回差价收入	135,036,367.75

6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
出借证券现金清偿总额	817,112,333.97
减：出借证券成本总额	815,972,651.64
减：应收证券出借利息	1,139,682.33
证券出借差价收入	-

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	19,835,317.16
其中：证券出借权益补偿收入	639,087.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,835,317.16

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	916,981,988.44
——股票投资	916,981,988.44
——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	916,981,988.44

注：本基金本会计期间公允价值变动损益——股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

6.4.7.17 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	-
ETF 替代损益	-50,491,784.09
合计	-50,491,784.09

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 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	42,534,341.92
银行间市场交易费用	-
合计	42,534,341.92

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	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	12,430.31
指数使用费	1,498,631.38
合计	1,620,460.07

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，自基金成立之日起至基金净值首次大于 10 亿元人民币之前，按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提；自基金成立之日起至基金净值首次大于 10 亿元人民币之日起，按前一日基金资产净值的 0.03% 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）	申购赎回代理券商、受基金管理人的控股股东（中国建投）控制的公司
国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资	本基金的基金管理人管理的其他基金

基金发起式联接基金(“国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接”)	
------------------------------------	--

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16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	24,977,188.90	148,809.53
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年5月16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	4,995,437.81	29,761.92

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 发起式联接基金	989,000,000.00	19.37%	48,000,000.00	2.45%
申万宏源	23,738,599.00	0.47%	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年5月16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
中国银行	76,778,324.24	431,345.04	16,894,230.56	104,919.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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 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
002079	苏州固锴	2020-05-11	2020-11-11	大宗交易	9.36	12.01	1,000,000.00	9,360,000.00	12,010,000.00	-
300613	富瀚微	2020-06-02	2020-11-16	送股	-	104.71	48,000.00	-	5,026,080.00	-
300613	富瀚微	2020-05-14	2020-11-16	大宗交易	168.19	104.71	60,000.00	10,091,400.00	6,282,600.00	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
688158	优刻得	2020-01-10	2020-07-20	新股锁定	33.23	68.38	20,700.00	687,861.00	1,415,466.00	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-07-06	新股锁定	43.98	61.09	4,306.00	189,377.88	263,053.54	-
688189	南新制药	2020-03-18	2020-09-28	新股锁定	34.94	50.21	6,833.00	238,745.02	343,084.93	-
688222	成都先导	2020-04-03	2020-10-16	新股锁定	20.52	43.70	9,201.00	188,804.52	402,083.70	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	新股锁定	25.64	58.82	12,351.00	316,679.64	726,485.82	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本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。

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。

3、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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
2020060400000330	000733	振华科技	2020-06-04	2020-07-02	22.49	87,000.00	1,956,630.00
2020060400000350	002017	东信和平	2020-06-04	2020-07-02	11.92	79,000.00	941,680.00
2020060400000360	002049	紫光国微	2020-06-04	2020-07-02	72.75	119,000.00	8,657,250.00
2020060400000370	002079	苏州固锟	2020-06-04	2020-07-02	13.17	142,000.00	1,870,140.00
2020060400000380	002129	中环股份	2020-06-04	2020-07-02	22.46	474,000.00	10,646,040.00
2020060400000380	002104	恒宝股份	2020-06-04	2020-07-02	8.51	158,000.00	1,344,580.00
2020060400000390	002156	通富微电	2020-06-04	2020-07-02	25.05	166,000.00	4,158,300.00
2020060400000	002180	纳思达	2020-06-04	2020-07-02	32.91	150,000.00	4,936,500.00

0390							
202006 040000 0390	002185	华天科技	2020-06-04	2020-07-02	13.53	616,000.00	8,334,480.00
202006 040000 0430	002371	北方华创	2020-06-04	2020-07-02	170.91	71,000.00	12,134,610.00
202006 040000 0430	002413	雷科防务	2020-06-04	2020-07-02	7.68	308,000.00	2,365,440.00
202006 040000 0520	300101	振芯科技	2020-06-04	2020-07-02	11.05	111,000.00	1,226,550.00
202006 040000 0520	300054	鼎龙股份	2020-06-04	2020-07-02	16.60	198,000.00	3,286,800.00
202006 040000 0520	300053	欧比特	2020-06-04	2020-07-02	10.86	158,000.00	1,715,880.00
202006 040000 0530	300139	晓程科技	2020-06-04	2020-07-02	7.11	63,000.00	447,930.00
202006 040000 0540	300183	东软载波	2020-06-04	2020-07-02	15.69	63,000.00	988,470.00
202006 040000 0540	300223	北京君正	2020-06-04	2020-07-02	100.94	40,000.00	4,037,600.00
202006 040000 0550	300236	上海新阳	2020-06-04	2020-07-02	60.06	47,000.00	2,822,820.00
202006 040000 0550	300316	晶盛机电	2020-06-04	2020-07-02	24.74	182,000.00	4,502,680.00
202006 040000 0550	300327	中颖电子	2020-06-04	2020-07-02	32.40	55,000.00	1,782,000.00
202006 040000 0560	300373	扬杰科技	2020-06-04	2020-07-02	33.52	55,000.00	1,843,600.00
202006 040000 0580	300458	全志科技	2020-06-04	2020-07-02	36.80	55,000.00	2,024,000.00
202006	300474	景嘉微	2020-06-04	2020-07-	67.30	32,000.00	2,153,600.00

