

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

2024 年中期报告

2024 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 08 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 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	5
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
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
7.4 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	39
7.4.1 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	39
7.4.2 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	77
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	77
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	79
7.7 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	79
7.8 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	79
7.9 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	79
7.10 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	80
7.11 投资组合报告附注	80

8 基金份额持有人信息	81
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	81
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
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.....	82
9 开放式基金份额变动	82
10 重大事件揭示	82
10.1 基金份额持有人大会决议.....	82
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.....	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4 基金投资策略的改变.....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
10.8 其他重大事件.....	87
11 影响投资者决策的其他重要信息	87
12 备查文件目录	88
12.1 备查文件目录.....	88
12.2 存放地点.....	88
12.3 查阅方式.....	88

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	299,898,651.00 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@gtfund.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	周向勇	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 15-20 层和本基金托管人住所

2.6 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（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	6,132,037.10
本期利润	45,948,611.55
加权平均基金份额本期利润	0.1861
本期加权平均净值利润率	13.53%
本期基金份额净值增长率	15.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	21,610,361.29
期末可供分配基金份额利润	0.0721

期末基金资产净值	438,111,468.22
期末基金份额净值	1.4609
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	46.09%

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	3.84%	0.41%	3.73%	0.40%	0.11%	0.01%
过去三个月	4.52%	0.70%	4.39%	0.70%	0.13%	0.00%
过去六个月	15.29%	0.67%	15.19%	0.67%	0.10%	0.00%
过去一年	21.41%	0.69%	21.02%	0.69%	0.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	46.09%	1.03%	42.28%	1.09%	3.81%	-0.06%

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 2024 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日为 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。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 266 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

				<p>资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2017 年 5 月至 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</p>
--	--	--	--	---

				<p>金变更注册而来)的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)的基金经理, 2019 年 7 月至 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</p>
--	--	--	--	--

					总监。
--	--	--	--	--	-----

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 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

一季度，持续超出预期的强劲的就业数据以及 ISM PMI 等经济数据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，但美联储表态暗示年内

降息，市场表现一定程度开始反映降息预期；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、美联储年内降息预期升温以及科技创新带动下，包括纳斯达克、标普 500 等为代表的美国主要股指继续上涨。

二季度，4 月美国非农就业数据强劲，而通胀超预期顽固，叠加联储官员频频放鹰，市场降息预期快速冷却，对市场风险偏好形成压制，美股下跌。5 月 FOMC 会议上美联储如期按兵不动，会后声明超预期偏鸽，随后 PMI 数据不及预期、就业市场疲软、通胀降温等事件促使市场开启新一轮降息交易，而龙头股季度业绩的超预期兑现则使市场对盈利增长的信心不减，美股反弹。6 月美联储继续维持政策利率不变，虽然数据显示美国经济韧性仍存，但是通胀延续下行趋势，且“预防式降息”预期短期难以证伪，美股继续上行。上半年来看，纳指 100 指数大幅上扬 16.98%，标普 500 上涨 14.48%。

聚焦到美股科技层面，以五大龙头为例，二季度公布的 2024 年一季度业绩普遍超预期向好，下季度业绩指引较为乐观。而作为 AI 产业链中的高确定性行业，算力板块公司业绩也保持了高速增长的趋势。考虑到美国宏观经济的韧性和生成式 AI 产业革命的潜力，后续业绩或仍有支持。AI 方面，龙头科技股均将生成式人工智能作为现阶段战略重心，并大多上调相关投入。在算力降本、模型迭代、端侧 AI 等一系列技术、应用创新的推动下，生成式 AI 行情持续演绎。我们长期看好美股科技龙头通过深厚研发实力将预期兑现为业绩的能力，以纳斯达克 100 指数为代表的美国科技板块长期具备投资价值。

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 15.29%，同期业绩比较基准收益率为 15.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，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，美国经济预计保持温和复苏态势。通胀有所回落，美联储依然有望开启降息，但降息节奏可能会较为缓慢。

