

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
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	41
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.11 投资组合报告附注	56
8 基金份额持有人信息	57

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末上市基金前十名持有人	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
9	开放式基金份额变动	58
10	重大事件揭示	59
10.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11	影响投资者决策的其他重要信息	60
12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 500ETF
场内简称	国泰中证 500ETF
基金主代码	561350
交易代码	561350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	619,700,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	韩笑微
	联系电话	021-31081600转	010-68858113
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95580
传真		021-31081800	010-68858120
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200082	100808
法定代表人		邱军	刘建军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	13,359,892.77
本期利润	10,658,332.19
加权平均基金份额本期利润	0.0295
本期加权平均净值利润率	3.23%
本期基金份额净值增长率	3.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)

期末可供分配利润	-66,034,084.38
期末可供分配基金份额利润	-0.1066
期末基金资产净值	553,665,915.62
期末基金份额净值	0.8934
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.66%

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

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

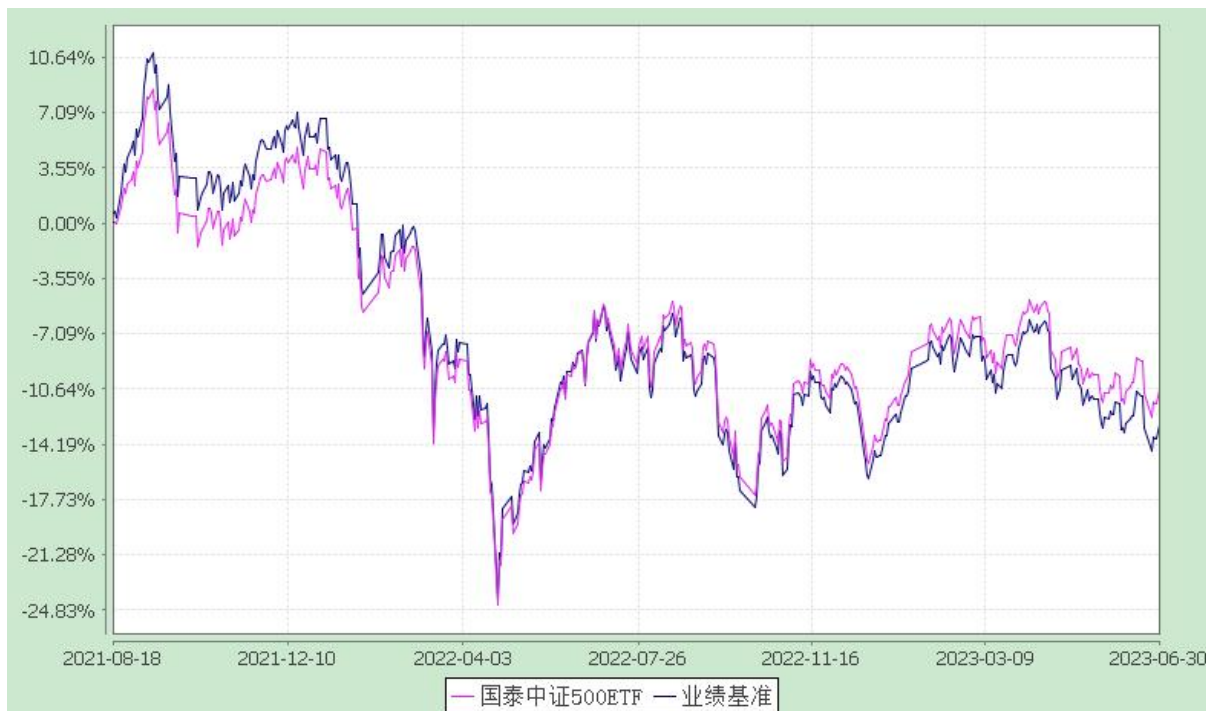
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.08%	0.94%	-0.81%	0.93%	0.73%	0.01%
过去三个月	-4.18%	0.82%	-5.38%	0.83%	1.20%	-0.01%
过去六个月	3.76%	0.78%	2.29%	0.79%	1.47%	-0.01%
过去一年	-4.70%	0.94%	-7.06%	0.96%	2.36%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-10.66%	1.13%	-12.99%	1.16%	2.33%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2021 年 8 月 18 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为 2021 年 8 月 18 日，本基金的建仓期为六个月，在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄岳	国泰中证生物医药 ETF、国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰中证医疗 ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF、国泰中证科创创业 50ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF 发起联接、国泰中证 500ETF、国泰中证科创创业 50ETF 发起联接、国泰中证智能汽车主题 ETF、国泰中证 500ETF 发起联接、国泰中证消费电子主题 ETF、国泰中证消费电子主题 ETF 发起联接、国泰中证沪港深动漫游戏 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰中证港股通 50ETF 发起联接、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证 800 汽车与	2021-08-18	-	8 年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 2 月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、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和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 9 月起兼任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 3 月起兼任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 4 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金和国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证

	零部件 ETF、 国泰中证光伏 产业 ETF 的基 金经理			港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	----------------------------------------	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗

口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度 A 股呈现震荡走势，以 AI 引发了 TMT 板块强劲的结构化行情。春节前 A 股在经济复苏的预期下表现强势，各板块均有所表现。春节后，两会期间全年经济增长目标略不及市场预期，市场憧憬的地产、消费刺激政策也被落空，一季度出口大幅承压，市场对经济增长的预期快速回落，上证 50、创业板等大盘股指数在春节后快速回落。与此同时，ChatGPT 引发的 AI 技术浪潮带动相关板块大幅上涨，计算机、通信、传媒等板块表现出色。

二季度市场延续了结构性行情的特征。人工智能相关板块走弱，4 月中特估接棒引领市场震荡上行，在金融股的带动下，上证指数在 5 月突破了 3400 点大关。然而随着经济数据的持续承压，市场预期逐渐转向悲观，从一季度的强预期弱现实逐渐转入了弱预期弱现实的交易中，消费、新能源、医药、地产等经济相关度较高的板块在整个二季度表现疲软。5 月中特估行情快速退潮，市场出现整体调整。6 月人工智能卷土重来，市场震荡筑底。

作为指数基金，本基金旨在为看好中盘股的投资者提供投资工具。本报告期内，我们根据对市场行情、日常申赎情况和成份股停复牌的分析判断，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平，尽量为投资者提供更精准的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 3.76%，同期业绩比较基准收益率为 2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

中证 500 估值水平处于历史低位，配置性价比凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,859,803.40	2,486,460.55
结算备付金		807,096.26	177,157.02
存出保证金		504,520.64	233,521.48
交易性金融资产	6.4.7.2	548,982,162.70	171,982,299.45
其中：股票投资		548,982,162.70	171,947,298.99
基金投资		-	-
债券投资		-	35,000.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,110,621.78	346,048.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		554,264,204.78	175,225,487.18
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	6,132.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		165,982.41	77,851.58
应付托管费		33,196.47	15,570.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	399,110.28	601,562.37
负债合计		598,289.16	701,117.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	619,700,000.00	202,700,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-66,034,084.38	-28,175,629.86
净资产合计		553,665,915.62	174,524,370.14
负债和净资产总计		554,264,204.78	175,225,487.18