040000 0580				02			0
202006 040000 0590	300666	江丰电子	2020-06-04	2020-07-02	59.68	40,000.00	2,387,200.00
202006 040000 0610	600584	长电科技	2020-06-04	2020-07-02	31.27	316,000.00	9,881,320.00
202006 040000 0620	603160	汇顶科技	2020-06-04	2020-07-02	222.90	40,000.00	8,916,000.00
202006 040000 0640	600360	华微电子	2020-06-04	2020-07-02	8.64	221,000.00	1,909,440.00
202006 040000 0650	600171	上海贝岭	2020-06-04	2020-07-02	17.38	158,000.00	2,746,040.00
202006 040000 0740	600460	士兰微	2020-06-04	2020-07-02	14.68	221,000.00	3,244,280.00
202006 040000 0800	603005	晶方科技	2020-06-04	2020-07-02	78.66	55,000.00	4,326,300.00
202006 040000 0820	600667	太极实业	2020-06-04	2020-07-02	11.82	237,000.00	2,801,340.00
202006 090000 0290	000733	振华科技	2020-06-09	2020-07-07	22.49	32,000.00	719,680.00
202006 090000 0310	002017	东信和平	2020-06-09	2020-07-07	11.92	29,000.00	345,680.00
202006 090000 0310	002049	紫光国微	2020-06-09	2020-07-07	72.75	44,000.00	3,201,000.00
202006 090000 0320	002104	恒宝股份	2020-06-09	2020-07-07	8.51	58,000.00	493,580.00
202006 090000 0320	002079	苏州固锟	2020-06-09	2020-07-07	13.17	52,000.00	684,840.00
202006 090000 0330	002156	通富微电	2020-06-09	2020-07-07	25.05	61,000.00	1,528,050.00

202006 090000 0340	002129	中环股份	2020-06-09	2020-07- 07	22.46	174,000.00	3,908,040.0 0
202006 090000 0340	002180	纳思达	2020-06-09	2020-07- 07	32.91	55,000.00	1,810,050.0 0
202006 090000 0350	002185	华天科技	2020-06-09	2020-07- 07	13.53	226,000.00	3,057,780.0 0
202006 090000 0370	002371	北方华创	2020-06-09	2020-07- 07	170.91	26,000.00	4,443,660.0 0
202006 090000 0420	300053	欧比特	2020-06-09	2020-07- 07	10.86	58,000.00	629,880.00
202006 090000 0420	300054	鼎龙股份	2020-06-09	2020-07- 07	16.60	73,000.00	1,211,800.0 0
202006 090000 0430	300101	振芯科技	2020-06-09	2020-07- 07	11.05	41,000.00	453,050.00
202006 090000 0450	300236	上海新阳	2020-06-09	2020-07- 07	60.06	17,000.00	1,021,020.0 0
202006 090000 0450	300223	北京君正	2020-06-09	2020-07- 07	100.94	15,000.00	1,514,100.0 0
202006 090000 0460	300316	晶盛机电	2020-06-09	2020-07- 07	24.74	67,000.00	1,657,580.0 0
202006 090000 0470	300327	中颖电子	2020-06-09	2020-07- 07	32.40	20,000.00	648,000.00
202006 090000 0470	300373	扬杰科技	2020-06-09	2020-07- 07	33.52	20,000.00	670,400.00
202006 090000 0490	300458	全志科技	2020-06-09	2020-07- 07	36.80	20,000.00	736,000.00
202006 090000 0490	300474	景嘉微	2020-06-09	2020-07- 07	67.30	12,000.00	807,600.00
202006 090000	300666	江丰电子	2020-06-09	2020-07- 07	59.68	15,000.00	895,200.00

0500							
202006 090000 0510	600584	长电科技	2020-06-09	2020-07-07	31.27	116,000.00	3,627,320.00
202006 090000 0530	603160	汇顶科技	2020-06-09	2020-07-07	222.90	15,000.00	3,343,500.00
202006 090000 0540	600360	华微电子	2020-06-09	2020-07-07	8.64	81,000.00	699,840.00
202006 090000 0550	600171	上海贝岭	2020-06-09	2020-07-07	17.38	58,000.00	1,008,040.00
202006 090000 0610	600460	士兰微	2020-06-09	2020-07-07	14.68	81,000.00	1,189,080.00
202006 090000 0650	603005	晶方科技	2020-06-09	2020-07-07	78.66	20,000.00	1,573,200.00
202006 090000 0680	600667	太极实业	2020-06-09	2020-07-07	11.82	87,000.00	1,028,340.00
202006 150000 0330	000733	振华科技	2020-06-15	2020-07-13	22.49	43,000.00	967,070.00
202006 150000 0440	002017	东信和平	2020-06-15	2020-07-13	11.92	32,000.00	381,440.00
202006 150000 0470	002049	紫光国微	2020-06-15	2020-07-13	72.75	54,000.00	3,928,500.00
202006 150000 0500	002079	苏州固锴	2020-06-15	2020-07-13	13.17	61,000.00	803,370.00
202006 150000 0510	002104	恒宝股份	2020-06-15	2020-07-13	8.51	68,000.00	578,680.00
202006 150000 0530	002129	中环股份	2020-06-15	2020-07-13	22.46	241,000.00	5,412,860.00
202006 150000 0540	002156	通富微电	2020-06-15	2020-07-13	25.05	86,000.00	2,154,300.00
202006	002180	纳思达	2020-06-15	2020-07-	32.91	79,000.00	2,599,890.00

