

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

为了更好地满足投资者需求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定自 2023 年 8 月 16 日起调整本基金申购赎回替代金额处理程序，并相应修改招募说明书相关条款。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 8 月 11 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整申购赎回替代金额处理程序的公告》。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
<b>§6 审计报告</b> 19	
6.1 审计意见.....	19
6.2 形成审计意见的基础.....	19
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	20
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	51

8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	51
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	52
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	91
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	93
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	93
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	93
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	94
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	94
8.11 投资组合报告附注.....	94
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>95</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	95
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	95
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	96
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	96
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>96</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>96</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	96
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	97
11.4 基金投资策略的改变.....	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	97
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	97
11.8 其他重大事件.....	99
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>100</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>101</b>
13.1 备查文件目录.....	101
13.2 存放地点.....	101
13.3 查阅方式.....	101

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)
基金简称	国泰标普 500ETF
场内简称	标普 500ETF
基金主代码	159612
交易代码	159612
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 9 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	150,898,651.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 5 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、境外市场基金投资策略。
业绩比较基准	标普 500 指数收益率（经估值汇率调整）
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。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	张姗
	联系电话	021-31081600转	400-61-95555
	电子邮箱	xinxipilu@gfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	400-61-95555
传真		021-31081800	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行 大厦
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼 嘉昱大厦15-20层	深圳市深南大道7088号招商银行 大厦
邮政编码		200082	518040
法定代表人		邱军	缪建民

### 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号, 汇丰中心一座六楼
邮政编码		-

### 2.5 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gfund.com">http://www.gfund.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦 15-20层及基金托管人住所或办公场所

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特 殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,755,795.58	1,000,174.17
本期利润	32,305,603.48	-313,759.34
加权平均基金份额本期利润	0.2528	-0.0036
本期加权平均净值利润率	22.12%	-0.36%
本期基金份额净值增长率	26.75%	-0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	7,566,054.69	-15,592.29
期末可供分配基金份额利润	0.0501	-0.0002
期末基金资产净值	191,212,108.00	85,883,058.71
期末基金份额净值	1.2672	0.9998
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	26.72%	-0.02%

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
过去三个月	9.76%	0.75%	9.73%	0.75%	0.03%	0.00%
过去六个月	5.31%	0.71%	5.06%	0.71%	0.25%	0.00%
过去一年	26.75%	0.85%	26.34%	0.85%	0.41%	0.00%
自基金合同生效起	26.72%	1.12%	23.52%	1.19%	3.20%	-0.07%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

### 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

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)  
 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  
 (2022 年 5 月 9 日至 2023 年 12 月 31 日)

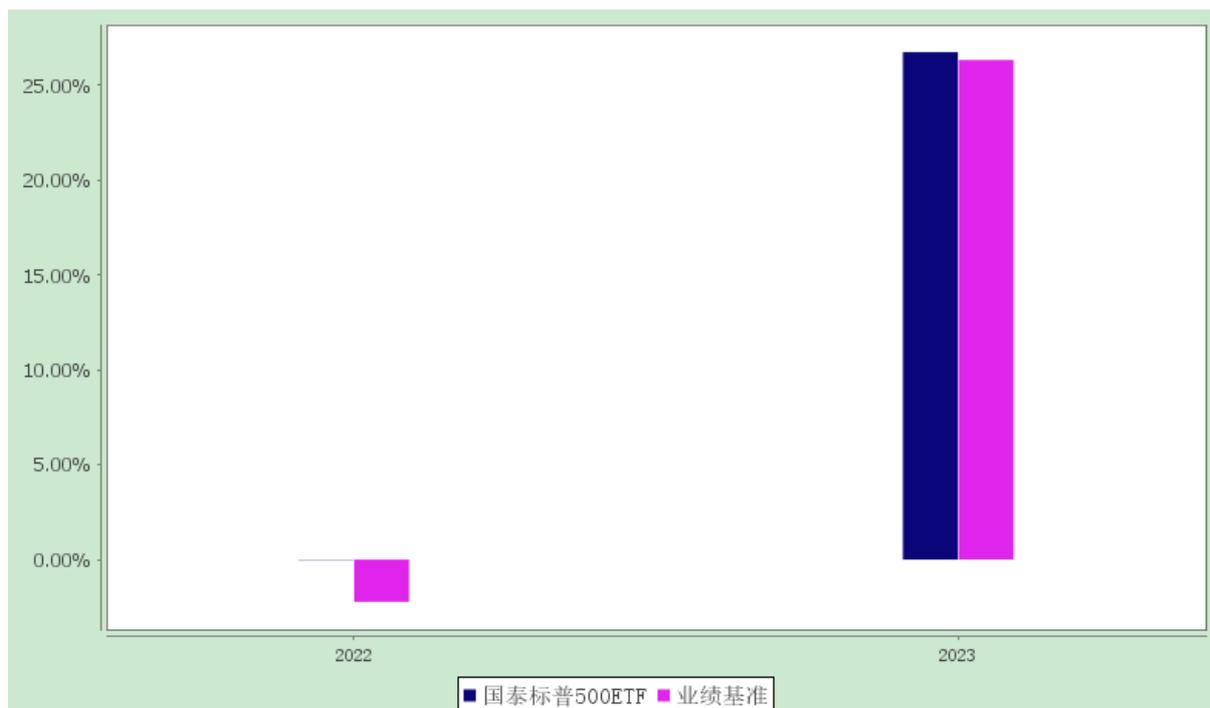


注：（1）本基金的合同生效日为 2022 年 5 月 9 日，在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）同期业绩比较基准以人民币计价。

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

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)  
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：2022 年计算期间为基金合同生效日 2022 年 5 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2022 年 5 月 9 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 260 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
艾小军	国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、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)、国泰中证申万证券行业指数 (LOF)、芯片 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、国泰中证全指证券公司 ETF 联接、国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰标普 500ETF、国泰中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理、投资总监 (量化)、金融工程总监	2023-05-23	-	23 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, 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 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理, 2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 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

				<p>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 月至 2023 年 9 月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 月至 2022 年 3 月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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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 月至 2021 年 1 月任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月起兼任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，2020 年 12 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）的基金经理，2021 年 5 月起兼任国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理，2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程总监。</p>
徐成城	本基金的基金	2022-05-09	2023-05-23	18 年	硕士研究生。曾任职于闽发

	<p>经理</p>			<p>证券。2011 年 11 月加入国泰基金，历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月至 2021 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2017 年 2 月至 2020 年 12 月任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和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，2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2018 年 11 月至 2023 年 5 月任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 12 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金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，2020 年 1 月至 2023 年 5 月任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰中证煤炭交易型开</p>
--	-----------	--	--	--

				<p>放式指数证券投资基金发起式联接基金和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的基金经理，2020 年 2 月至 2023 年 5 月任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月至 2023 年 5 月任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月任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和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的基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰证房地产行业指数证券投资基金(由国泰证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)的基金经理，2021 年 2 月至 2023 年 4 月任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月至 2023 年 5 月任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 5 月任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证动漫游戏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 6 月至 2023 年 6 月任国泰中证有色金属交易</p>
--	--	--	--	---

				<p>型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 7 月至 2023 年 5 月任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，2021 年 8 月至 2023 年 5 月任国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证有色金属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 10 月至 2023 年 4 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 4 月任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，2022 年 5 月至 2023 年 5 月任国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理，2022 年 10 月起兼任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</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法律法规及行业协会的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。

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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

##### (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 $\geq 30$ ），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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

持续超出预期的强劲的就业数据以及居高不下的通胀显示美国经济仍然保持强劲的复苏态势，地区银行的风险事件短期内没有对美国经济带来过大的冲击，美联储货币政策仍以打击通胀为主要目标；另一方面，以 ChatGPT 为代表的各种人工智能大模型的持续推进，包括算力芯片的强劲需求，边缘端模型、应用插件的推出都对科技股形成较强的支撑，受益 AI 大模型的持续演进，大型科技公司纷纷加大 AI 大模型的研发投入，包括 Pika, GPTs 为代表的 AI 应用纷至沓来，AI 科技公司纷纷创出新高，在美国经济保持强劲、科技创新带动下包括纳斯达克、标普 500 等为代表的美国主要股指迭创新高，其中包含主要大型科技股的纳指 100 表现尤为亮眼。

### 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 26.75%，同期业绩比较基准收益率为 26.34%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年我们预计美国通胀仍将保持较高水平，包括产业链重建以及服务业复苏有望支撑就业保持在较高水平，美国经济预计将保持温和复苏态势，最新发布的就业数据显示全职就业水平较低，薪资有下行迹象。在高企的美国国债利率水平下，美国经济复苏的不确定性预计将加大，美联储货币政策开启降息的可能性逐步上升；受益人工智能所带来的科技创新红利，我们预计美国市场表现仍然值得期待，以主要科技股为主的纳指 ETF 尤其值得关注。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司

经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 22593 号

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“国泰标普 500ETF”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了国泰标普 500ETF2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国泰标普 500ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

国泰标普 500ETF 的基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国泰标普 500ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国泰标普 500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督国泰标普 500ETF 的财务报告过程。

### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对导致对国泰标普 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致国泰标普 500ETF 不能持续经营。

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

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

张炯 张晓阳

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	11,261,763.10	3,133,371.84
结算备付金		4.98	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	180,035,975.61	83,837,669.05

其中：股票投资		174,893,817.70	80,907,218.18
基金投资		5,142,157.91	2,930,450.87
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		6,693.15	6,581.55
应收股利		144,312.62	57,070.83
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		191,448,749.46	87,034,693.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	978,495.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		93,678.46	42,511.00
应付托管费		23,419.64	10,627.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,543.36	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	115,000.00	120,000.00
负债合计		236,641.46	1,151,634.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	150,898,651.00	85,898,651.00
未分配利润	7.4.7.8	40,313,457.00	-15,592.29
净资产合计		191,212,108.00	85,883,058.71
负债和净资产总计		191,448,749.46	87,034,693.27

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2672 元，基金份额总额 150,898,651.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		33,536,217.64	247,270.11
1.利息收入		101,695.28	48,539.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	101,535.98	48,108.85
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		159.30	430.79
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,056,785.10	4,387,269.61
其中：股票投资收益	7.4.7.10	811,088.96	3,436,888.24
基金投资收益	7.4.7.11	1,246,615.91	216,475.13
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	1,999,080.23	733,906.24
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	29,549,807.90	-1,313,933.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-433,560.59	-2,194,323.94
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	261,489.95	-680,281.69
<b>减：二、营业总支出</b>		1,230,614.16	561,029.45
1. 管理人报酬		871,389.47	329,915.98
2. 托管费		217,847.37	82,479.08
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		4,537.32	794.39
8. 其他费用	7.4.7.17	136,840.00	147,840.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>32,305,603.48</b>	<b>-313,759.34</b>
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>32,305,603.48</b>	<b>-313,759.34</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		32,305,603.48	-313,759.34