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8934 元，基金份额总额 619,700,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,726,206.40	-20,868,240.92
1.利息收入		24,151.97	40,170.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,151.97	38,800.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	1,370.37
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,066,944.22	-28,184,006.02

其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,546,556.13	-30,249,544.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,866.77	36,807.14
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	4,491,521.32	2,028,730.97
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-2,701,560.58	6,525,188.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	336,670.79	750,405.46
减：二、营业总支出		1,067,874.21	668,050.61
1. 管理人报酬		819,554.68	482,316.47
2. 托管费		163,910.95	96,463.25
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.10	5.11
8. 其他费用	6.4.7.16	84,408.48	89,265.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,658,332.19	-21,536,291.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,658,332.19	-21,536,291.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,658,332.19	-21,536,291.53

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	202,700,000.00	-28,175,629.86	174,524,370.14
二、本期期初净	202,700,000.00	-28,175,629.86	174,524,370.14

资产（基金净值）			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	417,000,000.00	-37,858,454.52	379,141,545.48
（一）、综合收益总额	-	10,658,332.19	10,658,332.19
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	417,000,000.00	-48,516,786.71	368,483,213.29
其中：1.基金申购款	1,038,000,000.00	-95,519,741.32	942,480,258.68
2.基金赎回款	-621,000,000.00	47,002,954.61	-573,997,045.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	619,700,000.00	-66,034,084.38	553,665,915.62
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	256,700,000.00	12,121,699.55	268,821,699.55
二、本期期初净资产（基金净值）	256,700,000.00	12,121,699.55	268,821,699.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,000,000.00	-26,480,459.81	-53,480,459.81
（一）、综合收益总额	-	-21,536,291.53	-21,536,291.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-27,000,000.00	-4,944,168.28	-31,944,168.28
其中：1.基金申购款	672,000,000.00	-79,627,552.00	592,372,448.00

2.基金赎回款	-699,000,000.00	74,683,383.72	-624,316,616.28
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	229,700,000.00	-14,358,760.26	215,341,239.74

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 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1958 号《关于准予国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 727,700,000.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0821 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 727,700,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]366 号文核准，本基金于 2021 年 9 月 1 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具以及法

律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“国泰中证 500ETF 联接基金”)。国泰中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红

利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,859,803.40
等于：本金	2,858,255.38
加：应计利息	1,548.02
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,859,803.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	557,279,802.53	-	548,982,162.70	-8,297,639.83
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		557,279,802.53	-	548,982,162.70	-8,297,639.83

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	124,412.79
其中：交易所市场	124,412.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
可退替代款	74,099.18
应付替代款	116,295.75
合计	399,110.28

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

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

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,700,000.00	202,700,000.00
本期申购	1,038,000,000.00	1,038,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-621,000,000.00	-621,000,000.00
本期末	619,700,000.00	619,700,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,203,766.41	-8,971,863.45	-28,175,629.86
本期利润	13,359,892.77	-2,701,560.58	10,658,332.19
本期基金份额交易产生的变动数	-28,717,196.64	-19,799,590.07	-48,516,786.71
其中：基金申购款	-69,037,233.28	-26,482,508.04	-95,519,741.32
基金赎回款	40,320,036.64	6,682,917.97	47,002,954.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,561,070.28	-31,473,014.10	-66,034,084.38

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	6,728.25
其他	2,672.73
合计	24,151.97

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,303,616.69
股票投资收益——赎回差价收入	2,242,939.44
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	9,546,556.13

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	328,821,472.83
减：卖出股票成本总额	320,944,281.94
减：交易费用	573,574.20
买卖股票差价收入	7,303,616.69

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	573,997,045.39
减：现金支付赎回款总额	278,525,611.39
减：赎回股票成本总额	293,228,494.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,242,939.44

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	22.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,844.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	28,866.77

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	131,873.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	103,000.00
减：应计利息总额	23.52
减：交易费用	5.27
买卖债券差价收入	28,844.54

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,491,521.32
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	4,491,521.32

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-2,701,560.58
——股票投资	-2,701,560.58
——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	-2,701,560.58
----	---------------

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

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	336,670.79
合计	336,670.79

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	105.92
合计	84,408.48

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰中证 500ETF 发起联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
国泰基金管理有限公司	基金管理人
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	819,554.68	482,316.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	163,910.95	96,463.25

注：支付基金托管人中国邮政储蓄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

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

6.4.10.4 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

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰中证 500ETF 发起联接	17,225,716.00	2.78%	15,378,717.00	7.59%

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	2,859,803.40	14,750.99	6,951,667.28	26,337.30

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	网下中签流通受限	39.78	39.78	2,288.00	91,016.64	91,016.64	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	网下中签流通受限	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	网下中签流通受限	25.82	25.82	2,491.00	64,317.62	64,317.62	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.86	18.06	2,518.00	50,007.48	45,475.08	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.60	9.41	3,767.00	36,163.20	35,447.47	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.60	64.67	436.00	10,289.60	28,196.12	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.10	17.04	1,405.00	15,595.50	23,941.20	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.69	5.41	3,837.00	21,832.53	20,758.17	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-

688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	75.00	90.76	171.00	12,825.00	15,519.96	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	21.17	23.50	574.00	12,151.58	13,489.00	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	14.59	894.00	9,994.92	13,043.46	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	125.80	118.03	103.00	12,957.40	12,157.09	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.68	12.34	967.00	10,327.56	11,932.78	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月以上	新股锁定流通受限	43.67	53.05	222.00	9,694.74	11,777.10	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.81	13.73	853.00	12,632.93	11,711.69	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.92	19.16	610.00	12,761.20	11,687.60	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.00	8.96	1,184.00	5,920.00	10,608.64	-
68857	天玛	2023-0	6 个月	新股	30.26	25.33	404.00	12,225	10,233	-

0	智控	5-29	以上	锁定 流通 受限				.04	.32	
301488	豪恩 汽电	2023-06-26	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	39.78	39.78	255.00	10,143.90	10,143.90	-
688334	西高 院	2023-06-09	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	14.16	16.21	622.00	8,807.52	10,082.62	-
688429	时创 能源	2023-06-20	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-
301323	新莱 福	2023-05-29	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	39.06	39.36	222.00	8,671.32	8,737.92	-
301295	美硕 科技	2023-06-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301261	恒工 精密	2023-06-29	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
688479	友车 科技	2023-05-04	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	33.99	29.49	247.00	8,395.53	7,284.03	-
688478	晶升 股份	2023-04-13	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	32.52	42.37	169.00	5,495.88	7,160.53	-
301202	朗威 股份	2023-06-28	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	25.82	25.82	277.00	7,152.14	7,152.14	-
301337	亚华 电子	2023-05-16	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪 恒通	2023-05-10	6 个月 以上	新股 锁定	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-

				流通受限						
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.99	36.71	151.00	6,038.49	5,543.21	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.10	12.07	421.00	5,094.10	5,081.47	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	35.00	51.23	91.00	3,185.00	4,661.93	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.66	31.50	146.00	3,892.36	4,599.00	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.58	7.58	503.00	3,309.74	3,812.74	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	46.13	34.40	98.00	4,520.74	3,371.20	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.99	16.90	187.00	3,738.13	3,160.30	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	73.45	46.64	50.00	3,672.50	2,332.00	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.90	17.09	130.00	2,067.00	2,221.70	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定流通	11.66	12.26	165.00	1,923.90	2,022.90	-