150000 0550				13			0
202006 150000 0550	002185	华天科技	2020-06-15	2020-07-13	13.53	270,000.00	3,653,100.00
202006 150000 0650	002371	北方华创	2020-06-15	2020-07-13	170.91	29,000.00	4,956,390.00
202006 150000 0870	300053	欧比特	2020-06-15	2020-07-13	10.86	68,000.00	738,480.00
202006 150000 0870	300054	鼎龙股份	2020-06-15	2020-07-13	16.60	86,000.00	1,427,600.00
202006 150000 0890	300101	振芯科技	2020-06-15	2020-07-13	11.05	47,000.00	519,350.00
202006 150000 0930	300223	北京君正	2020-06-15	2020-07-13	100.94	18,000.00	1,816,920.00
202006 150000 0930	300236	上海新阳	2020-06-15	2020-07-13	60.06	22,000.00	1,321,320.00
202006 150000 0960	300316	晶盛机电	2020-06-15	2020-07-13	24.74	79,000.00	1,954,460.00
202006 150000 0970	300327	中颖电子	2020-06-15	2020-07-13	32.40	25,000.00	810,000.00
202006 150000 0970	300373	扬杰科技	2020-06-15	2020-07-13	33.52	29,000.00	972,080.00
202006 150000 0990	300458	全志科技	2020-06-15	2020-07-13	36.80	29,000.00	1,067,200.00
202006 150000 0990	300474	景嘉微	2020-06-15	2020-07-13	67.30	14,000.00	942,200.00
202006 150000 1000	300666	江丰电子	2020-06-15	2020-07-13	59.68	18,000.00	1,074,240.00
202006 150000 1020	600584	长电科技	2020-06-15	2020-07-13	31.27	140,000.00	4,377,800.00

202006 150000 1150	603160	汇顶科技	2020-06-15	2020-07-13	222.90	22,000.00	4,903,800.00
202006 150000 1190	600360	华微电子	2020-06-15	2020-07-13	8.64	94,000.00	812,160.00
202006 150000 1200	600171	上海贝岭	2020-06-15	2020-07-13	17.38	68,000.00	1,181,840.00
202006 150000 1520	600460	士兰微	2020-06-15	2020-07-13	14.68	97,000.00	1,423,960.00
202006 150000 1660	603005	晶方科技	2020-06-15	2020-07-13	78.66	25,000.00	1,966,500.00
202006 150000 1770	600667	太极实业	2020-06-15	2020-07-13	11.82	155,000.00	1,832,100.00
202006 160000 0540	000733	振华科技	2020-06-16	2020-07-14	22.49	10,000.00	224,900.00
202006 160000 0820	002017	东信和平	2020-06-16	2020-07-14	11.92	10,000.00	119,200.00
202006 160000 0890	600584	长电科技	2020-06-16	2020-07-14	31.27	10,000.00	312,700.00
202006 160000 1110	600360	华微电子	2020-06-16	2020-07-14	8.64	10,000.00	86,400.00
202006 160000 1150	600171	上海贝岭	2020-06-16	2020-07-14	17.38	10,000.00	173,800.00
202006 160000 1300	002049	紫光国微	2020-06-16	2020-07-14	72.75	10,000.00	727,500.00
202006 160000 1370	002079	苏州固锴	2020-06-16	2020-07-14	13.17	10,000.00	131,700.00
202006 160000 1450	002104	恒宝股份	2020-06-16	2020-07-14	8.51	10,000.00	85,100.00
202006 160000	002129	中环股份	2020-06-16	2020-07-14	22.46	13,000.00	291,980.00

1530							
202006 160000 1640	002156	通富微电	2020-06-16	2020-07-14	25.05	10,000.00	250,500.00
202006 160000 1660	002180	纳思达	2020-06-16	2020-07-14	32.91	10,000.00	329,100.00
202006 160000 1680	002185	华天科技	2020-06-16	2020-07-14	13.53	15,000.00	202,950.00
202006 160000 2030	600460	士兰微	2020-06-16	2020-07-14	14.68	10,000.00	146,800.00
202006 160000 2410	603005	晶方科技	2020-06-16	2020-07-14	78.66	10,000.00	786,600.00
202006 160000 2710	600667	太极实业	2020-06-16	2020-07-14	11.82	10,000.00	118,200.00
202006 160000 3190	300054	鼎龙股份	2020-06-16	2020-07-14	16.60	10,000.00	166,000.00
202006 160000 3190	300053	欧比特	2020-06-16	2020-07-14	10.86	10,000.00	108,600.00
202006 160000 3230	300101	振芯科技	2020-06-16	2020-07-14	11.05	10,000.00	110,500.00
202006 160000 3310	300223	北京君正	2020-06-16	2020-07-14	100.94	10,000.00	1,009,400.00
202006 160000 3310	300236	上海新阳	2020-06-16	2020-07-14	60.06	10,000.00	600,600.00
202006 160000 3380	300316	晶盛机电	2020-06-16	2020-07-14	24.74	10,000.00	247,400.00
202006 160000 3390	300327	中颖电子	2020-06-16	2020-07-14	32.40	10,000.00	324,000.00
202006 160000 3400	300373	扬杰科技	2020-06-16	2020-07-14	33.52	10,000.00	335,200.00
202006	300458	全志科技	2020-06-16	2020-07-	36.80	10,000.00	368,000.00