注：比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	85,898,651.00	-15,592.29	85,883,058.71
二、本期期初净资产	85,898,651.00	-15,592.29	85,883,058.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	65,000,000.00	40,329,049.29	105,329,049.29
（一）、综合收益总额	-	32,305,603.48	32,305,603.48
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	65,000,000.00	8,023,445.81	73,023,445.81
其中：1. 基金申购款	85,000,000.00	9,449,125.22	94,449,125.22
2. 基金赎回款	-20,000,000.00	-1,425,679.41	-21,425,679.41
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	150,898,651.00	40,313,457.00	191,212,108.00

项目	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
产			0
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	247,898,651.00	-	247,898,651.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-162,000,000.00	-15,592.29	-162,015,592.29
(一)、综合收益总额	-	-313,759.34	-313,759.34
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-162,000,000.00	298,167.05	-161,701,832.95
其中: 1. 基金申购款	65,000,000.00	1,567,280.50	66,567,280.50
2. 基金赎回款	-227,000,000.00	-1,269,113.45	-228,269,113.45
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	85,898,651.00	-15,592.29	85,883,058.71

注: 比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 周向勇 主管会计工作负责人: 倪莹 会计机构负责人: 吴洪涛

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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]3692 号《关于准予国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资

基金(QDII)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《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式，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 247,885,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2022 年 5 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 247,898,651.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 13,651.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]476 号文审批同意，本基金于 2022 年 5 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括交易型开放式基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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的相关规定。本基金可以进行境外证券借贷交易及境外正回购交易、逆回购交易。境内市场投资工具包括银行存款、债券回购、货币市场工具(含同业存单)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。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：标普 500 指数收益率(经估值汇率调整)。本基金的标的指数为标普 500 指数。

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，募集成立了国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (以下简称“国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII)”)。国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII) 为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 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<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》、

《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度的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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成

本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值

为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；

(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、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[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》及其他相关境内外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)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4)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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	11,261,763.10	3,133,371.84
等于：本金	11,260,551.59	3,133,108.86
加：应计利息	1,211.51	262.98

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	11,261,763.10	3,133,371.84

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	147,726,676.89	-	174,893,817.70	27,167,140.81
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	4,073,424.33	-	5,142,157.91	1,068,733.58
其他	-	-	-	-
合计	151,800,101.22	-	180,035,975.61	28,235,874.39
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		82,084,798.61	-	80,907,218.18	-1,177,580.43
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		3,066,803.95	-	2,930,450.87	-136,353.08
其他		-	-	-	-
合计		85,151,602.56	-	83,837,669.05	-1,313,933.51

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-

其中：交易所市场		
银行间市场		
应付利息		
预提费用	115,000.00	120,000.00
合计	115,000.00	120,000.00

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	85,898,651.00	85,898,651.00
本期申购	85,000,000.00	85,000,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-20,000,000.00	-20,000,000.00
本期末	150,898,651.00	150,898,651.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,478,671.33	-2,494,263.62	-15,592.29
本期期初	2,478,671.33	-2,494,263.62	-15,592.29
本期利润	2,755,795.58	29,549,807.90	32,305,603.48
本期基金份额交易产生的变动数	2,331,587.78	5,691,858.03	8,023,445.81
其中：基金申购款	3,091,452.10	6,357,673.12	9,449,125.22
基金赎回款	-759,864.32	-665,815.09	-1,425,679.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,566,054.69	32,747,402.31	40,313,457.00

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	101,535.98	48,108.85
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	-	-
其他	-	-
合计	101,535.98	48,108.85

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	811,088.96	3,436,888.24
股票投资收益——赎回差价收入	0.00	0.00
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	811,088.96	3,436,888.24

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	22,783,082.03	194,621,822.05
减：卖出股票成本总额	21,951,230.83	191,095,897.39
减：交易费用	20,762.24	89,036.42
买卖股票差价收入	811,088.96	3,436,888.24

##### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年	上年度可比期间
----	------------------------------	---------

	12 月 31 日	2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	21,425,679.41	228,269,113.45
减: 现金支付赎回款总额	21,425,679.41	228,269,113.45
减: 赎回股票成本总额	-	-
减: 交易费用	-	-
赎回差价收入	0.00	0.00

#### 7.4.7.11 基金投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	16,072,364.43	3,339,324.32
减: 卖出/赎回基金成本总额	14,774,188.97	3,112,041.58
减: 买卖基金差价收入应缴纳增值税额	37,810.93	6,619.89
减: 交易费用	13,748.62	4,187.72
基金投资收益	1,246,615.91	216,475.13

#### 7.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间内均无债券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间内均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,971,561.59	723,128.89
其中: 证券出借权益补偿收入	-	-

基金投资产生的股利收益	27,518.64	10,777.35
合计	1,999,080.23	733,906.24

#### 7.4.7.15 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12月31日	上年度可比期间 2022年5月9日(基金合同生效日) 至2022年12月31日
1.交易性金融资产	29,549,807.90	-1,313,933.51
——股票投资	28,344,721.24	-1,177,580.43
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	1,205,086.66	-136,353.08
——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	29,549,807.90	-1,313,933.51

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年5月9日(基金合同生效日)至2022 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	261,489.95	-680,281.69
合计	261,489.95	-680,281.69

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

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年5月9日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
审计费用	35,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	400.00	-
银行汇划费用	21,440.00	27,840.00
合计	136,840.00	147,840.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (“国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII) ”)	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
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
香港上海汇丰银行有限公司 (The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited)	境外资产托管人
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东

中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
----------------------	------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年5月9日(基金合同生 效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	871,389.47	329,915.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	871,389.47	329,915.98

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 0.6% 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 0.6% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年5月9日(基金合同 生效日)至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	217,847.37	82,479.08

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

###### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 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
国泰标普 500ETF 发起式联接	37,682,700.00	24.97%	8,970,000.00	10.44%

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年5月9日（基金合同生效日）至 2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,795,696.77	15,320.71	1,676,802.64	36,477.16
汇丰银行	6,466,066.33	86,215.27	1,456,569.20	11,631.69

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末 (2023 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，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。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行及境外托管人香港上海汇丰银行，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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 12 月 31 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

于 2023 年 12 月 31 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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。

本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，投资于一只境外基金的比例不超过基金资产净值的 20%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共

同持有一只境外基金不得超过该基金总份额的 20%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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资产净值的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

<b>2023 年 12 月 31 日</b>					
资产					
货币资金	11,261,763.10	-	-	-	11,261,763.10
结算备付金	4.98	-	-	-	4.98
交易性金融资产	-	-	-	180,035,975.61	180,035,975.61
应收清算款	-	-	-	6,693.15	6,693.15
应收股利	-	-	-	144,312.62	144,312.62
资产总计	11,261,768.08	-	-	180,186,981.38	191,448,749.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	93,678.46	93,678.46
应付托管费	-	-	-	23,419.64	23,419.64
应交税费	-	-	-	4,543.36	4,543.36
其他负债	-	-	-	115,000.00	115,000.00
负债总计	-	-	-	236,641.46	236,641.46
利率敏感度缺口	11,261,768.08	-	-	179,950,339.92	191,212,108.00
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	3,133,371.84	-	-	-	3,133,371.84
交易性金融资产	-	-	-	83,837,669.05	83,837,669.05
应收清算款	-	-	-	6,581.55	6,581.55
应收股利	-	-	-	57,070.83	57,070.83
资产总计	3,133,371.84	-	-	83,901,321.43	87,034,693.27
负债					
应付清算款	-	-	-	978,495.80	978,495.80
应付管理人报酬	-	-	-	42,511.00	42,511.00
应付托管费	-	-	-	10,627.76	10,627.76
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	1,151,634.56	1,151,634.56
利率敏感度缺口	3,133,371.84	-	-	82,749,686.87	85,883,058.71

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	6,466,233.41	6,466,233.41
交易性金融资产	180,035,975.61	180,035,975.61
应收股利	144,312.62	144,312.62
应收证券清算款	6,693.15	6,693.15
资产合计	186,653,214.79	186,653,214.79
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	186,653,214.79	186,653,214.79
项目	上年度末 2022年12月31日	
	美元 折合人民币	合计

以外币计价的资产		
货币资金	1,456,718.18	1,456,718.18
交易性金融资产	83,837,669.05	83,837,669.05
应收股利	57,070.83	57,070.83
应收证券清算款	6,581.55	6,581.55
资产合计	85,358,039.61	85,358,039.61
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	85,358,039.61	85,358,039.61

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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: 人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	9,332,660.74	4,267,901.98
	美元相对人民币贬值 5%	-9,332,660.74	-4,267,901.98

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	174,893,817.70	91.47	80,907,218.18	94.21
交易性金融资产—基金投资	5,142,157.91	2.69	2,930,450.87	3.41
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	180,035,975.61	94.16	83,837,669.05	97.62

#### 7.4.13.4.3.2 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: 人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	9,544,285.45	-
	业绩比较基准下降 5%	-9,544,285.45	-

注: 于 2022 年 12 月 31 日, 本基金成立尚未满一年, 无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	180,035,975.61	83,837,669.05
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	180,035,975.61	83,837,669.05

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2023 年度, 本基金申购基金份额的对价总额为 94,449,125.22 元, 其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 94,449,125.22 元(于 2022 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间: 本基金申购基金份额的对价总额为 66,567,280.50 元, 其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 66,567,280.50 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	174,893,817.70	91.35

	其中：普通股	170,743,712.96	89.19
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	4,150,104.74	2.17
2	基金投资	5,142,157.91	2.69
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,261,768.08	5.88
8	其他各项资产	151,005.77	0.08
9	合计	191,448,749.46	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	174,893,817.70	91.47
合计	174,893,817.70	91.47

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	50,894,054.83	26.62

金融	22,871,198.07	11.96
医疗保健	22,223,429.17	11.62
非日常生活消费品	19,033,103.56	9.95
通讯业务	15,137,781.00	7.92
工业	14,234,630.07	7.44
日常消费品	10,853,216.29	5.68
能源	6,857,345.98	3.59
房地产	4,431,932.95	2.32
原材料	4,234,260.34	2.21
公用事业	4,122,865.44	2.16
合计	174,893,817.70	91.47