接下来我们将持续关注龙头公司的业绩兑现情况。业绩的兑现是估值处于合理水平的必要条件，因此需持续跟踪传统业务利润增速和指引，以及 AI 业务贡献的增量是否符合预期。AI 技术方面，一方面我们将持续关注尖端模型能力是否能够再次升级，从而催生下游应用诞生；另一方面，我们也继续关注 B/C 端对应用产品的付费意愿。总体来看，我们看好中长期美股科技龙头利用 AI 技术

实现业绩持续增长的潜力。美国市场有望长期受益于人工智能所带来的科技创新红利，我们认为市场长期表现仍然值得期待，标普 500ETF、纳指 ETF 等依然值得关注，但短期可能需要警惕交易拥挤带来的调整。

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

托管人声明：

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遵规守信、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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,060,650.76	11,261,763.10
结算备付金		3,684,122.90	4.98
存出保证金		2,312,646.60	-
交易性金融资产	6.4.7.2	396,231,867.40	180,035,975.61
其中：股票投资		396,231,867.40	174,893,817.70
基金投资		-	5,142,157.91
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	30,005,052.05	-
应收清算款		10,838.94	6,693.15
应收股利		201,895.14	144,312.62
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		438,507,073.79	191,448,749.46
负债和净资产			
	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		207,445.95	93,678.46
应付托管费		51,861.49	23,419.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		56,735.01	4,543.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	79,563.12	115,000.00
负债合计		395,605.57	236,641.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	299,898,651.00	150,898,651.00
未分配利润	6.4.7.8	138,212,817.22	40,313,457.00
净资产合计		438,111,468.22	191,212,108.00
负债和净资产总计		438,507,073.79	191,448,749.46

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4609 元，基金份额总额 299,898,651.00 份。

6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		47,325,399.26	23,954,999.17
1.利息收入		127,516.22	35,475.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	94,402.70	35,386.50
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		33,113.52	-
其他利息收入		-	89.36
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,056,777.98	1,775,204.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	999,064.49	115,551.32
基金投资收益	6.4.7.11	3,221,851.59	826,449.97
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	846,539.37	-
股利收益	6.4.7.14	1,989,322.53	833,203.70
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.15	39,816,574.45	22,072,561.92

填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-2,369,831.27	33,903.16
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	2,694,361.88	37,853.24
减: 二、营业总支出		1,376,787.71	522,424.53
1. 管理人报酬		1,009,104.30	353,175.38
2. 托管费		252,276.06	88,293.84
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		14,794.23	3,013.54
8. 其他费用	6.4.7.17	100,613.12	77,941.77
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		45,948,611.55	23,432,574.64
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		45,948,611.55	23,432,574.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		45,948,611.55	23,432,574.64

6.3 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: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	150,898,651.00	40,313,457.00	191,212,108.00
二、本期期初净资产	150,898,651.00	40,313,457.00	191,212,108.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	149,000,000.00	97,899,360.22	246,899,360.22
(一)、综合收益总额	-	45,948,611.55	45,948,611.55
(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)	149,000,000.00	51,950,748.67	200,950,748.67

号填列)			
其中：1.基金申购款	155,000,000.00	54,240,530.98	209,240,530.98
2.基金赎回款	-6,000,000.00	-2,289,782.31	-8,289,782.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	299,898,651.00	138,212,817.22	438,111,468.22
项目	上年度可比期间 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	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)	38,000,000.00	25,199,772.89	63,199,772.89
(一)、综合收益总额	-	23,432,574.64	23,432,574.64
(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)	38,000,000.00	1,767,198.25	39,767,198.25
其中：1.基金申购款	50,000,000.00	2,146,785.19	52,146,785.19
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-379,586.94	-12,379,586.94
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	123,898,651.00	25,184,180.60	149,082,831.60

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：李昇，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 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<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 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	6,060,650.76
等于：本金	6,059,376.78
加：应计利息	1,273.98
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	6,060,650.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	328,084,855.94	-	396,231,867.40	68,147,011.46
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	328,084,855.94	-	396,231,867.40	68,147,011.46