160000 3410				14			
202006 160000 3410	300474	景嘉微	2020-06-16	2020-07-14	67.30	10,000.00	673,000.00
202006 160000 3460	300666	江丰电子	2020-06-16	2020-07-14	59.68	10,000.00	596,800.00
202006 180000 0170	000733	振华科技	2020-06-18	2020-07-16	22.49	14,000.00	314,860.00
202006 180000 0220	002017	东信和平	2020-06-18	2020-07-16	11.92	11,000.00	131,120.00
202006 180000 0250	002049	紫光国微	2020-06-18	2020-07-16	72.75	18,000.00	1,309,500.00
202006 180000 0250	002079	苏州固锴	2020-06-18	2020-07-16	13.17	20,000.00	263,400.00
202006 180000 0250	002104	恒宝股份	2020-06-18	2020-07-16	8.51	23,000.00	195,730.00
202006 180000 0270	002129	中环股份	2020-06-18	2020-07-16	22.46	80,000.00	1,796,800.00
202006 180000 0290	002156	通富微电	2020-06-18	2020-07-16	25.05	29,000.00	726,450.00
202006 180000 0290	002185	华天科技	2020-06-18	2020-07-16	13.53	90,000.00	1,217,700.00
202006 180000 0290	002180	纳思达	2020-06-18	2020-07-16	32.91	26,000.00	855,660.00
202006 180000 0340	002371	北方华创	2020-06-18	2020-07-16	170.91	11,000.00	1,880,010.00
202006 180000 0450	300053	欧比特	2020-06-18	2020-07-16	10.86	23,000.00	249,780.00
202006 180000 0450	300054	鼎龙股份	2020-06-18	2020-07-16	16.60	29,000.00	481,400.00

202006 180000 0470	300101	振芯科技	2020-06-18	2020-07- 16	11.05	16,000.00	176,800.00
202006 180000 0500	300223	北京君正	2020-06-18	2020-07- 16	100.94	10,000.00	1,009,400.0 0
202006 180000 0500	300316	晶盛机电	2020-06-18	2020-07- 16	24.74	26,000.00	643,240.00
202006 180000 0510	300327	中颖电子	2020-06-18	2020-07- 16	32.40	10,000.00	324,000.00
202006 180000 0510	300236	上海新阳	2020-06-18	2020-07- 16	60.06	10,000.00	600,600.00
202006 180000 0520	300373	扬杰科技	2020-06-18	2020-07- 16	33.52	10,000.00	335,200.00
202006 180000 0520	300458	全志科技	2020-06-18	2020-07- 16	36.80	10,000.00	368,000.00
202006 180000 0530	300474	景嘉微	2020-06-18	2020-07- 16	67.30	10,000.00	673,000.00
202006 180000 0540	300666	江丰电子	2020-06-18	2020-07- 16	59.68	10,000.00	596,800.00
202006 180000 0960	600360	华微电子	2020-06-18	2020-07- 16	8.64	31,000.00	267,840.00
202006 180000 0980	603986	兆易创新	2020-06-18	2020-07- 16	235.91	11,000.00	2,595,010.0 0
202006 180000 0990	603160	汇顶科技	2020-06-18	2020-07- 16	222.90	10,000.00	2,229,000.0 0
202006 180000 1010	603005	晶方科技	2020-06-18	2020-07- 16	78.66	10,000.00	786,600.00
202006 180000 1010	600667	太极实业	2020-06-18	2020-07- 16	11.82	52,000.00	614,640.00
202006 180000	600584	长电科技	2020-06-18	2020-07- 16	31.27	47,000.00	1,469,690.0 0

1010							
202006 180000 1020	600460	士兰微	2020-06-18	2020-07-16	14.68	32,000.00	469,760.00
202006 180000 1030	600171	上海贝岭	2020-06-18	2020-07-16	17.38	23,000.00	399,740.00
202006 220000 0840	000733	振华科技	2020-06-22	2020-07-20	22.49	21,200.00	476,788.00
202006 220000 1320	002017	东信和平	2020-06-22	2020-07-20	11.92	15,800.00	188,336.00
202006 220000 1390	002049	紫光国微	2020-06-22	2020-07-20	72.75	25,000.00	1,818,750.00
202006 220000 1470	002079	苏州固锴	2020-06-22	2020-07-20	13.17	30,000.00	395,100.00
202006 220000 1540	002104	恒宝股份	2020-06-22	2020-07-20	8.51	32,800.00	279,128.00
202006 220000 1600	002129	中环股份	2020-06-22	2020-07-20	22.46	114,700.00	2,576,162.00
202006 220000 1720	600584	长电科技	2020-06-22	2020-07-20	31.27	66,000.00	2,063,820.00
202006 220000 1870	603986	兆易创新	2020-06-22	2020-07-20	235.91	16,000.00	3,774,560.00
202006 220000 2000	603160	汇顶科技	2020-06-22	2020-07-20	222.90	10,700.00	2,385,030.00
202006 220000 2000	002156	通富微电	2020-06-22	2020-07-20	25.05	40,700.00	1,019,535.00
202006 220000 2080	002180	纳思达	2020-06-22	2020-07-20	32.91	37,500.00	1,234,125.00
202006 220000 2140	600360	华微电子	2020-06-22	2020-07-20	8.64	45,400.00	392,256.00
202006	002185	华天科技	2020-06-22	2020-07-	13.53	128,900.00	1,744,017.00