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

### 8.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克	美国	9,101.00	12,410,416.93	6.49
2	MICROS OFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达 克	美国	4,627.00	12,323,452.36	6.44
3	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克	美国	5,661.00	6,092,059.32	3.19
4	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克	美国	1,537.00	5,391,019.34	2.82
5	ALPHAB ET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	3,684.00	3,644,884.63	1.91
6	META PLATFO RMS INC-CLA	Meta 平台 股份有限 公司	METAUS	纳斯达 克	美国	1,381.00	3,462,156.63	1.81

	SS A							
7	ALPHABET INC-CLASS C	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克	美国	3,100.00	3,094,311.22	1.62
8	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克	美国	1,721.00	3,028,803.90	1.58
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B US	纽约	美国	1,132.00	2,859,563.07	1.50
10	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽约	美国	1,799.00	2,167,376.32	1.13
11	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克	美国	273.00	2,158,355.44	1.13
12	UNITED HEALTH GROUP INC	联合健康集团	UNH US	纽约	美国	575.00	2,144,076.71	1.12
13	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽约	美国	496.00	2,047,809.15	1.07
14	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	纽约	美国	992.00	1,829,229.10	0.96
15	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油公司	XOM US	纽约	美国	2,493.00	1,765,363.97	0.92
16	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约	美国	1,498.00	1,662,993.31	0.87
17	MASTERCARD INC - A	万事达股份有限公司	MA US	纽约	美国	515.00	1,555,733.82	0.81
18	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽约	美国	622.00	1,526,705.02	0.80
19	PROCTER	宝洁	PG US	纽约	美国	1,467.00	1,522,597.62	0.80

	R & GAMBL E CO/THE							
20	COSTCO WHOLE SALE CORP	开市客	COST US	纳斯达克	美国	275.00	1,285,665.87	0.67
21	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽约	美国	1,577.00	1,217,689.94	0.64
22	ABBVIE INC	艾伯维公司	ABBV US	纽约	美国	1,099.00	1,206,269.01	0.63
23	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克	美国	283.00	1,195,827.49	0.63
24	CHEVR ON CORP	雪佛龙	CVX US	纽约	美国	1,093.00	1,154,705.90	0.60
25	SALESFORCE INC	Salesforce 股份有限公司	CRM US	纽约	美国	605.00	1,127,563.72	0.59
26	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	1,005.00	1,049,281.11	0.55
27	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克	美国	855.00	1,028,501.53	0.54
28	BANK OF AMERICA CORP	美国银行公司	BAC US	纽约	美国	4,286.00	1,022,101.75	0.53
29	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	纽约	美国	2,422.00	1,010,902.86	0.53
30	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT US	纽约	美国	888.00	991,529.84	0.52
31	ACCENTURE PLC-CLASS A	埃森哲公司	ACN US	纽约	美国	390.00	969,302.20	0.51
32	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD US	纽约	美国	451.00	947,141.21	0.50

33	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克	美国	272.00	937,971.59	0.49
34	INTELCORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	2,624.00	933,896.49	0.49
35	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	纽约	美国	240.00	902,262.32	0.47
36	CISCO SYSTEMS INC	思科系统股份有限公司	CSCO US	纳斯达克	美国	2,521.00	902,059.19	0.47
37	LINDE PLC	Linde PLC	LIN US	纽约	美国	301.00	875,589.65	0.46
38	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽约	美国	1,080.00	841,960.21	0.44
39	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽约	美国	2,260.00	787,859.72	0.41
40	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克	美国	2,500.00	776,440.99	0.41
41	INTUIT INC	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳斯达克	美国	174.00	770,280.60	0.40
42	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纽约	美国	989.00	738,515.04	0.39
43	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公司	DIS US	纽约	美国	1,139.00	728,387.06	0.38
44	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约	美国	3,515.00	716,746.93	0.37
45	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	692.00	708,864.66	0.37
46	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	纽约	美国	2,617.00	698,785.56	0.37
47	TEXAS INSTRUMENTS	德州仪器	TXN US	纳斯达克	美国	565.00	682,134.13	0.36

	INC							
48	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克 克	美国	333.00	679,306.43	0.36
49	DANAHA ER CORP	丹纳赫	DHR US	纽约	美国	409.00	670,151.33	0.35
50	CATERPI LLAR INC	卡特彼勒	CAT US	纽约	美国	317.00	663,842.99	0.35
51	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽约	美国	379.00	659,328.40	0.34
52	INTL BUSINE SS MACHIN ES CORP	国际商业 机器	IBM US	纽约	美国	568.00	657,957.33	0.34
53	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽约	美国	354.00	653,546.51	0.34
54	PHILIP MORRIS INTERN ATIONA L	菲利普莫 里斯国际 集团公司	PM US	纽约	美国	966.00	643,684.84	0.34
55	SERVICE NOW INC	ServiceNo w 公司	NOW US	纽约	美国	127.00	635,489.80	0.33
56	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI US	纽约	美国	201.00	627,134.27	0.33
57	GENERA L ELECTR IC CO	通用电气	GE US	纽约	美国	677.00	611,984.31	0.32
58	HONEY WELL INTERN ATIONA L INC	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克 克	美国	410.00	608,978.34	0.32
59	CONOC OPHILLI PS	康菲石油	COP US	纽约	美国	739.00	607,523.76	0.32
60	APPLIE D MATERI	应用材料	AMAT US	纳斯达克 克	美国	520.00	596,904.46	0.31

	ALS INC							
61	NIKE INC-CL B	耐克公司	NKE US	纽约	美国	762.00	585,954.18	0.31
62	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	纽约	美国	359.00	565,875.50	0.30
63	UBER TECHNO LOGIES INC	优步技术 股份有限 公司	UBER US	纽约	美国	1,281.00	558,620.84	0.29
64	GOLDM AN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	纽约	美国	203.00	554,655.52	0.29
65	BOOKIN G HOLDIN GS INC	Booking控 股股份有 限公司	BKNG US	纳斯达 克	美国	22.00	552,725.69	0.29
66	NEXTER A ENERGY INC	新纪元能 源公司	NEE US	纽约	美国	1,277.00	549,369.48	0.29
67	PROLOG IS INC	安博	PLD US	纽约	美国	575.00	542,871.25	0.28
68	AT&T INC	美国电话 电报公司	T US	纽约	美国	4,451.00	528,991.14	0.28
69	INTUITI VE SURGIC AL INC	直觉外科 手术公司	ISRG US	纳斯达 克	美国	219.00	523,282.91	0.27
70	MORGA N STANLE Y	摩根士丹 利	MS US	纽约	美国	786.00	519,122.96	0.27
71	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	联合包裹 服务股份 有限公司	UPS US	纽约	美国	450.00	501,125.81	0.26
72	BLACKR OCK INC	贝莱德有 限公司	BLK US	纽约	美国	87.00	500,227.02	0.26
73	ELEVAN CE HEALTH INC	Elevance 健康股份 有限公司	ELV US	纽约	美国	146.00	487,628.03	0.26

74	STARBU CKS CORP	星巴克公 司	SBUX US	纳斯达 克	美国	711.00	483,487.13	0.25
75	MEDTR ONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约	美国	828.00	483,115.50	0.25
76	AMERIC AN EXPRES S CO	美国运通	AXP US	纽约	美国	358.00	475,020.54	0.25
77	TJX COMPA NIES INC	TJX 公司	TJX US	纽约	美国	712.00	473,072.80	0.25
78	DEERE & CO	迪尔	DE US	纽约	美国	166.00	470,138.44	0.25
79	VERTEX PHARM ACEUTI CAL S INC	福泰制药	VRTX US	纳斯达 克	美国	160.00	461,100.77	0.24
80	BRISTO L-MYER S SQUIBB CO	百时美施 贵宝公司	BMJ US	纽约	美国	1,266.00	460,081.28	0.24
81	LAM RESEAR CH CORP	泛林集团	LRCX US	纳斯达 克	美国	82.00	454,902.84	0.24
82	SCHWA B (CHARL ES) CORP	嘉信理财	SCHW US	纽约	美国	926.00	451,230.32	0.24
83	CVS HEALTH CORP	CVS 健康 公司	CVS US	纽约	美国	799.00	446,840.74	0.23
84	STRYKE R CORP	史赛克	SYK US	纽约	美国	210.00	445,406.92	0.23
85	GILEAD SCIENC ES INC	吉利德科 学	GILD US	纳斯达 克	美国	775.00	444,671.38	0.23
86	AMERIC AN	美国发射 塔公司	AMT US	纽约	美国	290.00	443,413.85	0.23

	TOWER CORP							
87	ANALO G DEVICE S INC	亚德诺半 导体	ADI US	纳斯达 克	美国	310.00	435,965.68	0.23
88	MONDE LEZ INTERN ATIONA L INC-A	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达 克	美国	846.00	433,997.97	0.23
89	CITIGRO UP INC	花旗集团	C US	纽约	美国	1,191.00	433,921.90	0.23
90	EATON CORP PLC	伊顿	ETN US	纽约	美国	248.00	423,002.64	0.22
91	AUTOM ATIC DATA PROCES SING	ADP 公司	ADP US	纳斯达 克	美国	256.00	422,414.49	0.22
92	MICRON TECHNO LOGY INC	美光科技 股份有限 公司	MU US	纳斯达 克	美国	683.00	412,830.89	0.22
93	PROGRE SSIVE CORP	前进保险 公司	PGR US	纽约	美国	364.00	410,640.21	0.21
94	MARSH & MCLEN NAN COS	Marsh & McLennan 股份有限 公司	MMC US	纽约	美国	306.00	410,639.51	0.21
95	REGENE RON PHARM ACEUTI CALS	再生元制 药股份有 限公司	REGN US	纳斯达 克	美国	66.00	410,563.86	0.21
96	BLACKS TONE INC	黑石集团 股份有限 公司	BX US	纽约	美国	442.00	409,852.05	0.21
97	CHUBB LTD	邱博保险 集团	CB US	纽约	美国	254.00	406,575.31	0.21
98	PALO ALTO	Palo Alto Networks	PANW US	纳斯达 克	美国	193.00	403,089.49	0.21