				受限						
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.68	25.49	63.00	1,302.84	1,605.87	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.38	14.87	105.00	1,614.90	1,561.35	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	25.98	24.53	54.00	1,402.92	1,324.62	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.48	39.48	33.00	1,467.84	1,302.84	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	57,900.00	379,171.64	403,563.00	-

注：本基金截至 2023 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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是通过紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.02%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,859,803.40	-	-	-	2,859,803.40
结算备付金	807,096.26	-	-	-	807,096.26
存出保证金	504,520.64	-	-	-	504,520.64
交易性金融资产	-	-	-	548,982,162.70	548,982,162.70
应收清算款	-	-	-	1,110,621.78	1,110,621.78
资产总计	4,171,420.30	-	-	550,092,784.48	554,264,204.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	165,982.41	165,982.41
应付托管费	-	-	-	33,196.47	33,196.47
其他负债	-	-	-	399,110.28	399,110.28
负债总计	-	-	-	598,289.16	598,289.16
利率敏感度缺口	4,171,420.30	-	-	549,494,495.32	553,665,915.62
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,486,460.55	-	-	-	2,486,460.55
结算备付金	177,157.02	-	-	-	177,157.02
存出保证金	233,521.48	-	-	-	233,521.48

交易性金融资产	-	-	35,000.46	171,947,298.99	171,982,299.45
应收清算款	-	-	-	346,048.68	346,048.68
资产总计	2,897,139.05	-	35,000.46	172,293,347.67	175,225,487.18
负债					
应付清算款	-	-	-	6,132.73	6,132.73
应付管理人报酬	-	-	-	77,851.58	77,851.58
应付托管费	-	-	-	15,570.34	15,570.34
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	601,562.37	601,562.37
负债总计	-	-	-	701,117.04	701,117.04
利率敏感度缺口	2,897,139.05	-	35,000.46	171,592,230.63	174,524,370.14

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.02%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多

种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	548,982,162.70	99.15	171,947,298.99	98.52
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	548,982,162.70	99.15	171,947,298.99	98.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,713	增加约 849
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,713	减少约 849

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	547,881,904.36	170,841,226.10
第二层次	659,605.64	698,633.46
第三层次	440,652.70	442,439.89
合计	548,982,162.70	171,982,299.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 942,480,258.68 元，其中包括以股票支付的申购款 460,975,273.18 元和以现金支付的申购款 481,504,985.50 元。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	548,982,162.70	99.05
	其中：股票	548,982,162.70	99.05
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	3,666,899.66	0.66
8	其他各项资产	1,615,142.42	0.29
9	合计	554,264,204.78	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,841,145.00	0.69
B	采矿业	20,363,376.02	3.68
C	制造业	341,171,067.62	61.62

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,822,804.55	3.40
E	建筑业	6,118,303.75	1.11
F	批发和零售业	17,133,951.91	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	8,179,318.46	1.48
H	住宿和餐饮业	1,070,675.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,296,762.52	8.36
J	金融业	46,585,266.86	8.41
K	房地产业	7,419,336.57	1.34
L	租赁和商务服务业	6,690,161.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	5,961,944.80	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	3,041,620.09	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,668,815.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	7,743,939.00	1.40
S	综合	2,862,737.00	0.52
	合计	545,971,225.15	98.61

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,730.00	0.00
C	制造业	1,111,318.80	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	580,173.47	0.10
E	建筑业	837,212.60	0.15
F	批发和零售业	3,812.74	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	106,560.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,933.05	0.01

J	金融业	265,856.00	0.05
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	25,186.83	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	3,371.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,010,937.55	0.54

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

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	300308	中际旭创	55,400	8,168,730.00	1.48
2	688256	寒武纪	26,300	4,944,400.00	0.89
3	000988	华工科技	81,000	3,078,810.00	0.56
4	002422	科伦药业	97,500	2,893,800.00	0.52
5	688777	中控技术	45,782	2,874,193.96	0.52
6	002340	格林美	410,400	2,835,864.00	0.51
7	002384	东山精密	106,700	2,763,530.00	0.50
8	600372	中航电子	180,424	2,738,836.32	0.49
9	300012	华测检测	138,100	2,692,950.00	0.49
10	300418	昆仑万维	64,800	2,610,144.00	0.47
11	688099	晶晨股份	30,428	2,565,688.96	0.46
12	600079	人福医药	95,100	2,561,994.00	0.46
13	600157	永泰能源	1,787,200	2,537,824.00	0.46
14	300724	捷佳伟创	21,600	2,426,760.00	0.44
15	600489	中金黄金	228,700	2,362,471.00	0.43
16	300003	乐普医疗	104,200	2,355,962.00	0.43
17	600487	亨通光电	159,400	2,336,804.00	0.42
18	601058	赛轮轮胎	198,500	2,260,915.00	0.41
19	601555	东吴证券	323,360	2,244,118.40	0.41
20	002738	中矿资源	43,800	2,231,172.00	0.40

21	000066	中国长城	158,400	2,190,672.00	0.40
22	002463	沪电股份	104,500	2,188,230.00	0.40
23	600765	中航重机	81,880	2,170,638.80	0.39
24	300037	新宙邦	41,400	2,148,246.00	0.39
25	002028	思源电气	45,800	2,139,776.00	0.39
26	600536	中国软件	45,097	2,114,147.36	0.38
27	000807	云铝股份	165,400	2,105,542.00	0.38
28	600885	宏发股份	64,620	2,058,147.00	0.37
29	000423	东阿阿胶	38,300	2,047,135.00	0.37
30	688521	芯原股份	28,337	2,037,997.04	0.37
31	600563	法拉电子	14,500	1,990,850.00	0.36
32	000009	中国宝安	164,600	1,986,722.00	0.36
33	600482	中国动力	84,599	1,983,000.56	0.36
34	688220	翱捷科技	26,300	1,982,757.00	0.36
35	002850	科达利	14,900	1,970,525.00	0.36
36	300146	汤臣倍健	81,700	1,959,166.00	0.35
37	300058	蓝色光标	201,500	1,948,505.00	0.35
38	600352	浙江龙盛	206,900	1,934,515.00	0.35
39	002966	苏州银行	290,710	1,904,150.50	0.34
40	603688	石英股份	16,700	1,901,128.00	0.34
41	601108	财通证券	261,180	1,890,943.20	0.34
42	002156	通富微电	83,600	1,889,360.00	0.34
43	002185	华天科技	205,000	1,886,000.00	0.34
44	600415	小商品城	220,700	1,882,571.00	0.34
45	002625	光启技术	121,500	1,854,090.00	0.33
46	600988	赤峰黄金	136,500	1,837,290.00	0.33
47	601233	桐昆股份	138,300	1,832,475.00	0.33
48	600027	华电国际	269,900	1,805,631.00	0.33
49	300073	当升科技	35,800	1,801,814.00	0.33
50	300144	宋城演艺	145,200	1,800,480.00	0.33
51	002624	完美世界	106,200	1,793,718.00	0.32
52	000783	长江证券	308,700	1,790,460.00	0.32
53	600109	国金证券	206,100	1,786,887.00	0.32
54	300395	菲利华	36,200	1,781,040.00	0.32
55	600418	江淮汽车	141,200	1,777,708.00	0.32
56	601077	渝农商行	492,900	1,769,511.00	0.32
57	300568	星源材质	102,500	1,761,975.00	0.32
58	002240	盛新锂能	55,200	1,759,224.00	0.32
59	002385	大北农	265,400	1,751,640.00	0.32
60	600096	云天化	102,600	1,751,382.00	0.32
61	300604	长川科技	36,800	1,747,632.00	0.32
62	600161	天坛生物	64,100	1,740,315.00	0.31
63	300285	国瓷材料	63,100	1,728,940.00	0.31
64	300474	景嘉微	19,150	1,723,308.50	0.31