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	39,445,188.82	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	39,445,188.82	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ES2409	S&P500 EMINI Sep24	20.00	39,350,626.20	-94,562.62
合计	-	-	-	-94,562.62
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	-94,562.62
净额	-	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	30,005,052.05	-
银行间市场	-	-
合计	30,005,052.05	-

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

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	
其中：交易所市场	
银行间市场	
应付利息	
预提费用	79,563.12
合计	79,563.12

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	150,898,651.00	150,898,651.00
本期申购	155,000,000.00	155,000,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	299,898,651.00	299,898,651.00

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。

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	7,566,054.69	32,747,402.31	40,313,457.00
本期期初	7,566,054.69	32,747,402.31	40,313,457.00
本期利润	6,132,037.10	39,816,574.45	45,948,611.55
本期基金份额交易产生的变动数	7,912,269.50	44,038,479.17	51,950,748.67
其中：基金申购款	8,246,055.05	45,994,475.93	54,240,530.98
基金赎回款	-333,785.55	-1,955,996.76	-2,289,782.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,610,361.29	116,602,455.93	138,212,817.22

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	454.76
其他	-
合计	94,402.70

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	999,064.49
股票投资收益——赎回差价收入	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	999,064.49

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,717,130.41
减：卖出股票成本总额	10,685,947.85
减：交易费用	32,118.07
买卖股票差价收入	999,064.49

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	8,289,782.31
减：现金支付赎回款总额	8,289,782.31
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	0.00

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	13,840,998.04
减：卖出/赎回基金成本总额	10,515,936.33
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	96,846.47
减：交易费用	6,363.65
基金投资收益	3,221,851.59

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
买卖股指期货差价收入	846,539.37

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,971,768.88
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	17,553.65
合计	1,989,322.53

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	39,911,137.07
——股票投资	40,979,870.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,068,733.58
——其他	-
2.衍生工具	-94,562.62
——权证投资	-
——股指期货	-94,562.62
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	39,816,574.45

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	2,694,361.88

合计	2,694,361.88
----	--------------

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。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	21,050.00
合计	100,613.12

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
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
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,009,104.30	353,175.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	356.32	-
应支付基金管理人的净管理费	1,008,747.98	353,175.38

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	252,276.06	88,293.84

注：支付基金托管人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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的	持有的基金	持有的	持有的基金份额

	基金份额	份额占基金总份额的比例	基金份额	额占基金总份额的比例
国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII)	116,817,982.00	38.95%	37,682,700.00	24.97%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
招商银行	5,498,952.66	23,910.03	4,752,650.36	6,314.76
香港上海汇丰银行	561,698.10	70,037.91	4,110,541.20	29,071.74

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香港上海汇丰银行保管，按适用利率计息。

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

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 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，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，将风险控制可在承受的范围内。

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招商银行及境外资产托管人香港上海汇丰银行，与该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通过有资格的经纪商进行为交易对手完成证券交收和款项

清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2024 年 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》、《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。

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、买入返售金融资产、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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,060,650.76	-	-	-	6,060,650.76
结算备付金	150,067.50	-	-	3,534,055.40	3,684,122.90
存出保证金	-	-	-	2,312,646.60	2,312,646.60
交易性金融资产	-	-	-	396,231,867.40	396,231,867.40

					0
买入返售金融资产	30,005,052.05	-	-	-	30,005,052.05
应收清算款	-	-	-	10,838.94	10,838.94
应收股利	-	-	-	201,895.14	201,895.14
资产总计	36,215,770.31	-	-	402,291,303.48	438,507,073.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	207,445.95	207,445.95
应付托管费	-	-	-	51,861.49	51,861.49
应交税费	-	-	-	56,735.01	56,735.01
其他负债	-	-	-	79,563.12	79,563.12
负债总计	-	-	-	395,605.57	395,605.57
利率敏感度缺口	36,215,770.31	-	-	401,895,697.91	438,111,468.22
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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