	NETWOR RKS INC	股份有 限公 司						
99	ZOETIS INC	硕腾股 份有 限公 司	ZTS US	纽约	美国	285.00	398,405.06	0.21
100	THE CIGNA GROUP	信诺集 团	CI US	纽约	美国	182.00	386,006.44	0.20
101	BOSTON SCIENTI FIC CORP	波士顿科 学	BSX US	纽约	美国	911.00	373,009.76	0.20
102	T-MOBIL E US INC	T-Mobile US 股 份有 限公 司	TMUS US	纳斯 达 克	美国	316.00	358,839.90	0.19
103	FISERV INC	Fiserv 公 司	FI US	纽约	美国	373.00	350,942.97	0.18
104	KLA CORP	KLA 公 司	KLAC US	纳斯 达 克	美国	84.00	345,842.57	0.18
105	SYNOPS YS INC	新思科技 公司	SNPS US	纳斯 达 克	美国	94.00	342,813.59	0.18
106	SOUTHE RN CO/THE	南方公 司	SO US	纽约	美国	679.00	337,217.83	0.18
107	CME GROUP INC	芝加哥商 业交易 所	CME US	纳斯 达 克	美国	224.00	334,122.12	0.17
108	EQUINI X INC	Equinix 有 限公 司	EQIX US	纳斯 达 克	美国	58.00	330,851.47	0.17
109	DUKE ENERGY CORP	杜克能 源	DUK US	纽约	美国	479.00	329,219.19	0.17
110	SCHLU MBERG ER LTD	斯伦贝 谢公 众有 限公 司	SLB US	纽约	美国	889.00	327,670.92	0.17
111	CADEN CE DESIGN SYS INC	Cadence 设计系 统股 份有 限公 司	CDNS US	纳斯 达 克	美国	169.00	326,020.43	0.17
112	INTERC ONTINE NTAL EXCHA NGE IN	洲际交 易所 (ICE)	ICE US	纽约	美国	356.00	323,828.69	0.17
113	SHERWI	宣伟公 司	SHW US	纽约	美国	146.00	322,527.74	0.17

	N-WILLIAMS CO/THE							
114	ILLINOIS TOOL WORKS	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW US	纽约	美国	170.00	315,391.21	0.16
115	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	纽约	美国	1,101.00	314,573.45	0.16
116	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约	美国	363.00	310,964.88	0.16
117	BECTON DICKINSON AND CO	碧迪	BDX US	纽约	美国	180.00	310,855.45	0.16
118	CSX CORP	CSX 公司	CSX US	纳斯达克	美国	1,230.00	302,035.37	0.16
119	US BANCORP	美国合众银行	USB US	纽约	美国	969.00	297,036.54	0.16
120	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPLUS	纳斯达克	美国	671.00	291,850.52	0.15
121	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT US	纽约	美国	287.00	289,502.10	0.15
122	WASTE MANAGEMENT INC	废品管理	WM US	纽约	美国	228.00	289,220.64	0.15
123	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	纽约	美国	512.00	289,055.75	0.15
124	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG US	纽约	美国	17.00	275,363.48	0.14
125	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC 财务服务	PNC US	纽约	美国	248.00	271,995.51	0.14

126	FREEPORT-MCMORAN INC	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	纽约	美国	892.00	268,947.40	0.14
127	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK US	纽约	美国	82.00	268,890.17	0.14
128	MOODY'S CORP	穆迪	MCO US	纽约	美国	97.00	268,323.27	0.14
129	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	空气产品公司	APD US	纽约	美国	138.00	267,615.57	0.14
130	3M CO	3M 公司	MMM US	纽约	美国	343.00	265,578.30	0.14
131	AMPHENOL CORP-CALA	安费诺公司	APH US	纽约	美国	372.00	261,184.19	0.14
132	AIRBNB INC-CLASS A	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克	美国	270.00	260,344.47	0.14
133	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克	美国	160.00	260,280.73	0.14
134	ARISTA NETWORKS INC	Arista 网络股份有限公司	ANET US	纽约	美国	156.00	260,215.28	0.14
135	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	纽约	美国	141.00	259,322.22	0.14
136	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽约	美国	144.00	258,006.33	0.13
137	PARKER HANNIFIN CORP	派克汉尼汾公司	PH US	纽约	美国	79.00	257,776.99	0.13
138	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX US	纽约	美国	273.00	257,436.46	0.13
139	LULULEMON ATHLETICA INC	LULULEMON ATHLETICA	LULU US	纳斯达克	美国	71.00	257,113.27	0.13

140	AON PLC-CL ASS A	怡安集团	AON US	纽约	美国	124.00	255,589.71	0.13
141	ROPER TECHNO LOGIES INC	儒博技术 公司	ROP US	纽约	美国	66.00	254,844.19	0.13
142	MARAT HON PETROL EUM CORP	马拉松石 油公司	MPC US	纽约	美国	236.00	247,986.29	0.13
143	HUMAN A INC	Humana 股 份有限公 司	HUM US	纽约	美国	76.00	246,432.35	0.13
144	TRANE TECHNO LOGIES PLC	特灵科技 公共有限 公司	TT US	纽约	美国	142.00	245,300.82	0.13
145	MARRIO TT INTERN ATIONA L-CLA	万豪国际	MAR US	纳斯达 克	美国	153.00	244,374.61	0.13
146	EMERSON ELECTR IC CO	艾默生电 气	EMR US	纽约	美国	354.00	244,033.15	0.13
147	TRANSD IGM GROUP INC	TransDigm 集团公司	TDG US	纽约	美国	34.00	243,605.22	0.13
148	O'REILL Y AUTOM OTIVE INC	O'Reilly 汽 车股份有 限公司	ORLY US	纳斯达 克	美国	36.00	242,248.74	0.13
149	HCA HEALTH CARE INC	HCA 医疗 保健有限 公司	HCA US	纽约	美国	123.00	235,808.86	0.12
150	NORFOL K SOUTHE RN	诺福克南 方	NSCUS	纽约	美国	140.00	234,389.21	0.12

	CORP							
151	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD US	纽约	美国	145.00	230,949.85	0.12
152	AUTODESK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达克	美国	133.00	229,357.94	0.12
153	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	纽约	美国	103.00	228,404.82	0.12
154	CINTAS CORP	CINTAS 公司	CTAS US	纳斯达克	美国	53.00	226,228.38	0.12
155	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克	美国	325.00	224,778.34	0.12
156	ECOLAB INC	艺康集团	ECL US	纽约	美国	157.00	220,562.01	0.12
157	CROWN CASTLE INC	冠城股份有限公司	CCI US	纽约	美国	270.00	220,281.18	0.12
158	CAPITALE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF US	纽约	美国	237.00	220,098.02	0.12
159	WELLTOWER INC	Welltower Inc	WELL US	纽约	美国	344.00	219,694.59	0.11
160	TRUIST FINANCIAL CORP	Truist 金融公司	TFC US	纽约	美国	830.00	217,039.43	0.11
161	GENERAL MOTOR SCO	通用汽车公司	GM US	纽约	美国	852.00	216,757.82	0.11
162	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克	美国	336.00	214,609.21	0.11
163	ARTHUR J	亚瑟加拉格尔有限	AJG US	纽约	美国	134.00	213,429.52	0.11

	GALLAGHER & CO	公司						
164	CARRIER GLOBAL CORP	开利全球公司	CARR US	纽约	美国	522.00	212,402.38	0.11
165	PUBLIC STORAGE	公共存储公司	PSAUS	纽约	美国	98.00	211,701.90	0.11
166	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽约	美国	2,448.00	211,355.70	0.11
167	DEXCOM INC	Dexcom 股份有限公司	DXCM US	纳斯达克	美国	240.00	210,934.14	0.11
168	NEWMONT CORP	纽蒙黄金公司	NEM US	纽约	美国	717.00	210,190.67	0.11
169	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG US	纽约	美国	437.00	209,695.73	0.11
170	SEMPRA	SEMPRA	SRE US	纽约	美国	391.00	206,952.46	0.11
171	ROSS STORES INC	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克	美国	210.00	205,836.72	0.11
172	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG US	纽约	美国	203.00	205,086.09	0.11
173	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT US	纽约	美国	159.00	205,060.53	0.11
174	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	爱德华生命科学公司	EW US	纽约	美国	377.00	203,601.06	0.11
175	AUTOZONE	AutoZone	AZO US	纽约	美国	11.00	201,444.10	0.11

	NE INC	股份有限公司						
176	DR HORTON INC	霍顿房屋 公司	DHI US	纽约	美国	187.00	201,292.18	0.11
177	IDEXX LABORA TORIES INC	爱德士股 份有限公 司	IDXX US	纳斯达 克	美国	51.00	200,493.88	0.10
178	MSCI INC	MSCI 明 晟	MSCI US	纽约	美国	49.00	196,310.13	0.10
179	VALERO ENERGY CORP	Valero 能 源	VLO US	纽约	美国	211.00	194,278.46	0.10
180	AFLAC INC	家庭人寿 保险	AFL US	纽约	美国	331.00	193,410.83	0.10
181	TE CONNE CTIVITY LTD	泰科电子 公司	TEL US	纽约	美国	193.00	192,058.03	0.10
182	TRAVEL ERS COS INC/THE	旅行家集 团	TRV US	纽约	美国	142.00	191,584.06	0.10
183	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	纽约	美国	153.00	188,598.99	0.10
184	COPART INC	Copart 股 份有限公 司	CPRT US	纳斯达 克	美国	543.00	188,449.40	0.10
185	AMERIC AN ELECTR IC POWER	美国电力	AEP US	纳斯达 克	美国	327.00	188,109.00	0.10
186	MONST ER BEVERA GE CORP	怪兽饮料 公司	MNST US	纳斯达 克	美国	459.00	187,287.77	0.10
187	IQVIA HOLDIN GS INC	艾昆纬	IQV US	纽约	美国	114.00	186,822.64	0.10
188	WILLIA MS COS INC	威廉姆斯 公司	WMB US	纽约	美国	757.00	186,744.66	0.10

189	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公 司	O US	纽约	美国	450.00	183,009.89	0.10
190	METLIF E INC	大都会集 团	MET US	纽约	美国	387.00	181,262.65	0.09
191	KIMBER LY-CLA RK CORP	金佰利	KMB US	纽约	美国	210.00	180,729.96	0.09
192	ONEOK INC	Oneok 股 份有限公 司	OKE US	纽约	美国	362.00	180,039.68	0.09
193	AGILEN T TECHNO LOGIES INC	安捷伦	A US	纽约	美国	182.00	179,216.82	0.09
194	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地 产信托有 限公司	DLR US	纽约	美国	188.00	179,199.68	0.09
195	BANK OF NEW YORK MELLO N CORP	纽约梅隆 银行股份 有限公司	BK US	纽约	美国	478.00	176,216.87	0.09
196	L3HARR IS TECHNO LOGIES INC	L3Harris Technologi es 股份有 限公司	LHX US	纽约	美国	118.00	176,027.48	0.09
197	HESS CORP	赫斯公司	HES US	纽约	美国	172.00	175,619.23	0.09
198	CENTEN E CORP	Centene 公司	CNC US	纽约	美国	332.00	174,501.58	0.09
199	OCCIDE NTAL PETROL EUM CORP	西方石油	OXY US	纽约	美国	411.00	173,815.19	0.09
200	DOMINI ON ENERGY INC	Dominion 能源股份 有限公司	D US	纽约	美国	520.00	173,101.19	0.09
201	JOHNSO	江森自控	JCI US	纽约	美国	423.00	172,688.41	0.09