65	002497	雅化集团	96,200	1,710,436.00	0.31
66	000630	铜陵有色	591,300	1,708,857.00	0.31
67	002008	大族激光	65,000	1,703,000.00	0.31
68	002439	启明星辰	56,500	1,681,440.00	0.30
69	300024	机器人	100,520	1,675,668.40	0.30
70	002407	多氟多	84,200	1,672,212.00	0.30
71	600298	安琪酵母	45,400	1,643,934.00	0.30
72	601162	天风证券	551,230	1,642,665.40	0.30
73	601168	西部矿业	156,000	1,639,560.00	0.30
74	603882	金域医学	21,600	1,630,800.00	0.29
75	002223	鱼跃医疗	45,300	1,630,347.00	0.29
76	600862	中航高科	64,400	1,629,964.00	0.29
77	600705	中航产融	424,200	1,624,686.00	0.29
78	000933	神火股份	124,800	1,622,400.00	0.29
79	000975	银泰黄金	137,300	1,606,410.00	0.29
80	002409	雅克科技	21,900	1,596,072.00	0.29
81	300390	天华新能	44,570	1,595,606.00	0.29
82	300136	信维通信	79,200	1,590,336.00	0.29
83	603596	伯特利	19,900	1,577,274.00	0.28
84	000932	华菱钢铁	330,100	1,574,577.00	0.28
85	300866	安克创新	17,900	1,566,250.00	0.28
86	002600	领益智造	225,300	1,556,823.00	0.28
87	000021	深科技	77,700	1,553,223.00	0.28
88	605358	立昂微	42,200	1,550,006.00	0.28
89	600066	宇通客车	104,600	1,541,804.00	0.28
90	002368	太极股份	37,300	1,535,641.00	0.28
91	002797	第一创业	267,900	1,532,388.00	0.28
92	600060	海信视像	61,900	1,532,025.00	0.28
93	603816	顾家家居	39,860	1,520,659.00	0.27
94	002138	顺络电子	63,300	1,513,503.00	0.27
95	300253	卫宁健康	139,800	1,512,636.00	0.27
96	002568	百润股份	41,600	1,512,160.00	0.27
97	601128	常熟银行	221,700	1,511,994.00	0.27
98	002465	海格通信	145,900	1,508,606.00	0.27
99	600839	四川长虹	298,600	1,507,930.00	0.27
100	600879	航天电子	177,200	1,504,428.00	0.27
101	300487	蓝晓科技	24,100	1,504,322.00	0.27
102	000591	太阳能	221,400	1,501,092.00	0.27
103	603939	益丰药房	40,420	1,495,540.00	0.27
104	600486	扬农化工	17,101	1,494,969.42	0.27
105	688002	睿创微纳	33,342	1,493,721.60	0.27
106	600392	盛和资源	115,777	1,490,049.99	0.27
107	002078	太阳纸业	137,800	1,473,082.00	0.27
108	300118	东方日升	57,400	1,471,162.00	0.27

109	601990	南京证券	179,000	1,464,220.00	0.26
110	000683	远兴能源	203,600	1,463,884.00	0.26
111	688385	复旦微电	29,182	1,462,018.20	0.26
112	600873	梅花生物	163,600	1,460,948.00	0.26
113	600160	巨化股份	105,800	1,457,924.00	0.26
114	000729	燕京啤酒	116,788	1,456,346.36	0.26
115	601696	中银证券	136,600	1,456,156.00	0.26
116	600497	驰宏锌锗	285,776	1,434,595.52	0.26
117	688567	孚能科技	65,614	1,416,606.26	0.26
118	300017	网宿科技	198,900	1,414,179.00	0.26
119	600177	雅戈尔	222,276	1,402,561.56	0.25
120	600516	方大炭素	225,437	1,397,709.40	0.25
121	002673	西部证券	218,800	1,389,380.00	0.25
122	600642	申能股份	198,700	1,388,913.00	0.25
123	600699	均胜电子	78,700	1,388,268.00	0.25
124	600521	华海药业	74,900	1,378,909.00	0.25
125	600141	兴发集团	61,900	1,375,418.00	0.25
126	300832	新产业	23,300	1,374,700.00	0.25
127	002430	杭氧股份	40,000	1,374,400.00	0.25
128	300699	光威复材	44,380	1,369,123.00	0.25
129	000738	航发控制	56,100	1,368,840.00	0.25
130	002025	航天电器	21,400	1,365,320.00	0.25
131	600325	华发股份	137,900	1,358,315.00	0.25
132	000728	国元证券	207,600	1,353,552.00	0.24
133	000629	钒钛股份	345,700	1,351,687.00	0.24
134	689009	九号公司	36,660	1,350,921.00	0.24
135	002294	信立泰	43,200	1,347,408.00	0.24
136	000400	许继电气	58,400	1,346,120.00	0.24
137	002532	天山铝业	224,100	1,342,359.00	0.24
138	600170	上海建工	497,600	1,338,544.00	0.24
139	002195	二三四五	463,100	1,338,359.00	0.24
140	601966	玲珑轮胎	59,700	1,326,534.00	0.24
141	600153	建发股份	121,300	1,323,383.00	0.24
142	000831	中国稀土	44,700	1,323,120.00	0.24
143	600166	福田汽车	384,200	1,306,280.00	0.24
144	300682	朗新科技	56,100	1,306,008.00	0.24
145	002281	光迅科技	35,100	1,301,859.00	0.24
146	002739	万达电影	103,700	1,300,398.00	0.23
147	002444	巨星科技	59,200	1,295,296.00	0.23
148	002372	伟星新材	62,800	1,289,912.00	0.23
149	002273	水晶光电	107,800	1,287,132.00	0.23
150	600637	东方明珠	163,870	1,281,463.40	0.23
151	600143	金发科技	146,700	1,280,691.00	0.23
152	002065	东华软件	181,400	1,280,684.00	0.23