220000 2230				20			0
202006 220000 2260	600171	上海贝岭	2020-06-22	2020-07-20	17.38	33,100.00	575,278.00
202006 220000 2370	603501	韦尔股份	2020-06-22	2020-07-20	201.95	10,200.00	2,059,890.00
202006 220000 3010	002371	北方华创	2020-06-22	2020-07-20	170.91	14,600.00	2,495,286.00
202006 220000 3850	600460	士兰微	2020-06-22	2020-07-20	14.68	46,300.00	679,684.00
202006 220000 4590	603005	晶方科技	2020-06-22	2020-07-20	78.66	11,300.00	888,858.00
202006 220000 4870	600667	太极实业	2020-06-22	2020-07-20	11.82	74,300.00	878,226.00
202006 220000 5360	300053	欧比特	2020-06-22	2020-07-20	10.86	33,000.00	358,380.00
202006 220000 5370	300054	鼎龙股份	2020-06-22	2020-07-20	16.60	40,400.00	670,640.00
202006 220000 5470	300101	振芯科技	2020-06-22	2020-07-20	11.05	23,000.00	254,150.00
202006 220000 5580	300223	北京君正	2020-06-22	2020-07-20	100.94	10,000.00	1,009,400.00
202006 220000 5590	300236	上海新阳	2020-06-22	2020-07-20	60.06	10,300.00	618,618.00
202006 220000 5700	300316	晶盛机电	2020-06-22	2020-07-20	24.74	37,800.00	935,172.00
202006 220000 5720	300327	中颖电子	2020-06-22	2020-07-20	32.40	11,500.00	372,600.00
202006 220000 5730	300373	扬杰科技	2020-06-22	2020-07-20	33.52	13,900.00	465,928.00

202006 220000 5750	300474	景嘉微	2020-06-22	2020-07- 20	67.30	10,000.00	673,000.00
202006 220000 5750	300458	全志科技	2020-06-22	2020-07- 20	36.80	13,600.00	500,480.00
202006 220000 5810	300666	江丰电子	2020-06-22	2020-07- 20	59.68	10,000.00	596,800.00
202006 290000 0260	000733	振华科技	2020-06-29	2020-07- 27	22.49	48,000.00	1,079,520.0 0
202006 290000 0340	002017	东信和平	2020-06-29	2020-07- 27	11.92	36,000.00	429,120.00
202006 290000 0350	002049	紫光国微	2020-06-29	2020-07- 27	72.75	60,000.00	4,365,000.0 0
202006 290000 0370	002079	苏州固锴	2020-06-29	2020-07- 27	13.17	68,000.00	895,560.00
202006 290000 0380	002104	恒宝股份	2020-06-29	2020-07- 27	8.51	76,000.00	646,760.00
202006 290000 0400	002129	中环股份	2020-06-29	2020-07- 27	22.46	268,000.00	6,019,280.0 0
202006 290000 0410	002156	通富微电	2020-06-29	2020-07- 27	25.05	96,000.00	2,404,800.0 0
202006 290000 0420	002180	纳思达	2020-06-29	2020-07- 27	32.91	88,000.00	2,896,080.0 0
202006 290000 0420	002185	华天科技	2020-06-29	2020-07- 27	13.53	300,000.00	4,059,000.0 0
202006 290000 0460	002371	北方华创	2020-06-29	2020-07- 27	170.91	32,000.00	5,469,120.0 0
202006 290000 0620	300054	鼎龙股份	2020-06-29	2020-07- 27	16.60	96,000.00	1,593,600.0 0
202006 290000	300053	欧比特	2020-06-29	2020-07- 27	10.86	76,000.00	825,360.00

0620							
202006 290000 0650	300101	振芯科技	2020-06-29	2020-07- 27	11.05	52,000.00	574,600.00
202006 290000 0690	300223	北京君正	2020-06-29	2020-07- 27	100.94	20,000.00	2,018,800.0 0
202006 290000 0690	300236	上海新阳	2020-06-29	2020-07- 27	60.06	24,000.00	1,441,440.0 0
202006 290000 0720	300316	晶盛机电	2020-06-29	2020-07- 27	24.74	88,000.00	2,177,120.0 0
202006 290000 0720	300327	中颖电子	2020-06-29	2020-07- 27	32.40	28,000.00	907,200.00
202006 290000 0730	300373	扬杰科技	2020-06-29	2020-07- 27	33.52	32,000.00	1,072,640.0 0
202006 290000 0750	300474	景嘉微	2020-06-29	2020-07- 27	67.30	16,000.00	1,076,800.0 0
202006 290000 0750	300458	全志科技	2020-06-29	2020-07- 27	36.80	32,000.00	1,177,600.0 0
202006 290000 0770	300666	江丰电子	2020-06-29	2020-07- 27	59.68	20,000.00	1,193,600.0 0
202006 290000 0810	600584	长电科技	2020-06-29	2020-07- 27	31.27	152,000.00	4,753,040.0 0
202006 290000 0840	603160	汇顶科技	2020-06-29	2020-07- 27	222.90	24,000.00	5,349,600.0 0
202006 290000 0860	600171	上海贝岭	2020-06-29	2020-07- 27	17.38	76,000.00	1,320,880.0 0
202006 290000 0880	600360	华微电子	2020-06-29	2020-07- 27	8.64	104,000.00	898,560.00
202006 290000 1070	600460	士兰微	2020-06-29	2020-07- 27	14.68	108,000.00	1,585,440.0 0
202006	603005	晶方科技	2020-06-29	2020-07-	78.66	28,000.00	2,202,480.0