	N CONTR OLS INTERN ATION	国际有限 公司						
202	CONSTE LLATIO N BRANDS INC-A	星座品牌 股份有限 公司	STZ US	纽约	美国	100.00	171,224.27	0.09
203	CHARTER COMMUN ICATIONS INC-A	Charter 通 信公司	CHTR US	纳斯达 克	美国	62.00	170,680.04	0.09
204	UNITED RENTAL S INC	联合租赁 公司	URI US	纽约	美国	42.00	170,577.20	0.09
205	ARCHER -DANIEL S-MIDL AND CO	Archer-Da niels-Midl and 公司	ADM US	纽约	美国	332.00	169,822.18	0.09
206	PG & E CORP	太平洋煤 气电力	PCG US	纽约	美国	1,328.00	169,587.04	0.09
207	AMERIP RISE FINANCIAL INC	阿默普莱 斯金融公 司	AMP US	纽约	美国	63.00	169,483.98	0.09
208	DOW INC	陶氏公司	DOW US	纽约	美国	436.00	169,349.06	0.09
209	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达 克	美国	200.00	168,724.08	0.09
210	AMETEK INC	阿美特克 股份有限 公司	AME US	纽约	美国	143.00	167,004.90	0.09
211	COGNIZ ANT TECH SOLUTIONS-A	高知特科 技公司	CTSH US	纳斯达 克	美国	312.00	166,906.38	0.09
212	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS US	纽约	美国	361.00	166,553.52	0.09
213	BIOGEN	渤健公司	BIIB US	纳斯达	美国	90.00	164,951.13	0.09

	INC			克				
214	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	保德信金融集团	PRU US	纽约	美国	224.00	164,538.49	0.09
215	FORTINET INC	Fortinet 股份有限公司	FTNT US	纳斯达克	美国	396.00	164,161.97	0.09
216	CONSTELLANTION ENERGY	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克	美国	198.00	163,923.57	0.09
217	KENVUE INC	KENVUE	KVUE US	纽约	美国	1,073.00	163,622.34	0.09
218	LENNAR CORP-A	Lennar 公司	LEN US	纽约	美国	155.00	163,618.87	0.09
219	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST US	纳斯达克	美国	355.00	162,855.00	0.09
220	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU US	纽约	美国	313.00	162,120.81	0.08
221	YUM! BRANDS INC	百胜餐饮集团	YUM US	纽约	美国	174.00	161,024.05	0.08
222	OTIS WORLDWIDE CORP	奥的斯电梯公司	OTIS US	纽约	美国	254.00	160,957.05	0.08
223	ALLSTATE CORP	好事达保险公司	ALL US	纽约	美国	162.00	160,612.69	0.08
224	ON SEMICONDUCTOR	安森美半导体公司	ON US	纳斯达克	美国	268.00	158,553.61	0.08
225	WW GRAINGER INC	固安捷股份有限公司	GWW US	纽约	美国	27.00	158,472.79	0.08
226	OLD DOMINION FREIGHT LINE	Old Dominion Freight Line 股份有限公司	ODFL US	纳斯达克	美国	55.00	157,895.69	0.08
227	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	纳斯达克	美国	619.00	157,392.47	0.08
228	COSTAR	CoStar 集	CSGP US	纳斯达	美国	254.00	157,215.12	0.08

	GROUP INC	团股份有 限公司		克				
229	FIDELIT Y NATION AL INFO SERV	繁德信息 技术有限 公司	FIS US	纽约	美国	368.00	156,568.47	0.08
230	ROCKW ELL AUTOM ATION INC	罗克韦尔 自动化	ROK US	纽约	美国	71.00	156,131.61	0.08
231	PPG INDUST RIES INC	PPG 工业	PPG US	纽约	美国	146.00	154,645.80	0.08
232	GARTNE R INC	Gartner 公 司	IT US	纽约	美国	48.00	153,363.69	0.08
233	VERISK ANALYT ICS INC	Verisk 分 析公司	VRSK US	纳斯达 克	美国	90.00	152,259.63	0.08
234	BAKER HUGHES CO	贝克休斯 公司	BKR US	纳斯达 克	美国	626.00	151,546.27	0.08
235	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达 克	美国	343.00	150,402.06	0.08
236	KINDER MORGA N INC	特拉华州 金德摩根 公司	KMI US	纽约	美国	1,203.00	150,301.41	0.08
237	CENCOR A INC	CENCOR A 股份有 限公司	COR US	纽约	美国	103.00	149,828.43	0.08
238	CUMMI NS INC	康明斯	CMI US	纽约	美国	88.00	149,318.61	0.08
239	ESTEE LAUDER COMPA NIES-CL A	雅诗兰黛	EL US	纽约	美国	144.00	149,161.66	0.08
240	EXTRA SPACE STORAG E INC	Extra Space Storage 有 限公司	EXR US	纽约	美国	131.00	148,759.58	0.08
241	CORTEV	科迪华公	CTVA US	纽约	美国	438.00	148,658.51	0.08

	A INC	司						
242	REPUBLIC SERVICE S INC	公共服务公司	RSG US	纽约	美国	127.00	148,337.02	0.08
243	KEURIG DR PEPPER INC	Keurig Dr Pepper 有限公司	KDP US	纳斯达克	美国	626.00	147,733.22	0.08
244	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺界	EA US	纳斯达克	美国	152.00	147,285.60	0.08
245	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇有限公司	GPN US	纽约	美国	162.00	145,719.47	0.08
246	DUPONT DE NEMOURS INC	杜邦公司	DD US	纽约	美国	267.00	145,480.85	0.08
247	VICI PROPERTIES INC	VICI Properties 股份有限公司	VICI US	纽约	美国	644.00	145,412.93	0.08
248	MODERNA INC	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克	美国	206.00	145,101.15	0.08
249	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL US	纽约	美国	557.00	142,614.06	0.07
250	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克	美国	54.00	138,789.19	0.07
251	INGERSOLL-RAND INC	英格索兰股份有限公司	IR US	纽约	美国	252.00	138,039.56	0.07
252	CONSOLIDATED EDISON INC	联合爱迪生	ED US	纽约	美国	214.00	137,883.03	0.07
253	QUANTASERVICES INC	Quanta 服务股份有限公司	PWR US	纽约	美国	90.00	137,560.20	0.07
254	MARTIN MARIETTA	Martin Marietta 材料股份	MLM US	纽约	美国	38.00	134,277.93	0.07

	MATERI ALS	有限公司						
255	PUBLIC SERVICE ENTERP RISE GP	公共服务 企业集团	PEG US	纽约	美国	310.00	134,263.20	0.07
256	ROYAL CARIBB EAN CRUISE S LTD	皇家加勒 比国际游 轮有限公 司	RCL US	纽约	美国	146.00	133,902.27	0.07
257	CDW CORP/D E	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达 克	美国	83.00	133,633.27	0.07
258	KROGE R CO	克罗格公 司	KR US	纽约	美国	412.00	133,385.09	0.07
259	EQUIFA X INC	Equifax 股 份有限公 司	EFX US	纽约	美国	76.00	133,112.55	0.07
260	GE HEALTH CARE TECHNO LOGY	GE HealthCare Technologi es Inc	GEHC US	纳斯达 克	美国	243.00	133,075.15	0.07
261	VULCA N MATERI ALS CO	Vulcan 材 料	VMC US	纽约	美国	82.00	131,843.19	0.07
262	DOLLAR GENERA L CORP	达乐公司	DG US	纽约	美国	136.00	130,953.46	0.07
263	DOLLAR TREE INC	美元树公 司	DLTR US	纳斯达 克	美国	130.00	130,792.68	0.07
264	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏 公司	KHC US	纳斯达 克	美国	496.00	129,911.45	0.07
265	MONOLI THIC POWER SYSTEM S INC	芯源系统 有限公司	MPWR US	纳斯达 克	美国	29.00	129,561.14	0.07
266	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN US	纽约	美国	398.00	127,696.83	0.07

267	CBRE GROUP INC - A	世邦魏理仕	CBRE US	纽约	美国	189.00	124,613.09	0.07
268	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	是德科技公司	KEYS US	纽约	美国	110.00	123,946.54	0.06
269	FAIR ISAAC CORP	费埃哲公司	FICO US	纽约	美国	15.00	123,665.00	0.06
270	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公司	DFS US	纽约	美国	155.00	123,394.80	0.06
271	HERSHEY CO/THE	好时公司	HSY US	纽约	美国	93.00	122,806.37	0.06
272	ARCH CAPITAL GROUP LTD	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克	美国	232.00	122,039.45	0.06
273	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克	美国	111.00	121,920.75	0.06
274	XYLEM INC	赛莱默公司	XYL US	纽约	美国	150.00	121,496.64	0.06
275	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际	EIX US	纽约	美国	238.00	120,509.45	0.06
276	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBAC US	纳斯达克	美国	67.00	120,386.28	0.06
277	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源集团股份有限公司	WEC US	纽约	美国	196.00	116,845.57	0.06

278	AVALON BAY COMMU NITIES INC	AvalonBay 社区股份 有限公司	AVB US	纽约	美国	88.00	116,690.03	0.06
279	HP INC	惠普	HPQ US	纽约	美国	541.00	115,297.08	0.06
280	WEST PHARM ACEUTI CAL SERVICE S	西氏医药 服务公司	WST US	纽约	美国	46.00	114,722.17	0.06
281	DELTA AIR LINES INC	达美航空 有限公司	DAL US	纽约	美国	400.00	113,974.81	0.06
282	FORTIV E CORP	福迪威公 司	FTV US	纽约	美国	218.00	113,686.83	0.06
283	AMERIC AN WATER WORKS CO INC	美国自来 水股份有 限公司	AWK US	纽约	美国	121.00	113,116.31	0.06
284	ZIMMER BIOMET HOLDIN GS INC	捷迈邦美 控股股份 有限公司	ZBH US	纽约	美国	130.00	112,055.40	0.06
285	APTIV PLC	Aptiv 公共 有限公司	APTV US	纽约	美国	176.00	111,840.93	0.06
286	WEYER HAEUSE R CO	惠好	WY US	纽约	美国	454.00	111,804.53	0.06
287	TAKE-T WO INTERA CTIVE SOFTWARE	Take-Two 互动软件 股份有限 公司	TTWO US	纳斯达 克	美国	98.00	111,716.14	0.06
288	METTLE R-TOLE DO INTERN ATIONA L	梅特勒-托 利多国际 股份有限 公司	MTD US	纽约	美国	13.00	111,683.41	0.06
289	WARNE	华纳兄弟	WBD US	纳斯达	美国	1,381.00	111,310.16	0.06