153	000998	隆平高科	83,400	1,280,190.00	0.23
154	300595	欧普康视	42,200	1,274,018.00	0.23
155	300383	光环新网	118,100	1,269,575.00	0.23
156	600399	抚顺特钢	124,300	1,267,860.00	0.23
157	601198	东兴证券	157,800	1,265,556.00	0.23
158	600118	中国卫星	44,600	1,258,166.00	0.23
159	002131	利欧股份	545,400	1,254,420.00	0.23
160	688116	天奈科技	27,400	1,253,550.00	0.23
161	603589	口子窖	25,400	1,253,490.00	0.23
162	601577	长沙银行	161,200	1,250,912.00	0.23
163	600021	上海电力	116,100	1,250,397.00	0.23
164	002268	电科网安	44,800	1,248,576.00	0.23
165	002595	豪迈科技	35,500	1,247,115.00	0.23
166	000960	锡业股份	80,200	1,247,110.00	0.23
167	603000	人民网	42,700	1,246,840.00	0.23
168	600549	厦门钨业	65,430	1,245,132.90	0.22
169	000623	吉林敖东	77,400	1,241,496.00	0.22
170	300001	特锐德	59,500	1,236,410.00	0.22
171	600859	王府井	62,400	1,234,896.00	0.22
172	002432	九安医疗	34,900	1,228,829.00	0.22
173	601997	贵阳银行	237,500	1,225,500.00	0.22
174	600704	物产中大	247,956	1,224,902.64	0.22
175	600380	健康元	96,000	1,220,160.00	0.22
176	000703	恒逸石化	179,300	1,215,654.00	0.22
177	000997	新大陆	64,200	1,213,380.00	0.22
178	002192	融捷股份	18,100	1,209,623.00	0.22
179	600481	双良节能	86,300	1,206,474.00	0.22
180	300676	华大基因	20,100	1,205,799.00	0.22
181	300088	长信科技	199,700	1,204,191.00	0.22
182	600499	科达制造	106,000	1,204,160.00	0.22
183	603737	三棵树	18,360	1,201,111.20	0.22
184	603077	和邦生物	493,400	1,198,962.00	0.22
185	600867	通化东宝	114,800	1,198,512.00	0.22
186	600998	九州通	115,216	1,195,942.08	0.22
187	603233	大参林	42,579	1,192,637.79	0.22
188	688009	中国通号	205,123	1,189,713.40	0.21
189	600498	烽火通信	58,400	1,189,608.00	0.21
190	000636	风华高科	77,200	1,184,248.00	0.21
191	300212	易华录	35,500	1,179,665.00	0.21
192	002152	广电运通	100,600	1,179,032.00	0.21
193	002203	海亮股份	98,100	1,178,181.00	0.21
194	600271	航天信息	85,800	1,174,602.00	0.21
195	603893	瑞芯微	16,100	1,172,885.00	0.21
196	002373	千方科技	85,900	1,171,676.00	0.21

197	000519	中兵红箭	64,700	1,170,423.00	0.21
198	002080	中材科技	56,800	1,165,536.00	0.21
199	600546	山煤国际	80,300	1,161,941.00	0.21
200	603712	七一二	38,400	1,160,064.00	0.21
201	002507	涪陵榨菜	63,260	1,158,290.60	0.21
202	002056	横店东磁	63,600	1,158,156.00	0.21
203	002531	天顺风能	76,000	1,157,480.00	0.21
204	002299	圣农发展	60,400	1,156,660.00	0.21
205	002353	杰瑞股份	46,000	1,155,980.00	0.21
206	688772	珠海冠宇	56,900	1,146,535.00	0.21
207	600348	华阳股份	144,050	1,139,435.50	0.21
208	300438	鹏辉能源	23,700	1,138,548.00	0.21
209	600529	山东药玻	41,700	1,135,074.00	0.21
210	603338	浙江鼎力	20,200	1,131,402.00	0.20
211	601016	节能风电	307,890	1,129,956.30	0.20
212	600580	卧龙电驱	76,900	1,123,509.00	0.20
213	002683	广东宏大	37,900	1,115,776.00	0.20
214	300748	金力永磁	36,900	1,104,048.00	0.20
215	600739	辽宁成大	83,800	1,101,970.00	0.20
216	600535	天士力	75,500	1,095,505.00	0.20
217	600863	内蒙华电	263,100	1,091,865.00	0.20
218	600655	豫园股份	159,100	1,091,426.00	0.20
219	601636	旗滨集团	126,500	1,090,430.00	0.20
220	002506	协鑫集成	372,100	1,090,253.00	0.20
221	000878	云南铜业	98,600	1,089,530.00	0.20
222	600820	隧道股份	179,300	1,077,593.00	0.19
223	600416	湘电股份	56,300	1,074,767.00	0.19
224	600258	首旅酒店	56,500	1,070,675.00	0.19
225	600970	中材国际	83,565	1,065,453.75	0.19
226	002092	中泰化学	165,000	1,064,250.00	0.19
227	300296	利亚德	162,700	1,062,431.00	0.19
228	300182	捷成股份	166,800	1,052,508.00	0.19
229	600909	华安证券	224,800	1,049,816.00	0.19
230	603267	鸿远电子	15,900	1,038,270.00	0.19
231	300244	迪安诊断	40,500	1,038,015.00	0.19
232	002926	华西证券	124,800	1,037,088.00	0.19
233	603456	九洲药业	37,800	1,034,964.00	0.19
234	603885	吉祥航空	66,940	1,032,884.20	0.19
235	600528	中铁工业	104,500	1,032,460.00	0.19
236	603444	吉比特	2,100	1,031,331.00	0.19
237	002939	长城证券	126,600	1,029,258.00	0.19
238	000750	国海证券	305,800	1,024,430.00	0.19
239	000547	航天发展	102,300	1,023,000.00	0.18
240	600511	国药股份	26,282	1,021,055.70	0.18

241	000513	丽珠集团	26,200	1,019,442.00	0.18
242	000970	中科三环	79,445	1,018,484.90	0.18
243	000830	鲁西化工	96,300	1,016,928.00	0.18
244	600008	首创环保	349,000	1,005,120.00	0.18
245	000039	中集集团	145,800	1,004,562.00	0.18
246	002429	兆驰股份	182,400	1,003,200.00	0.18
247	002128	电投能源	75,800	1,002,076.00	0.18
248	603156	养元饮品	40,500	1,000,350.00	0.18
249	603658	安图生物	19,300	998,389.00	0.18
250	601991	大唐发电	299,900	992,669.00	0.18
251	000893	亚钾国际	43,200	991,008.00	0.18
252	002508	老板电器	39,100	988,839.00	0.18
253	000060	中金岭南	207,500	985,625.00	0.18
254	603160	汇顶科技	21,300	985,125.00	0.18
255	600329	达仁堂	21,800	978,602.00	0.18
256	603517	绝味食品	26,300	977,045.00	0.18
257	600390	五矿资本	180,800	972,704.00	0.18
258	603927	中科软	25,200	971,712.00	0.18
259	300009	安科生物	97,100	971,000.00	0.18
260	600369	西南证券	266,000	970,900.00	0.18
261	300558	贝达药业	20,200	970,206.00	0.18
262	002572	索菲亚	55,200	961,584.00	0.17
263	600398	海澜之家	139,600	960,448.00	0.17
264	601717	郑煤机	76,700	954,915.00	0.17
265	300070	碧水源	178,100	954,616.00	0.17
266	600435	北方导航	82,725	950,510.25	0.17
267	002500	山西证券	170,000	948,600.00	0.17
268	002557	洽洽食品	22,800	947,340.00	0.17
269	601880	辽港股份	607,200	947,232.00	0.17
270	300776	帝尔激光	14,560	944,944.00	0.17
271	002936	郑州银行	410,690	944,587.00	0.17
272	603026	胜华新材	15,900	942,075.00	0.17
273	600848	上海临港	78,320	935,924.00	0.17
274	600985	淮北矿业	80,400	926,208.00	0.17
275	002791	坚朗五金	14,300	925,353.00	0.17
276	300529	健帆生物	39,600	917,928.00	0.17
277	000050	深天马 A	99,900	917,082.00	0.17
278	300026	红日药业	166,500	902,430.00	0.16
279	002153	石基信息	63,830	893,620.00	0.16
280	688779	长远锂科	79,076	891,186.52	0.16
281	601456	国联证券	97,800	889,980.00	0.16
282	002244	滨江集团	100,700	888,174.00	0.16
283	600038	中直股份	22,300	887,986.00	0.16
284	688208	道通科技	29,295	887,931.45	0.16