290000 1190				27			0
202006 290000 1260	600667	太极实业	2020-06-29	2020-07- 27	11.82	172,000.00	2,033,040.0 0
合计	-	-	-	-	-	12,467,000. 00	342,228,117 .00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中华交易服务半导体芯片行业指数，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。

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

放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，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割和款项清算，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 0.00%(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来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

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	76,778,324.24	-	-	-	76,778,324.24
结算备付金	101,147,236.61	-	-	-	101,147,236.61
存出保证金	8,237,888.83	-	-	-	8,237,888.83
交易性金融资产	-	-	-	11,383,122,403.11	11,383,122,403.11
应收证券清算款	-	-	-	20,216,905.63	20,216,905.63
应收股利	-	-	-	227,434.70	227,434.70
应收利息	-	-	-	313,241.86	313,241.86
资产总计	186,163,449.68	-	-	11,403,879,985.30	11,590,043,434.98

负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,100,065.43	2,100,065.43
应付管理人报酬	-	-	-	4,723,294.79	4,723,294.79
应付托管费	-	-	-	944,658.95	944,658.95
应付交易费用	-	-	-	3,842,644.51	3,842,644.51
应交税费	-	-	-	18,627.07	18,627.07
其他负债	-	-	-	87,403,952.39	87,403,952.39
负债总计	-	-	-	99,033,243.14	99,033,243.14
利率敏感度缺口	186,163,449.68	-	-	11,304,846,742.16	11,491,010,191.84
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	89,465,276.78	-	-	-	89,465,276.78
结算备付金	8,042,786.19	-	-	-	8,042,786.19
存出保证金	574,281.07	-	-	-	574,281.07
交易性金融资产	-	-	-	3,036,836,039.99	3,036,836,039.99
应收证券清算款	-	-	-	353,989.69	353,989.69
应收利息	-	-	-	18,277.33	18,277.33
资产总计	98,082,344.04	-	-	3,037,208,307.01	3,135,290,651.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,956,808.06	30,956,808.06
应付管理人报酬	-	-	-	914,198.60	914,198.60
应付托管费	-	-	-	182,839.73	182,839.73
应付交易费用	-	-	-	1,209,310.20	1,209,310.20
应交税费	-	-	-	1.54	1.54
其他负债	-	-	-	57,087,775.76	57,087,775.76
负债总计	-	-	-	90,350,933.89	90,350,933.89
利率敏感度缺口	98,082,344.04	-	-	2,946,857,373.12	3,044,939,717.16

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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 0.00%(2019 年 12 月 31 日:0.00%)，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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)。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。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	上年度末
----	-----	------

	2020 年 6 月 30 日		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	11,383,122,403.11	99.06	3,036,836,039.99	99.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,383,122,403.11	99.06	3,036,836,039.99	99.73

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
	中华交易服务半导体芯片行业指数上升 5%	增加约 55,409	-
中华交易服务半导体芯片行业指数下降 5%	减少约 55,409	-	

注: 于 2019 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资产净值的影响。

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) 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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层次可分为：

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：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层次：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)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的金融工具中属于第一层次的余额为 11,356,646,510.22 元，第二层次的余额为 26,475,892.89 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 3,035,041,499.40 元，第二层次的余额为 1,794,540.59 元，无属于第三层次的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金分别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不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或第三层次。

(iv)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)基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 52,115,905,342.98 元，其中包括以股票支付的申购款 19,934,827,187.16 元和以现金支付的申购款 32,181,078,155.82 元。

(3)除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,383,122,403.11	98.21
	其中：股票	11,383,122,403.11	98.21
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	177,925,560.85	1.54
8	其他各项资产	28,995,471.02	0.25
9	合计	11,590,043,434.98	100.00

注：1、上述股票投资包括可退替代款估值增值。

2、报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 342,228,117.00 元。

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	-	-
C	制造业	11,243,669,670.98	97.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	26,876,130.39	0.23
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,180,691.60	0.88
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	11,371,726,492.97	98.96

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	7,726,940.44	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,266,886.00	0.03
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	402,083.70	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,395,910.14	0.10

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	603986	兆易创新	4,582,859	1,081,142,266.69	9.41
2	002129	中环股份	34,122,978	766,402,085.88	6.67
3	002371	北方华创	4,143,227	708,118,926.57	6.16
4	603160	汇顶科技	3,055,876	681,154,760.40	5.93
5	600584	长电科技	19,870,105	621,338,183.35	5.41
6	603501	韦尔股份	3,055,840	617,126,888.00	5.37
7	002049	紫光国微	7,639,452	555,770,133.00	4.84
8	002185	华天科技	38,197,462	516,811,660.86	4.50
9	300661	圣邦股份	1,527,781	466,049,594.05	4.06
10	300782	卓胜微	935,990	379,796,662.30	3.31
11	002180	纳思达	11,204,508	368,740,358.28	3.21
12	002156	通富微电	12,223,260	306,192,663.00	2.66
13	603005	晶方科技	3,565,117	280,432,103.22	2.44
14	300316	晶盛机电	11,204,590	277,201,556.60	2.41
15	600667	太极实业	21,899,899	258,856,806.18	2.25