	R BROS DISCOV ERY INC	探索股份 有限公司		克				
290	RESMED INC	瑞思迈股 份有限公 司	RMD US	纽约	美国	91.00	110,871.31	0.06
291	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿 惠悦公共 有限公司	WTW US	纳斯达 克	美国	64.00	109,334.22	0.06
292	CARDIN AL HEALTH INC	嘉德诺健 康集团	CAH US	纽约	美国	153.00	109,232.23	0.06
293	LYONDE LLBASE LL INDU-CL A	利安德巴 塞尔工业 公司	LYB US	纽约	美国	159.00	107,074.28	0.06
294	HARTFO RD FINANCI AL SVCS GRP	哈特福德 金融服务	HIG US	纽约	美国	187.00	106,460.49	0.06
295	BROAD RIDGE FINANCI AL SOLUTI O	布罗德里 奇金融解 决方案股 份有限公 司	BR US	纽约	美国	73.00	106,380.38	0.06
296	T ROWE PRICE GROUP INC	普徕仕	TROW US	纳斯达 克	美国	139.00	106,020.30	0.06
297	STATE STREET CORP	道富集团	STT US	纽约	美国	192.00	105,336.18	0.06
298	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美容 产品公司	ULTAUS	纳斯达 克	美国	30.00	104,113.57	0.05
299	FIFTH THIRD BANCO RP	五三银行	FITB US	纳斯达 克	美国	423.00	103,331.42	0.05
300	CORNIN	康宁公司	GLW US	纽约	美国	478.00	103,089.41	0.05

	G INC							
301	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威股份有限公司	CHD US	纽约	美国	153.00	102,470.24	0.05
302	TRACTOR SUPPLY COMPANY	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克	美国	67.00	102,040.53	0.05
303	M & T BANK CORP	M&T 银行	MTB US	纽约	美国	103.00	100,002.34	0.05
304	DTE ENERGY COMPANY	DTE 能源	DTE US	纽约	美国	128.00	99,960.13	0.05
305	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达克	美国	323.00	99,790.00	0.05
306	WABTEC CORP	西屋制动公司	WAB US	纽约	美国	111.00	99,766.20	0.05
307	PULTEGROUP INC	Pulte 集团公司	PHM US	纽约	美国	134.00	97,964.22	0.05
308	ILLUMINA INC	Illumina 公司	ILMN US	纳斯达克	美国	98.00	96,647.12	0.05
309	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	慧与	HPE US	纽约	美国	798.00	95,970.87	0.05
310	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	纽约	美国	61.00	94,985.03	0.05
311	EVERSOURCE ENERGY	Eversource 能源公司	ES US	纽约	美国	217.00	94,860.30	0.05
312	DOVER CORP	都福	DOV US	纽约	美国	87.00	94,776.94	0.05
313	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR US	纽约	美国	131.00	93,887.49	0.05
314	HOWMET	Howmet 航空航天股	HWM US	纽约	美国	243.00	93,145.72	0.05

	AEROSP ACE INC	份有限公 司						
315	EQUITY RESIDE NTIAL	公寓物业 权益信托	EQR US	纽约	美国	215.00	93,133.26	0.05
316	MOLINA HEALTH CARE INC	Molina Healthcare 股份有限 公司	MOH US	纽约	美国	36.00	92,125.81	0.05
317	TELEDY NE TECHNO LOGIES INC	Teledyne 科技股份 有限公司	TDY US	纽约	美国	29.00	91,667.21	0.05
318	RAYMO ND JAMES FINANCI AL INC	Raymond James 金 融股份有 限公司	RJF US	纽约	美国	116.00	91,607.64	0.05
319	INTL FLAVOR S & FRAGRA NCES	国际香料	IFF US	纽约	美国	158.00	90,610.82	0.05
320	PTC INC	PTC 公司	PTC US	纳斯达 克	美国	73.00	90,460.81	0.05
321	BUILDE RS FIRSTSO URCE INC	BUILDER S FIRSTSO URCE 股 份有限公 司	BLDR US	纽约	美国	76.00	89,861.33	0.05
322	IRON MOUNT AIN INC	美国铁山 公司	IRM US	纽约	美国	181.00	89,712.17	0.05
323	EXPEDI A GROUP INC	亿客行集 团股份有 限公司	EXPE US	纳斯达 克	美国	83.00	89,231.89	0.05
324	VENTAS INC	Ventas 公 司	VTR US	纽约	美国	250.00	88,250.44	0.05
325	FLEETC OR TECHNO LOGIES	FleetCor 技术股份 有限公司	FLT US	纽约	美国	44.00	88,072.24	0.05

	INC							
326	PPL CORP	PPL 公司	PPLUS	纽约	美国	458.00	87,909.06	0.05
327	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	亚历山大房地产股份有限公司	ARE US	纽约	美国	97.00	87,093.77	0.05
328	NASDAQ INC	纳斯达克股份有限公司	NDAQ US	纳斯达克	美国	211.00	86,887.31	0.05
329	INVITATION HOMES INC	邀请家园公司	INVH US	纽约	美国	358.00	86,489.54	0.05
330	GARMIN LTD	佳明有限公司	GRMN US	纽约	美国	95.00	86,488.97	0.05
331	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	纽约	美国	315.00	86,252.41	0.05
332	DARDEN RESTAURANTS INC	达登餐饮公司	DRI US	纽约	美国	74.00	86,112.88	0.05
333	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克	美国	44.00	85,389.03	0.04
334	GENUINE PARTS CO	原配部件	GPC US	纽约	美国	87.00	85,342.99	0.04
335	TARGA RESOURCES CORP	Targa 资源公司	TRGP US	纽约	美国	138.00	84,907.83	0.04
336	COTERRA ENERGY INC	Coterra 能源股份有限公司	CTRAUS	纽约	美国	468.00	84,591.24	0.04
337	WATERS CORP	沃特世公司	WAT US	纽约	美国	36.00	83,946.14	0.04
338	LABORATORY	美国实验控股	LH US	纽约	美国	52.00	83,711.00	0.04

	CRP OF AMER HLDGS							
339	AMERICAN CORPORATION	Ameren 公司	AEE US	纽约	美国	163.00	83,515.09	0.04
340	FIRSTENERGY CORP	第一能源	FE US	纽约	美国	321.00	83,348.22	0.04
341	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃博联股份有限公司	WBA US	纳斯达克	美国	446.00	82,478.47	0.04
342	CARNIVAL CORP	嘉年华公司	CCL US	纽约	美国	627.00	82,333.41	0.04
343	CBOE GLOBAL MARKETS INC	Cboe 环球市场公司	CBOE US	纳斯达克	美国	65.00	82,204.65	0.04
344	HUNTINGTON BANCSHARES INC	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN US	纳斯达克	美国	901.00	81,172.84	0.04
345	EXPEDITORS INTL WASHINGTON INC	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纳斯达克	美国	90.00	81,082.75	0.04
346	NETAPP INC	美国网域存储技术有限公司	NTAP US	纳斯达克	美国	129.00	80,549.00	0.04
347	FIRST SOLAR INC	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克	美国	66.00	80,533.70	0.04
348	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限公司	COO US	纽约	美国	30.00	80,411.31	0.04
349	VERISIGN INC	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克	美国	55.00	80,231.41	0.04
350	BALL	波尔	BALL US	纽约	美国	196.00	79,849.79	0.04

	CORP							
351	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加斯金沙集团	LVS US	纽约	美国	229.00	79,815.58	0.04
352	ENPHASE ENERGY INC	Enphase 能源股份有限公司	ENPH US	纳斯达克	美国	85.00	79,552.18	0.04
353	REGIONS FINANCIAL CORP	地区金融公司	RF US	纽约	美国	579.00	79,475.12	0.04
354	CENTER POINT ENERGY INC	中点能源	CNP US	纽约	美国	392.00	79,322.27	0.04
355	VERALTO CORP	VERALTO CORP	VLTO US	纽约	美国	136.00	79,236.71	0.04
356	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克	美国	99.00	78,827.48	0.04
357	AXON ENTERPRISE INC	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON US	纳斯达克	美国	43.00	78,675.98	0.04
358	Steel Dynamics	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD US	纳斯达克	美国	94.00	78,627.89	0.04
359	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克	美国	93.00	77,956.09	0.04
360	CLOROX COMPANY	高乐氏公司	CLX US	纽约	美国	77.00	77,764.01	0.04
361	FACTSET RESEARCH	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS US	纽约	美国	23.00	77,712.45	0.04

	SYSTEM S INC							
362	TYLER TECHNOLOGIES INC	Tyler 科技公司	TYLUS	纽约	美国	26.00	76,996.88	0.04
363	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLX US	纳斯达克	美国	152.00	76,920.96	0.04
364	HUBBELL INC	哈贝尔公司	HUBB US	纽约	美国	33.00	76,880.51	0.04
365	NORTHERN TRUST CORP	北美信托	NTRS US	纳斯达克	美国	128.00	76,497.69	0.04
366	SOUTHWEST AIRLINES CO	西南航空	LUV US	纽约	美国	371.00	75,887.45	0.04
367	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	信安金融	PFG US	纳斯达克	美国	136.00	75,778.66	0.04
368	MCCORMICK & CO-NON VTD SHRS	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC US	纽约	美国	156.00	75,597.34	0.04
369	ATMOS ENERGY CORP	Atmos 能源公司	ATO US	纽约	美国	92.00	75,521.41	0.04
370	OMNICOM GROUP	Omnicom 集团	OMC US	纽约	美国	123.00	75,365.10	0.04
371	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB US	纽约	美国	73.00	74,701.52	0.04
372	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	WDC US	纳斯达克	美国	201.00	74,555.12	0.04
373	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS US	纽约	美国	181.00	74,443.92	0.04
374	BROWN	Brown &	BRO US	纽约	美国	147.00	74,036.67	0.04