285	002408	齐翔腾达	139,160	886,449.20	0.16
286	601179	中国西电	163,200	882,912.00	0.16
287	603858	步长制药	42,700	879,193.00	0.16
288	601958	金铂股份	78,800	878,620.00	0.16
289	600673	东阳光	121,500	876,015.00	0.16
290	002019	亿帆医药	59,900	874,540.00	0.16
291	003035	南网能源	121,900	867,928.00	0.16
292	600667	太极实业	119,300	866,118.00	0.16
293	688169	石头科技	2,700	865,836.00	0.16
294	000155	川能动力	60,000	864,000.00	0.16
295	600316	洪都航空	36,800	862,960.00	0.16
296	603127	昭衍新药	21,052	861,026.80	0.16
297	300373	扬杰科技	21,200	860,084.00	0.16
298	002266	浙富控股	207,800	858,214.00	0.16
299	600895	张江高科	61,407	854,785.44	0.15
300	688006	杭可科技	27,906	850,295.82	0.15
301	600208	新湖中宝	341,800	847,664.00	0.15
302	300677	英科医疗	38,500	847,000.00	0.15
303	601000	唐山港	239,300	844,729.00	0.15
304	002670	国盛金控	96,200	844,636.00	0.15
305	002958	青农商行	309,600	842,112.00	0.15
306	688538	和辉光电	331,149	841,118.46	0.15
307	600827	百联股份	62,830	840,037.10	0.15
308	601231	环旭电子	56,000	837,760.00	0.15
309	688390	固德威	4,994	833,298.84	0.15
310	600282	南钢股份	245,100	825,987.00	0.15
311	000887	中鼎股份	62,500	818,125.00	0.15
312	300888	稳健医疗	19,620	817,565.40	0.15
313	600959	江苏有线	241,100	814,918.00	0.15
314	600755	厦门国贸	105,000	812,700.00	0.15
315	601666	平煤股份	107,700	812,058.00	0.15
316	600378	昊华科技	21,300	801,732.00	0.14
317	600131	国网信通	39,500	797,505.00	0.14
318	002030	达安基因	79,920	796,802.40	0.14
319	002032	苏泊尔	15,900	795,000.00	0.14
320	600171	上海贝岭	43,500	793,875.00	0.14
321	600582	天地科技	136,052	793,183.16	0.14
322	601866	中远海发	321,100	793,117.00	0.14
323	002155	湖南黄金	65,000	793,000.00	0.14
324	000739	普洛药业	44,700	792,978.00	0.14
325	600517	国网英大	139,000	792,300.00	0.14
326	300251	光线传媒	97,300	787,157.00	0.14
327	002985	北摩高科	17,770	784,012.40	0.14
328	300357	我武生物	23,300	783,579.00	0.14

329	002249	大洋电机	137,400	783,180.00	0.14
330	600598	北大荒	58,700	782,471.00	0.14
331	600056	中国医药	60,220	781,655.60	0.14
332	000598	兴蓉环境	143,300	778,119.00	0.14
333	603218	日月股份	40,900	776,691.00	0.14
334	002518	科士达	19,400	776,194.00	0.14
335	000027	深圳能源	117,575	774,819.25	0.14
336	300115	长盈精密	65,000	774,150.00	0.14
337	000987	越秀资本	121,355	770,604.25	0.14
338	000778	新兴铸管	188,700	769,896.00	0.14
339	688072	拓荆科技	1,800	766,746.00	0.14
340	688536	思瑞浦	3,500	763,000.00	0.14
341	600373	中文传媒	56,800	756,576.00	0.14
342	300861	美畅股份	17,400	754,638.00	0.14
343	600566	济川药业	25,800	749,232.00	0.14
344	601005	重庆钢铁	534,900	748,860.00	0.14
345	000709	河钢股份	329,600	744,896.00	0.13
346	002221	东华能源	85,800	742,170.00	0.13
347	601106	中国一重	220,700	741,552.00	0.13
348	600906	财达证券	102,800	740,160.00	0.13
349	603826	坤彩科技	14,800	740,000.00	0.13
350	301029	怡合达	16,520	738,113.60	0.13
351	002183	怡亚通	144,600	737,460.00	0.13
352	000883	湖北能源	160,100	730,056.00	0.13
353	002487	大金重工	23,500	724,740.00	0.13
354	601992	金隅集团	331,200	722,016.00	0.13
355	601665	齐鲁银行	182,800	716,576.00	0.13
356	603568	伟明环保	40,759	713,690.09	0.13
357	000825	太钢不锈	183,800	711,306.00	0.13
358	600315	上海家化	24,400	707,844.00	0.13
359	300363	博腾股份	23,900	707,201.00	0.13
360	601778	晶科科技	143,000	706,420.00	0.13
361	688301	奕瑞科技	2,500	706,075.00	0.13
362	600801	华新水泥	56,900	702,715.00	0.13
363	002511	中顺洁柔	63,000	702,450.00	0.13
364	002326	永太科技	45,900	701,811.00	0.13
365	688516	奥特维	3,700	697,080.00	0.13
366	601928	凤凰传媒	60,900	694,260.00	0.13
367	600718	东软集团	65,100	693,966.00	0.13
368	601098	中南传媒	58,700	680,920.00	0.12
369	603225	新凤鸣	61,300	677,365.00	0.12
370	600297	广汇汽车	324,100	674,128.00	0.12
371	600737	中粮糖业	83,678	673,607.90	0.12
372	000156	华数传媒	77,200	671,640.00	0.12