16	300223	北京君正	2,546,407	257,034,322.58	2.24
17	002409	雅克科技	4,074,645	212,574,229.65	1.85
18	300054	鼎龙股份	12,223,337	202,907,394.20	1.77
19	600460	士兰微	13,751,015	201,864,900.20	1.76
20	300236	上海新阳	3,055,723	183,526,723.38	1.60
21	600171	上海贝岭	9,676,865	168,183,913.70	1.46
22	300666	江丰电子	2,546,472	151,973,448.96	1.32
23	300458	全志科技	4,074,631	149,946,420.80	1.30
24	000733	振华科技	6,111,837	137,455,214.13	1.20
25	300474	景嘉微	2,037,155	137,100,531.50	1.19
26	300373	扬杰科技	4,074,573	136,579,686.96	1.19
27	300456	赛微电子	4,583,434	126,594,447.08	1.10
28	300327	中颖电子	3,565,114	115,509,693.60	1.01
29	600360	华微电子	13,241,803	114,409,177.92	1.00
30	002079	苏州固锟	8,745,700	114,020,869.00	0.99
31	300623	捷捷微电	3,565,140	107,132,457.00	0.93
32	300053	欧比特	9,676,695	105,088,907.70	0.91
33	603690	至纯科技	2,037,200	84,299,336.00	0.73
34	002104	恒宝股份	9,676,800	82,349,568.00	0.72
35	300672	国科微	1,527,935	78,551,138.35	0.68
36	300101	振芯科技	6,620,700	73,158,735.00	0.64
37	300604	长川科技	2,036,984	62,718,737.36	0.55
38	002119	康强电子	4,583,668	56,791,646.52	0.49
39	300613	富瀚微	509,060	56,748,778.00	0.49
40	002017	东信和平	4,583,700	54,637,704.00	0.48
41	300046	台基股份	2,546,549	51,516,686.27	0.45
42	000925	众合科技	6,620,900	48,266,361.00	0.42
43	603078	江化微	1,018,440	45,778,878.00	0.40
44	300671	富满电子	1,527,920	44,431,913.60	0.39
45	603068	博通集成	509,327	41,041,569.66	0.36
46	300667	必创科技	1,024,000	29,573,120.00	0.26
47	002881	美格智能	1,018,557	27,949,204.08	0.24
48	603929	亚翔集成	1,527,921	26,876,130.39	0.23

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	002413	雷科防务	577,000	4,431,360.00	0.04
2	300183	东软载波	118,000	1,851,420.00	0.02
3	688158	优刻得	20,700	1,415,466.00	0.01
4	300139	晓程科技	118,000	838,980.00	0.01

5	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.01
6	688399	硕世生物	2,290	636,620.00	0.01
7	688198	佰仁医疗	3,213	423,248.49	0.00
8	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.00
9	688189	南新制药	6,833	343,084.93	0.00
10	688181	八亿时空	4,306	263,053.54	0.00
11	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
12	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
13	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
14	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	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	002371	北方华创	3,252,348,106.16	106.81
2	002129	中环股份	2,740,557,132.17	90.00
3	002185	华天科技	2,405,324,433.93	78.99
4	002049	紫光国微	2,292,703,601.08	75.30
5	002180	纳思达	1,812,433,711.99	59.52
6	300661	圣邦股份	1,548,001,904.47	50.84
7	300782	卓胜微	1,362,568,100.13	44.75
8	002156	通富微电	1,357,835,764.72	44.59
9	300316	晶盛机电	1,325,049,580.60	43.52
10	300223	北京君正	1,148,088,673.42	37.70
11	300236	上海新阳	820,636,039.28	26.95
12	300054	鼎龙股份	764,640,782.22	25.11
13	002409	雅克科技	727,819,284.59	23.90
14	002413	雷科防务	723,468,456.31	23.76
15	300666	江丰电子	715,831,494.57	23.51
16	300456	赛微电子	684,282,952.56	22.47
17	300474	景嘉微	636,843,562.22	20.91
18	300053	欧比特	629,971,459.67	20.69
19	000733	振华科技	628,950,898.13	20.66
20	300458	全志科技	611,771,521.69	20.09
21	300327	中颖电子	534,887,689.31	17.57
22	002079	苏州固锝	532,231,942.81	17.48
23	300373	扬杰科技	498,801,810.19	16.38
24	300613	富瀚微	439,758,513.41	14.44
25	300672	国科微	411,165,429.26	13.50

26	300623	捷捷微电	403,796,118.92	13.26
27	300101	振芯科技	398,827,652.28	13.10
28	002104	恒宝股份	392,975,007.13	12.91
29	002017	东信和平	336,444,718.37	11.05
30	300604	长川科技	328,961,443.97	10.80
31	002119	康强电子	321,297,900.08	10.55
32	300183	东软载波	316,241,466.92	10.39
33	000925	众合科技	279,704,282.85	9.19
34	300046	台基股份	274,166,013.73	9.00
35	300671	富满电子	223,895,994.70	7.35
36	603160	汇顶科技	188,869,751.76	6.20
37	300139	晓程科技	162,966,779.34	5.35
38	002881	美格智能	123,461,974.42	4.05
39	603986	兆易创新	117,234,158.00	3.85
40	600667	太极实业	104,818,084.95	3.44