	& BROWN INC	Brown 股 份有限公 司						
375	EPAM SYSTEM S INC	EPAM 系 统公司	EPAM US	纽约	美国	35.00	73,708.95	0.04
376	SEAGAT E TECHNO LOGY HOLDIN GS	Seagate Technolog y 控股公 共有限公 司	STX US	纳斯达 克	美国	121.00	73,162.66	0.04
377	TERADY NE INC	泰瑞达	TER US	纳斯达 克	美国	95.00	73,018.39	0.04
378	IDEX CORP	艺达思集 团	IEX US	纽约	美国	47.00	72,273.07	0.04
379	JACOBS SOLUTI ONS INC	Jacobs Solutions Inc	J US	纽约	美国	78.00	71,708.09	0.04
380	AVERY DENNIS ON CORP	艾利丹尼 森	AVY US	纽约	美国	50.00	71,591.93	0.04
381	JABIL INC	捷普集团	JBL US	纽约	美国	79.00	71,284.54	0.04
382	CINCIN NATI FINANCI AL CORP	辛辛那提 金融	CINF US	纳斯达 克	美国	97.00	71,079.29	0.04
383	HUNT (JB) TRANSP RT SVCS INC	JB Hunt 运 输服务股 份有限公 司	JBHT US	纳斯达 克	美国	50.00	70,734.92	0.04
384	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	256.00	70,097.20	0.04
385	SYNCHR ONY FINANCI AL	同步金融 公司	SYF US	纽约	美国	257.00	69,515.50	0.04
386	TEXTRO N INC	德事隆	TXT US	纽约	美国	122.00	69,490.07	0.04
387	LAMB WESTO	蓝威斯顿 控股股份	LW US	纽约	美国	90.00	68,901.21	0.04

	N HOLDIN GS INC	有限公司							
388	MID-AM ERICA APARTM ENT COMM	Mid-Ameri ca Apartment Communiti es 股份有 限公司	MAA US	纽约	美国	72.00	68,568.47	0.04	
389	ESSEX PROPER TY TRUST INC	埃塞克斯 房地产信 托公司	ESS US	纽约	美国	39.00	68,487.30	0.04	
390	QUEST DIAGNO STICS INC	Quest Diagnostic s 股份有限 公司	DGX US	纽约	美国	70.00	68,359.39	0.04	
391	CELANE SE CORP	塞拉尼斯 公司	CE US	纽约	美国	62.00	68,227.22	0.04	
392	CITIZEN S FINANCI AL GROUP	公民金融 集团股份 有限公司	CFG US	纽约	美国	290.00	68,069.00	0.04	
393	POOL CORP	Pool 公司	POOLUS	纳斯达 克	美国	24.00	67,774.64	0.04	
394	EVERES T GROUP LTD	EVEREST 集团有限 公司	EG US	纽约	美国	27.00	67,616.13	0.04	
395	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品 公司	TSN US	纽约	美国	177.00	67,383.04	0.04	
396	BEST BUY CO INC	百思买	BBY US	纽约	美国	120.00	66,532.05	0.03	
397	CF INDUST RIES HOLDIN GS INC	CF 工业控 股股份有 限公司	CF US	纽约	美国	118.00	66,442.81	0.03	
398	INSULE T CORP	Insulet 股 份有限公 司	PODD US	纳斯达 克	美国	43.00	66,082.58	0.03	

		司						
399	STANLEY BLACK & DECKER INC	史丹利百 得公司	SWK US	纽约	美国	95.00	66,007.22	0.03
400	MASCO CORP	马斯可	MAS US	纽约	美国	139.00	65,941.50	0.03
401	SNAP-ON INC	实耐宝	SNA US	纽约	美国	32.00	65,464.55	0.03
402	LEIDOS HOLDING S INC	Leidos 控 股公司	LDOS US	纽约	美国	85.00	65,163.67	0.03
403	KELLAN OVA	KELLAN OVA	K US	纽约	美国	164.00	64,942.98	0.03
404	BUNGE GLOBAL SA	BUNGE GLOBAL SA	BG US	纽约	美国	90.00	64,349.87	0.03
405	PACKAG ING CORP OF AMERIC A	美国包装 公司	PKG US	纽约	美国	55.00	63,461.35	0.03
406	WR BERKLEY CORP	WR Berkley 公 司	WRB US	纽约	美国	126.00	63,111.96	0.03
407	MARATH ON OIL CORP	Marathon 石油公司	MRO US	纽约	美国	364.00	62,286.96	0.03
408	NORDS ON CORP	诺信公司	NDSN US	纳斯达 克	美国	33.00	61,741.88	0.03
409	AMCOR PLC	安姆科公 司	AMCR US	纽约	美国	899.00	61,381.23	0.03
410	DOMIN O'S PIZZA INC	达美乐披 萨公司	DPZ US	纽约	美国	21.00	61,313.73	0.03
411	HOST HOTELS & RESORT S INC	Host 酒店 及度假股 份有限公 司	HST US	纳斯达 克	美国	439.00	60,538.17	0.03

412	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉品牌股份有限公司	CAG US	纽约	美国	297.00	60,288.08	0.03
413	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CLASS A	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克	美国	31.00	60,013.35	0.03
414	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	美国联合航空控股股份有限公司	UAL US	纳斯达克	美国	204.00	59,615.37	0.03
415	KEYCORP	KeyCorp 公司	KEY US	纽约	美国	582.00	59,358.69	0.03
416	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马克公司	SJM US	纽约	美国	66.00	59,077.37	0.03
417	REVVITY INC	Revvity 股份有限公司	RVTY US	纽约	美国	76.00	58,839.96	0.03
418	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	Live Nation 娱乐公司	LYV US	纽约	美国	88.00	58,338.78	0.03
419	KIMCO REALTY CORP	Kimco Realty Corp	KIM US	纽约	美国	385.00	58,108.95	0.03
420	TRIMBLE INC	天宝股份有限公司	TRMB US	纳斯达克	美国	154.00	58,027.14	0.03
421	ALLIANT ENERGY CORP	Alliant 能源公司	LNT US	纳斯达克	美国	158.00	57,408.12	0.03
422	VIATRIS INC	晖致	VTRS US	纳斯达克	美国	746.00	57,222.41	0.03
423	GEN DIGITAL INC	Gen Digital 股份有限公司	GEN US	纳斯达克	美国	351.00	56,731.15	0.03
424	AES CORP	爱伊斯公司	AES US	纽约	美国	416.00	56,718.26	0.03

425	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ US	纳斯达克	美国	166.00	56,188.05	0.03
426	LOEWS CORP	罗斯公司	L US	纽约	美国	113.00	55,696.02	0.03
427	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP US	纽约	美国	215.00	55,048.52	0.03
428	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	Interpublic 集团	IPG US	纽约	美国	238.00	55,020.68	0.03
429	ROLLINS INC	Rollins 公司	ROL US	纽约	美国	174.00	53,818.46	0.03
430	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM US	纽约	美国	170.00	53,797.36	0.03
431	BIO-TECHNE CORP	Bio-technec 公司	TECH US	纳斯达克	美国	98.00	53,557.11	0.03
432	CARMAX INC	CarMax 股份有限公司	KMX US	纽约	美国	98.00	53,265.59	0.03
433	EVERGY INC	Evergy 股份有限公司	EVRG US	纳斯达克	美国	143.00	52,869.52	0.03
434	PENTAIR PLC	Pentair 公共有限公司	PNR US	纽约	美国	102.00	52,528.28	0.03
435	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克	美国	45.00	52,082.28	0.03
436	CHARLES RIVER LABORATORIES	查理斯河实验室国际有限公司	CRL US	纽约	美国	31.00	51,904.86	0.03
437	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS US	纽约	美国	203.00	51,372.17	0.03

438	NRG ENERGY INC	NRG 能源股份有限公司	NRG US	纽约	美国	140.00	51,264.58	0.03
439	TELEFLIX INC	泰利福公司	TFX US	纽约	美国	29.00	51,214.01	0.03
440	INCYTE CORP	因赛特公司	INCY US	纳斯达克	美国	115.00	51,143.11	0.03
441	UDR INC	UDR 公司	UDR US	纽约	美国	188.00	50,984.96	0.03
442	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	纽约	美国	115.00	49,856.19	0.03
443	ALLEGION PLC	安朗杰公共有限公司	ALLE US	纽约	美国	54.00	48,454.59	0.03
444	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克	美国	102.00	48,403.17	0.03
445	NISOURCE INC	NiSource 公司	NI US	纽约	美国	257.00	48,327.74	0.03
446	APA CORP	APA	APA US	纳斯达克	美国	190.00	48,284.18	0.03
447	QORVO INC	Qorvo 股份有限公司	QRVO US	纳斯达克	美国	60.00	47,854.97	0.03
448	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MarketAxess 控股公司	MKTX US	纳斯达克	美国	23.00	47,705.88	0.02
449	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Healthpeak Properties Inc	PEAK US	纽约	美国	340.00	47,680.74	0.02
450	F5 INC	F5 股份有限公司	FFIV US	纳斯达克	美国	37.00	46,903.48	0.02
451	WESTROCK CO	WestRock 公司	WRK US	纽约	美国	159.00	46,757.72	0.02
452	EASTMAN CHEMICAL	伊士曼化工	EMN US	纽约	美国	73.00	46,440.27	0.02

	AL CO							
453	CAMDEN PROPERTY TRUST	Camden 房地产信 托公司	CPT US	纽约	美国	66.00	46,413.92	0.02
454	CERIDIAN HCM HOLDING INC	Ceridian 人 力资本管 理控股股 份有限公 司	CDAY US	纽约	美国	97.00	46,112.91	0.02
455	BROWN- FORMAN CORP-C CLASS B	百富门公 司	BF/B US	纽约	美国	113.00	45,699.71	0.02
456	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股份有限 公司	GL US	纽约	美国	53.00	45,691.63	0.02
457	CAESAR S ENTERTAINMENT INC	凯撒娱乐 集团	CZR US	纳斯达 克	美国	134.00	44,492.95	0.02
458	SMITH (A.O.) CORP	AO 史密 斯公司	AOS US	纽约	美国	76.00	44,376.23	0.02
459	BOSTON PROPERTY TIES INC	波士顿地 产公司	BXP US	纽约	美国	89.00	44,232.38	0.02
460	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	Huntington Ingalls 工 业公司	HII US	纽约	美国	24.00	44,134.85	0.02
461	C.H. ROBINSON WORLD WIDE INC	罗宾逊全 球物流有 限公司	CHRW US	纳斯达 克	美国	72.00	44,054.96	0.02
462	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom 软 件股份有 限公司	PAYC US	纽约	美国	30.00	43,924.07	0.02