373	002867	周大生	37,400	664,972.00	0.12
374	002468	申通快递	61,300	663,266.00	0.12
375	603529	爱玛科技	20,550	662,121.00	0.12
376	300850	新强联	17,700	661,626.00	0.12
377	603883	老百姓	22,120	660,282.00	0.12
378	600155	华创阳安	106,135	660,159.70	0.12
379	600967	内蒙一机	65,200	658,520.00	0.12
380	600663	陆家嘴	66,600	657,342.00	0.12
381	600500	中化国际	118,070	656,469.20	0.12
382	002690	美亚光电	25,200	648,900.00	0.12
383	001227	兰州银行	226,800	648,648.00	0.12
384	600259	广晟有色	17,900	646,906.00	0.12
385	002745	木林森	70,200	645,840.00	0.12
386	600871	石化油服	324,900	643,302.00	0.12
387	601611	中国核建	75,800	640,510.00	0.12
388	000581	威孚高科	40,500	637,875.00	0.12
389	000012	南玻 A	106,900	637,124.00	0.12
390	002831	裕同科技	26,100	636,579.00	0.11
391	603866	桃李面包	62,704	634,564.48	0.11
392	600062	华润双鹤	36,200	630,604.00	0.11
393	000930	中粮科技	77,500	627,750.00	0.11
394	002250	联化科技	60,000	627,600.00	0.11
395	603228	景旺电子	24,400	625,860.00	0.11
396	601118	海南橡胶	138,800	621,824.00	0.11
397	000401	冀东水泥	83,800	617,606.00	0.11
398	002423	中粮资本	77,000	616,000.00	0.11
399	300482	万孚生物	23,100	615,153.00	0.11
400	600022	山东钢铁	428,800	608,896.00	0.11
401	000785	居然之家	159,500	607,695.00	0.11
402	300618	寒锐钴业	18,591	602,534.31	0.11
403	600556	天下秀	84,500	599,105.00	0.11
404	688200	华峰测控	3,900	596,700.00	0.11
405	600597	光明乳业	57,299	595,909.60	0.11
406	002010	传化智联	111,200	591,584.00	0.11
407	601608	中信重工	139,900	588,979.00	0.11
408	600782	新钢股份	156,500	580,615.00	0.10
409	002505	鹏都农牧	306,500	579,285.00	0.10
410	601598	中国外运	124,300	579,238.00	0.10
411	000089	深圳机场	82,000	569,900.00	0.10
412	000559	万向钱潮	104,400	568,980.00	0.10
413	002081	金螳螂	125,700	566,907.00	0.10
414	600901	江苏租赁	136,857	565,219.41	0.10
415	002761	浙江建投	37,100	563,178.00	0.10
416	600339	中油工程	137,700	560,439.00	0.10

417	600707	彩虹股份	117,400	558,824.00	0.10
418	001914	招商积余	36,700	552,335.00	0.10
419	000958	电投产融	126,700	548,611.00	0.10
420	603650	彤程新材	16,700	547,760.00	0.10
421	600409	三友化工	100,356	546,940.20	0.10
422	300257	开山股份	35,400	537,018.00	0.10
423	600167	联美控股	76,700	534,599.00	0.10
424	000937	冀中能源	83,700	534,006.00	0.10
425	603707	健友股份	39,423	532,210.50	0.10
426	600507	方大特钢	114,700	531,061.00	0.10
427	601718	际华集团	178,200	529,254.00	0.10
428	300442	润泽科技	17,200	529,072.00	0.10
429	000898	鞍钢股份	188,800	524,864.00	0.09
430	688188	柏楚电子	2,780	524,196.80	0.09
431	601187	厦门银行	104,300	523,586.00	0.09
432	000415	渤海租赁	246,700	518,070.00	0.09
433	000967	盈峰环境	102,000	515,100.00	0.09
434	601568	北元集团	97,640	514,562.80	0.09
435	600095	湘财股份	65,500	510,900.00	0.09
436	601156	东航物流	39,200	509,600.00	0.09
437	688289	圣湘生物	30,221	508,921.64	0.09
438	000537	广宇发展	43,239	504,599.13	0.09
439	600808	马钢股份	194,600	500,122.00	0.09
440	000563	陕国投 A	163,700	499,285.00	0.09
441	600764	中国海防	18,330	498,942.60	0.09
442	600968	海油发展	162,300	498,261.00	0.09
443	603638	艾迪精密	24,248	497,568.96	0.09
444	600195	中牧股份	40,700	475,376.00	0.09
445	603379	三美股份	19,860	466,908.60	0.08
446	688082	盛美上海	4,200	463,680.00	0.08
447	002608	江苏国信	60,800	460,256.00	0.08
448	600126	杭钢股份	105,339	457,171.26	0.08
449	000869	张裕 A	14,700	450,702.00	0.08
450	002925	盈趣科技	23,200	450,080.00	0.08
451	002653	海思科	18,900	446,040.00	0.08
452	000402	金融街	98,300	444,316.00	0.08
453	000959	首钢股份	124,200	434,700.00	0.08
454	002705	新宝股份	24,100	434,523.00	0.08
455	001203	大中矿业	38,100	423,291.00	0.08
456	002110	三钢闽光	99,800	421,156.00	0.08
457	688281	华秦科技	2,000	405,000.00	0.07
458	601828	美凯龙	84,400	404,276.00	0.07
459	601298	青岛港	57,900	403,563.00	0.07
460	688778	厦钨新能	8,100	400,950.00	0.07

461	002563	森马服饰	63,400	394,348.00	0.07
462	600377	宁沪高速	40,000	393,200.00	0.07
463	601228	广州港	121,600	392,768.00	0.07
464	688690	纳微科技	9,800	380,730.00	0.07
465	600623	华谊集团	60,800	378,784.00	0.07
466	000031	大悦城	102,700	375,882.00	0.07
467	688276	百克生物	6,000	375,600.00	0.07
468	688029	南微医学	4,580	373,544.80	0.07
469	688520	神州细胞	6,500	368,810.00	0.07
470	600928	西安银行	104,500	367,840.00	0.07
471	600350	山东高速	56,762	361,573.94	0.07
472	600927	永安期货	22,100	359,346.00	0.06
473	603056	德邦股份	23,000	354,660.00	0.06
474	603317	天味食品	23,580	344,503.80	0.06
475	001872	招商港口	19,316	333,587.32	0.06
476	688052	纳芯微	2,100	332,577.00	0.06
477	688107	安路科技	5,800	321,262.00	0.06
478	601139	深圳燃气	43,800	319,302.00	0.06
479	601136	首创证券	22,500	318,825.00	0.06
480	000553	安道麦 A	37,300	314,812.00	0.06
481	688234	天岳先进	4,200	310,548.00	0.06
482	002399	海普瑞	26,200	300,514.00	0.05
483	601969	海南矿业	45,600	300,048.00	0.05
484	002945	华林证券	21,200	290,016.00	0.05
485	600299	安迪苏	35,500	282,935.00	0.05
486	600995	南网储能	25,000	275,250.00	0.05
487	688185	康希诺	3,361	273,921.50	0.05
488	603786	科博达	3,900	256,230.00	0.05
489	601158	重庆水务	43,900	244,084.00	0.04
490	688819	天能股份	6,600	243,144.00	0.04
491	600032	浙江新能	18,600	233,616.00	0.04
492	601869	长飞光纤	5,900	218,359.00	0.04
493	600956	新天绿能	22,800	198,816.00	0.04
494	688105	诺唯赞	5,800	176,842.00	0.03
495	688248	南网科技	4,100	157,399.00	0.03
496	603868	飞科电器	2,300	145,107.00	0.03
497	688295	中复神鹰	3,900	143,052.00	0.03
498	603355	莱克电气	5,560	141,279.60	0.03
499	300741	华宝股份	6,000	128,520.00	0.02
500	002901	大博医疗	2,800	87,024.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601117	中国化学	100,600	832,968.00	0.15
2	600803	新奥股份	28,700	544,726.00	0.10
3	600884	杉杉股份	35,900	543,526.00	0.10
4	600908	无锡银行	49,600	265,856.00	0.05
5	001965	招商公路	11,100	106,560.00	0.02
6	301488	豪恩汽电	2,543	101,160.54	0.02
7	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
8	301202	朗威股份	2,768	71,469.76	0.01
9	688249	晶合集成	2,518	45,475.08	0.01
10	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
11	688361	中科飞测	436	28,196.12	0.01
12	688472	阿特斯	1,405	23,941.20	0.00
13	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
14	688469	中芯集成	3,837	20,758.17	0.00
15	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
16	688458	美芯晟	171	15,519.96	0.00
17	301297	富乐德	671	15,104.21	0.00
18	688552	航天南湖	574	13,489.00	0.00
19	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
20	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
21	688593	新相微	894	13,043.46	0.00
22	688581	安杰思	103	12,157.09	0.00
23	688620	安凯微	967	11,932.78	0.00
24	688543	国科军工	222	11,777.10	0.00
25	301332	德尔玛	853	11,711.69	0.00
26	688512	慧智微	610	11,687.60	0.00
27	301301	川宁生物	1,184	10,608.64	0.00
28	688570	天玛智控	404	10,233.32	0.00
29	688334	西高院	622	10,082.62	0.00
30	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
31	301323	新莱福	222	8,737.92	0.00
32	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
33	688479	友车科技	247	7,284.03	0.00
34	688478	晶升股份	169	7,160.53	0.00
35	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
36	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
37	688484	南芯科技	151	5,543.21	0.00
38	688352	颀中科技	421	5,081.47	0.00
39	688535	华海诚科	91	4,661.93	0.00
40	688433	华曙高科	146	4,599.00	0.00
41	601061	中信金属	503	3,812.74	0.00