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 2024 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%（2023 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（2023 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。本基金持有以非记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的 资产		
货币资金	561,866.22	561,866.22
结算备付金	3,534,055.40	3,534,055.40
存出保证金	2,312,646.60	2,312,646.60
交易性金融资产	396,231,867.40	396,231,867.40
应收股利	201,895.14	201,895.14
应收清算款	6,734.83	6,734.83
资产合计	402,849,065.59	402,849,065.59
以外币计价的 负债		
负债合计	-	-
资产负债表外	402,849,065.59	402,849,065.59

汇风险敞口净额		
项目	上年度末 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 汇风险敞口净额	186,653,214.79	186,653,214.79

6.4.13.4.2.2 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: 人民币万元)	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 2,014	增加约 933
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 2,014	减少约 933

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	396,231,867.40	90.44	174,893,817.70	91.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	5,142,157.91	2.69
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	396,231,867.40	90.44	180,035,975.61	94.16

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,183	增加约 954
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,183	减少约 954

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	396,231,867.40	180,035,975.61
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	396,231,867.40	180,035,975.61

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。

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 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（2023 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 2024 上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 209,240,530.98 元（2023 上半年度：52,146,785.19 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 209,240,530.98 元（2023 上半年度：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 52,146,785.19 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	396,231,867.40	90.36
	其中：普通股	388,066,600.14	88.50
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	8,165,267.26	1.86
2	基金投资	-	-
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	30,005,052.05	6.84
	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	9,744,773.66	2.22
8	其他各项资产	2,525,380.68	0.58
9	合计	438,507,073.79	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 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	396,231,867.40	90.44
合计	396,231,867.40	90.44

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 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	130,675,602.06	29.83
医疗保健	47,190,082.10	10.77
金融	46,362,728.02	10.58

非日常生活消费品	39,850,107.81	9.10
通讯业务	37,635,660.62	8.59
工业	30,143,091.33	6.88
日常消费品	23,225,898.69	5.30
能源	14,700,215.96	3.36
公用事业	9,108,372.26	2.08
原材料	8,673,455.02	1.98
房地产	8,666,653.53	1.98
合计	396,231,867.40	90.44

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.3.2 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权益投资。

7.4 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

7.4.1 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	MICROS OFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达 克	美国	9,165.00	29,193,487.68	6.66
2	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达 克	美国	30,334.00	26,707,414.75	6.10
3	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克	美国	17,775.00	26,681,103.60	6.09
4	ALPHAB ET INC	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	7,243.00	9,402,475.97	2.15
			GOOG US	纳斯达 克	美国	6,026.00	7,877,173.08	1.80
5	AMAZO N.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达 克	美国	11,293.00	15,553,330.55	3.55
6	META PLATFO RMS INC	Meta 平台 股份有限 公司	META US	纳斯达 克	美国	2,702.00	9,709,569.71	2.22
7	BERKSH IRE HATHAW AY INC	伯克希尔 哈撒韦公 司	BRK/B US	纽约	美国	2,232.00	6,470,974.76	1.48

8	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽约	美国	984.00	6,349,222.79	1.45
9	BROADC OM INC	博通股份 有限公司	AVGO US	纳斯达 克	美国	537.00	6,144,510.38	1.40
10	JPMORG AN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽约	美国	3,541.00	5,104,233.12	1.17
11	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克	美国	3,421.00	4,824,469.30	1.10
12	EXXON MOBIL CORP	埃克森美 孚石油公 司	XOM US	纽约	美国	5,531.00	4,537,838.24	1.04
13	UNITED HEALTH GROUP INC	联合健康 集团	UNH US	纽约	美国	1,134.00	4,115,732.99	0.94
14	PROCTE R & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	纽约	美国	2,910.00	3,420,273.90	0.78
15	COSTCO WHOLE SALE CORP	开市客	COST US	纳斯达 克	美国	546.00	3,307,508.97	0.75
16	MASTER CARD INC	万事达股 份有限公 司	MA US	纽约	美国	1,012.00	3,181,787.80	0.73
17	JOHNSO N & JOHNSO N	强生	JNJ US	纽约	美国	2,967.00	3,090,584.71	0.71
18	HOME DEPOT INC/THE	家得宝	HD US	纽约	美国	1,222.00	2,997,968.81	0.68
19	MERCK & CO INC	默克	MRK US	纽约	美国	3,123.00	2,755,416.15	0.63
20	ABBVIE INC	艾伯维公 司	ABBV US	纽约	美国	2,177.00	2,661,140.28	0.61
21	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达 克	美国	531.00	2,553,969.17	0.58
22	WALMA	沃尔玛股	WMT US	纽约	美国	5,267.00	2,541,620.49	0.58