463	MATCH GROUP INC	Match 集团股份有限公司	MTCH US	纳斯达克	美国	169.00	43,689.63	0.02
464	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克	美国	81.00	43,434.73	0.02
465	BATH & BODY WORKS INC	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI US	纽约	美国	141.00	43,102.20	0.02
466	ETSY INC	Etsy 股份有限公司	ETSY US	纳斯达克	美国	74.00	42,479.91	0.02
467	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网络股份有限公司	JNPR US	纽约	美国	198.00	41,342.00	0.02
468	NEWS CORP-CLASS A	新闻集团	NWSA US	纳斯达克	美国	236.00	41,035.75	0.02
469	HORME L FOODS CORP	荷美尔食品有限公司	HRL US	纽约	美国	180.00	40,936.59	0.02
470	ROBERT HALF INC	罗致恒富国际公司	RHI US	纽约	美国	65.00	40,476.21	0.02
471	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	Universal 保健服务股份有限公司	UHS US	纽约	美国	37.00	39,948.41	0.02
472	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团公司	AAL US	纳斯达克	美国	406.00	39,510.42	0.02
473	ASSURANT INC	安信龙集团	AIZ US	纽约	美国	32.00	38,187.65	0.02
474	WYNN RESORTS LTD	永利渡假村有限公司	WYNN US	纳斯达克	美国	59.00	38,072.98	0.02
475	NORWEGIAN CRUISE	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	纽约	美国	264.00	37,471.45	0.02

	LINE HOLDIN							
476	CAMPB ELL SOUP CO	金宝汤	CPB US	纽约	美国	122.00	37,354.58	0.02
477	BORGW ARNER INC	博格华纳 股份有限 公司	BWAUS	纽约	美国	146.00	37,071.56	0.02
478	TAPEST RY INC	TPR-DRS- RS	TPR US	纽约	美国	142.00	37,021.41	0.02
479	FRANKL IN RESOUR CES INC	富兰克林 资源	BEN US	纽约	美国	175.00	36,923.89	0.02
480	CATALE NT INC	康泰伦特 股份有限 公司	CTLT US	纽约	美国	112.00	35,641.28	0.02
481	PINNAC LE WEST CAPITA L	Pinnacle 西部资本	PNW US	纽约	美国	70.00	35,617.48	0.02
482	INVESC O LTD	景顺有限 公司	IVZ US	纽约	美国	279.00	35,253.15	0.02
483	GENERA C HOLDIN GS INC	Generac 控股公司	GNRC US	纽约	美国	38.00	34,783.99	0.02
484	FMC CORP	FMC 公司	FMC US	纽约	美国	77.00	34,385.45	0.02
485	DENTSP LY SIRONA INC	登士柏西 诺德公司	XRAY US	纳斯达 克	美国	131.00	33,021.60	0.02
486	FEDERA L REALTY INVS TRUST	联邦房地 产投资信 托公司	FRT US	纽约	美国	45.00	32,844.25	0.02
487	COMERI CA INC	Comerica 公司	CMAUS	纽约	美国	82.00	32,413.41	0.02
488	FOX CORP- CLASS A	福克斯公 司	FOXAUS	纳斯达 克	美国	153.00	32,151.99	0.02

489	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	派拉蒙全球	PARA US	纳斯达克	美国	300.00	31,425.94	0.02
490	BIO-RAD LABORATORIES-A	伯乐生命医学产品有限公司	BIO US	纽约	美国	13.00	29,730.13	0.02
491	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	WHR US	纽约	美国	34.00	29,323.65	0.02
492	HASBRO INC	孩之宝	HAS US	纳斯达克	美国	81.00	29,293.06	0.02
493	ZIONS BANCO RP NA	锡安银行	ZION US	纳斯达克	美国	92.00	28,586.06	0.01
494	VF CORP	VF 公司	VFC US	纽约	美国	205.00	27,296.73	0.01
495	RALPH LAUREN CORP	拉夫劳伦	RL US	纽约	美国	24.00	24,511.81	0.01
496	DAVITA INC	DaVita 股份有限公司	DVA US	纽约	美国	33.00	24,485.46	0.01
497	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业股份有限公司	MHK US	纽约	美国	32.00	23,457.90	0.01
498	FOX CORP-CLASS B	福克斯公司	FOX US	纳斯达克	美国	82.00	16,058.61	0.01
499	NEWS CORP-CLASS B	新闻集团	NWS US	纳斯达克	美国	71.00	12,933.86	0.01

#### 8.4.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

### 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	APPLE INC	AAPL US	5,783,578.88	6.73
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	5,429,497.84	6.32
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	2,729,496.48	3.18
4	NVIDIA CORP	NVDA US	2,054,355.61	2.39
5	ALPHABET INC-CLA	GOOGL US	1,632,068.34	1.90
6	TESLA INC	TSLA US	1,562,628.91	1.82
7	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLB	BRK/B US	1,491,395.73	1.74
8	ALPHABET INC-CLC	GOOG US	1,366,423.12	1.59
9	METAPLATFORMS INC-CLASS A	META US	1,226,493.23	1.43
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	1,102,684.12	1.28
11	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,073,626.54	1.25
12	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	1,018,630.35	1.19
13	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	1,004,950.80	1.17
14	BROADCOM INC	AVGO US	901,853.70	1.05
15	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	894,261.16	1.04
16	ELI LILLY & CO	LLY US	872,318.98	1.02
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	840,598.60	0.98
18	MASTERCARD INC - A	MA US	778,019.25	0.91
19	HOME DEPOT INC	HD US	765,285.40	0.89
20	CHEVRON CORP	CVX US	704,922.02	0.82

注：1. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2. 买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	APPLE INC	AAPL US	1,630,607.70	1.90
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,338,985.35	1.56
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	583,687.44	0.68

4	RTX CORP	RTX US	512,302.67	0.60
5	NVIDIA CORP	NVDA US	480,325.93	0.56
6	ALPHABET INC-CLC	GOOG US	461,021.71	0.54
7	ALPHABET INC-CLA	GOOGL US	400,342.00	0.47
8	LOCKHEED MARTIN CORP	LMT US	379,238.23	0.44
9	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	358,207.99	0.42
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	347,929.45	0.41
11	METAPLATFORMS INC-CLASS A	METAUS	316,903.30	0.37
12	NORTHROP GRUMMAN CORP	NOC US	315,062.13	0.37
13	EXXON MOBIL CORP	XOM US	313,969.60	0.37
14	TESLA INC	TSLAUS	291,895.11	0.34
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	277,675.25	0.32
16	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	258,316.18	0.30
17	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	252,075.63	0.29
18	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	231,995.68	0.27
19	CHEVRON CORP	CVX US	220,144.53	0.26
20	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	201,864.86	0.24

注：1. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	87,593,109.11
卖出收入（成交）总额	22,783,082.03

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

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRAPRO S&P 500	ETF 基金	开放式	ProShares Trust	5,142,157.91	2.69

### 8.11 投资组合报告附注

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

**8.11.2** 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。

#### 8.11.3 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	-
2	应收清算款	6,693.15
3	应收股利	144,312.62
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	151,005.77

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 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。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		标普 500ETF 联接基金	
		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
3,148	47,934.77	23,785,598. 00	15.76%	89,430,353. 00	59.27%	37,682,700 .00	24.97%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	杨巧伟	28,438,304.00	18.85%
2	BARCLAYS BANK PLC	7,506,300.00	4.97%
3	上海伏明资产管理有限公司 — 伏明 2 号证券投资基金	4,442,600.00	2.94%
4	深圳东方港湾投资管理股份 有限公司—东方港湾马拉松 28 号私募证券投资基金	3,419,100.00	2.27%
5	严国用	3,061,800.00	2.03%
6	王水	3,000,000.00	1.99%
7	周跃平	2,123,000.00	1.41%
8	中信证券股份有限公司	1,926,610.00	1.28%
9	深圳东方港湾投资管理股份 有限公司—东方港湾华享 1 号私募证券投资基金	1,422,100.00	0.94%
10	国泰基金—中建投信托股份 有限公司—国泰基金宏观对 冲 2 号单一资产管理计划	1,102,600.00	0.73%
-	国泰标普 500 交易型开放式	37,682,700.00	24.97%

	指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)		
--	------------------------	--	--

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022 年 5 月 9 日)基金份额总额	247,898,651.00
本报告期期初基金份额总额	85,898,651.00
本报告期基金总申购份额	85,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	150,898,651.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2023 年 7 月 19 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，

经本基金管理人第八届董事会第二十二次会议审议通过,李辉先生不再担任本基金管理人副总经理。

2023 年 9 月 8 日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第八届董事会第二十三次会议审议通过,张畔先生不再担任本基金管理人副总经理。

2023 年 9 月 28 日,本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告》,经本基金管理人第八届董事会第二十四次会议审议通过,邱军女士不再担任本基金管理人董事长,总经理周向勇先生代为履行董事长职务。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内,本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自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,报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 35,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	

China Galaxy International Financial Holdings Limited	1	-	-	574.83	1.69%	-
China Merchants Securities (HK) Co. Ltd	1	-	-	64.03	0.19%	-
early redemption	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	2	103,689,526.29	94.20%	32,097.42	94.42%	-
Haitong International Securities Co Ltd	1	6,383,820.26	5.80%	1,256.35	3.70%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China Galaxy	-	-	-	-	-	-	1,330,	4.18%

International Financial Holdings Limited							441.08	
China Merchants Securities (HK) Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	125,266.82	0.39%
early redemption	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	30,397,465.85	95.43%
Haitong International Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-01-11
2	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-02-15
3	国泰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值调整的公告	《上海证券报》	2023-03-29
4	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-04-03
5	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-05-24
6	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理变更公告	《上海证券报》	2023-05-24
7	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-06-14
8	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-06-29
9	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》	2023-07-19
10	国泰基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整申购赎回替代金额处理程序的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2023-08-11
11	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-08-30

12	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》	2023-09-08
13	国泰基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告	《中国证券报》	2023-09-28
14	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-11-20
15	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购、赎回业务的公告	《上海证券报》	2023-12-20

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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03月13日至2023年03月13日	-	22,000,000.00	22,000,000.00	-	-
个人	1	2023年01月01日至2023年07月11日	34,128,905.00	20,200.00	34,113,500.00	35,605.00	0.02%
	2	2023年07月18日至2023年07月24日, 2023年09月08日至2023年09月10日, 2023年09月12日至2023年09月25日, 2023年10月17日至2023年10月19日, 2023年11月16日至2023年11月20日, 2023年12月04日至2023年12月04日, 2023年12月13日至2023年12月20日	900.00	195,911,102.00	167,473,698.00	28,438,304.00	18.85%
国泰标普 500 交易型	1	2023年10月18日至2023年12月31日	8,970,000.00	38,802,700.00	10,090,000.00	37,682,700.00	24.97%

开放式 指数证 券投资 基金发 起式联 接基金 (QDII)							
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。							

### § 13 备查文件目录

#### 13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 注册的批复
- 2、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同
- 3、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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

#### 13.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

#### 13.3 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>

二〇二四年三月二十九日