42	301203	国泰环保	98	3,371.20	0.00
43	301439	泓淋电力	187	3,160.30	0.00
44	002085	万丰奥威	400	2,772.00	0.00
45	000983	山西焦煤	300	2,730.00	0.00
46	301345	涛涛车业	50	2,332.00	0.00
47	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
48	603137	恒尚节能	130	2,221.70	0.00
49	601133	柏诚股份	165	2,022.90	0.00
50	001328	登康口腔	63	1,605.87	0.00
51	001360	南矿集团	105	1,561.35	0.00
52	603125	常青科技	54	1,324.62	0.00
53	001367	海森药业	33	1,302.84	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	300308	中际旭创	6,955,967.54	3.99
2	002384	东山精密	5,420,134.00	3.11
3	002340	格林美	5,269,589.00	3.02
4	002422	科伦药业	4,953,258.00	2.84
5	300012	华测检测	4,934,120.00	2.83
6	300418	昆仑万维	4,932,221.00	2.83
7	002850	科达利	4,351,112.00	2.49
8	300003	乐普医疗	4,016,017.00	2.30
9	300724	捷佳伟创	3,864,690.00	2.21
10	300073	当升科技	3,784,634.15	2.17
11	000988	华工科技	3,775,653.25	2.16
12	000807	云铝股份	3,632,411.28	2.08
13	002966	苏州银行	3,575,789.00	2.05
14	002497	雅化集团	3,560,988.00	2.04
15	002185	华天科技	3,429,140.00	1.96
16	002625	光启技术	3,410,975.00	1.95
17	002439	启明星辰	3,396,541.00	1.95
18	002385	大北农	3,388,989.00	1.94
19	002624	完美世界	3,344,548.00	1.92
20	300037	新宙邦	3,306,686.00	1.89

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	300418	昆仑万维	4,151,795.00	2.38
2	000999	华润三九	3,712,180.00	2.13
3	002384	东山精密	3,510,193.00	2.01
4	002340	格林美	3,284,216.00	1.88
5	002422	科伦药业	3,151,554.00	1.81
6	002850	科达利	3,086,397.22	1.77
7	300012	华测检测	2,983,790.00	1.71
8	300308	中际旭创	2,939,017.00	1.68
9	002603	以岭药业	2,901,020.58	1.66
10	300073	当升科技	2,510,376.93	1.44
11	300003	乐普医疗	2,490,251.00	1.43
12	300168	万达信息	2,461,169.00	1.41
13	000988	华工科技	2,438,488.00	1.40
14	300724	捷佳伟创	2,331,074.32	1.34
15	002966	苏州银行	2,319,431.00	1.33
16	002624	完美世界	2,298,302.00	1.32
17	000807	云铝股份	2,284,277.00	1.31
18	002497	雅化集团	2,278,495.34	1.31
19	002625	光启技术	2,139,204.00	1.23
20	300390	天华新能	2,128,155.00	1.22

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	532,933,927.61
卖出股票的收入（成交）总额	328,821,472.83

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“昆仑万维”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。

昆仑万维科技股份有限公司本身因通过互动易回复投资者咨询时未能客观、完整地介绍和反映公司相关业务的实际情况、对公司业绩的影响及充分提示相关风险，受到深圳证券交易所监管关注的监督管理措施。

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。

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	504,520.64
2	应收清算款	1,110,621.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,615,142.42

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比 例
2,602	238,162.9 5	540,705,6 84.00	87.25%	61,768,6 00.00	9.97%	17,225,716. 00	2.78%

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	招商证券股份有限公司	182,956,247.00	29.52%
2	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	57,810,100.00	9.33%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	46,285,000.00	7.47%
4	华泰证券股份有限公司	45,780,177.00	7.39%
5	中国中金财富证券有限公司转融通担保证券明细账户	43,719,600.00	7.05%
6	中信证券股份有限公司	24,995,736.00	4.03%
7	中信建投证券有限责任公司	23,560,575.00	3.80%
8	方正证券股份有限公司	22,702,343.00	3.66%
9	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	22,400,000.00	3.61%
10	广发证券股份有限公司	22,382,769.00	3.61%
-	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,225,716.00	2.78%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 18 日）基金份额总额	727,700,000.00
本报告期期初基金份额总额	202,700,000.00
本报告期基金总申购份额	1,038,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	621,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	619,700,000.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	737,769,871.56	86.09%	89,495.49	51.01%	-

长江证券	2	74,730,543.89	8.72%	53,912.36	30.73%	-
东方证券	2	44,428,152.59	5.18%	32,047.16	18.27%	-

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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	131,873.33	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

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	2023年06月21日至2023年06月30日	17,030,619.00	232,280,600.00	66,354,972.00	182,956,247.00	29.52%

	2	2023 年 03 月 21 日至 2023 年 05 月 21 日	-	407,985,268.00	382,989,532.00	24,995,736.00	4.03%
	3	2023 年 03 月 20 日至 2023 年 04 月 03 日	15,000,096.00	205,236,700.00	174,456,619.00	45,780,177.00	7.39%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所或办公场所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

二〇二三年八月三十日