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002371	北方华创	2,949,995,189.04	96.88
2	002129	中环股份	2,365,421,787.90	77.68
3	002185	华天科技	2,184,654,060.62	71.75
4	002049	紫光国微	2,039,251,814.29	66.97
5	002180	纳思达	1,506,201,267.17	49.47
6	300661	圣邦股份	1,388,934,664.24	45.61
7	300782	卓胜微	1,216,239,023.86	39.94
8	300316	晶盛机电	1,174,238,495.18	38.56
9	002156	通富微电	1,156,951,400.22	38.00
10	300223	北京君正	959,756,718.04	31.52
11	002413	雷科防务	791,040,928.88	25.98
12	300236	上海新阳	733,777,504.00	24.10
13	300054	鼎龙股份	686,173,695.75	22.53
14	002409	雅克科技	630,342,886.72	20.70
15	300666	江丰电子	625,018,882.27	20.53
16	300456	赛微电子	592,556,696.41	19.46
17	300474	景嘉微	553,434,862.86	18.18
18	300053	欧比特	549,756,270.19	18.05
19	000733	振华科技	542,986,911.05	17.83
20	300458	全志科技	514,375,425.33	16.89
21	300327	中颖电子	463,048,052.79	15.21
22	002079	苏州固锟	462,352,092.37	15.18

23	300373	扬杰科技	425,500,423.86	13.97
24	300613	富瀚微	424,281,529.32	13.93
25	300623	捷捷微电	356,298,215.26	11.70
26	300101	振芯科技	354,336,129.28	11.64
27	300672	国科微	352,696,931.22	11.58
28	002104	恒宝股份	352,631,601.80	11.58
29	300183	东软载波	330,101,260.85	10.84
30	002017	东信和平	297,169,618.41	9.76
31	300604	长川科技	294,627,268.14	9.68
32	002119	康强电子	276,325,839.74	9.07
33	000925	众合科技	248,277,446.79	8.15
34	300046	台基股份	240,773,232.92	7.91
35	300671	富满电子	194,442,001.15	6.39
36	300139	晓程科技	169,243,394.00	5.56
37	603986	兆易创新	110,532,512.74	3.63
38	002881	美格智能	107,043,015.90	3.52

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	32,845,123,307.83
卖出股票的收入（成交）总额	28,796,988,827.12

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的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。

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（除“中环股份”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。

中环股份公司自身由于未及时披露公司与关联方发生的关联交易，受到深圳证券交易所监管关注等监管措施。

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。

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	8,237,888.83
2	应收证券清算款	20,216,905.63
3	应收股利	227,434.70
4	应收利息	313,241.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,995,471.02

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

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	002371	北方华创	31,379,076.00	0.27	转融通
2	002129	中环股份	30,651,162.00	0.27	转融通
3	603160	汇顶科技	27,126,930.00	0.24	转融通
4	600584	长电科技	26,485,690.00	0.23	转融通
5	002049	紫光国微	24,007,500.00	0.21	转融通
6	002185	华天科技	22,269,027.00	0.19	转融通
7	603986	兆易创新	6,369,570.00	0.06	转融通
8	603501	韦尔股份	2,059,890.00	0.02	转融通

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	002413	雷科防务	2,365,440.00	0.02	转融通
2	688158	优刻得	1,415,466.00	0.01	新股锁定
3	300183	东软载波	988,470.00	0.01	转融通
4	688520	神州细胞	726,485.82	0.01	新股锁定
5	300139	晓程科技	447,930.00	0.00	转融通

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		芯片 ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比 例
140,274	36,390.65	728,145,270.00	14.26%	3,387,516,116.00	66.36%	989,000,000.00	19.37%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	44,000,000.00	0.86%
2	日照钢铁有限公司	35,500,000.00	0.70%
3	李春晖	32,399,900.00	0.63%
4	创金合信基金—华夏银行—创金合信华睿 2 号集合资产管理计划	31,371,620.00	0.61%
5	龙惠珍	26,112,321.00	0.51%
6	申万宏源证券有限公司	23,738,599.00	0.47%
7	王毅仁	21,759,200.00	0.43%
8	国泰君安证券股份有限公司	21,204,300.00	0.42%
9	丁武杰	20,000,039.00	0.39%
10	中国人寿资产管理有限公司	17,999,926.00	0.35%
-	中国银行股份有限公司—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	989,000,000.00	19.37%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	24,500.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年5月16日）基金份额总额	277,661,386.00
本报告期期初基金份额总额	1,955,661,386.00
本报告期基金总申购份额	25,565,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	22,416,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5,104,661,386.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

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	
东吴证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	59,441,250,030.69	96.45%	6,615,925.76	80.53%	-
长城证券	1	909,024,336.91	1.47%	646,585.15	7.87%	-
东方证券	2	557,853,289.48	0.91%	407,961.21	4.97%	-
长江证券	1	534,655,932.08	0.87%	390,996.72	4.76%	-
中金财富	2	96,145,411.75	0.16%	70,311.03	0.86%	-
银河证券	1	84,945,280.09	0.14%	79,393.92	0.97%	-
中金证券	1	6,350,097.45	0.01%	4,643.82	0.06%	-
华西证券	1	16,656.36	0.00%	11.85	0.00%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、

行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	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
东吴证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司关于修订旗下 8 只 ETF 基金托管协议及招募说明书的公告	《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2020-01-17
2	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
3	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
4	国泰基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020-03-13
5	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
6	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
7	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
8	关于国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金及联接基金变更基金名称及标的指数名称并修改基金合同与托管协议的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2020-06-11
9	国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券	《上海证券报》、《中国证	2020-06-16

投资基金及联接基金变更基金名称提示性公告	券报》	
----------------------	-----	--

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
国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020年02月28日至2020年03月01日, 2020年05月26日至2020年05月27日, 2020年05月29日至2020年06月22日	48,000,000.00	1,615,000.00	674,000,000.00	989,000,000.00	19.37%
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 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰 CES 半导体芯片行业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 16 层-19 层。

本基金托管人住所。

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

二〇二〇年八月三十一日