	RT INC	份有限公司						
23	BANK OF AMERICA CORP	美国银行公司	BAC US	纽约	美国	8,391.00	2,378,284.93	0.54
24	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	纽约	美国	2,114.00	2,356,632.35	0.54
25	ADVANCED MICRO DEVICES INC	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	1,993.00	2,303,984.19	0.53
26	SALESFORCE INC	Salesforce 股份有限公司	CRM US	纽约	美国	1,197.00	2,193,263.44	0.50
27	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	纳斯达克	美国	552.00	2,185,490.80	0.50
28	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	纽约	美国	4,781.00	2,168,761.14	0.50
29	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纳斯达克	美国	1,695.00	1,992,342.20	0.45
30	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	纽约	美国	1,965.00	1,977,387.67	0.45
31	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	1,378.00	1,956,093.08	0.45
32	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	纽约	美国	471.00	1,856,267.71	0.42
33	LINDE PLC	Linde PLC	LIN US	纳斯达克	美国	592.00	1,851,368.18	0.42
34	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽约	美国	4,300.00	1,820,020.80	0.42
35	APPLIED MATERIALS INC	应用材料	AMAT US	纳斯达克	美国	1,024.00	1,722,218.02	0.39
36	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克	美国	4,993.00	1,690,601.18	0.39
37	ACCENTURE PLC	埃森哲公司	ACN US	纽约	美国	775.00	1,675,815.35	0.38

38	INTUIT INC	Intuit 股份有限公司	INTU US	纳斯达克	美国	345.00	1,615,912.46	0.37
39	MCDONALD'S CORP	麦当劳	MCD US	纽约	美国	888.00	1,612,780.02	0.37
40	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼公司	DIS US	纽约	美国	2,248.00	1,590,729.70	0.36
41	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽约	美国	2,145.00	1,588,470.72	0.36
42	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纳斯达克	美国	1,122.00	1,555,514.33	0.36
43	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	纽约	美国	1,349.00	1,528,346.04	0.35
44	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	纽约	美国	5,190.00	1,525,388.91	0.35
45	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	纳斯达克	美国	661.00	1,471,894.08	0.34
46	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	纽约	美国	812.00	1,445,872.36	0.33
47	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT US	纽约	美国	604.00	1,433,858.00	0.33
48	SERVICENOW INC	ServiceNow 公司	NOW US	纽约	美国	252.00	1,412,822.82	0.32
49	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM US	纽约	美国	1,132.00	1,395,280.63	0.32
50	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约	美国	6,987.00	1,393,262.75	0.32
51	INTUITIVE	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克	美国	437.00	1,385,446.00	0.32

	SURGICAL INC							
52	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	菲利普莫里斯国际集团公司	PM US	纽约	美国	1,917.00	1,384,378.12	0.32
53	COMCAST CORP	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克	美国	4,827.00	1,347,145.65	0.31
54	UBER TECHNOLOGIES INC	优步技术股份有限公司	UBER US	纽约	美国	2,576.00	1,334,305.72	0.30
55	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	高盛	GS US	纽约	美国	398.00	1,282,990.48	0.29
56	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克	美国	1,365.00	1,279,534.63	0.29
57	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE US	纽约	美国	2,533.00	1,278,275.18	0.29
58	S&P GLOBAL INC	标普全球	SPGI US	纽约	美国	394.00	1,252,349.80	0.29
59	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纳斯达克	美国	804.00	1,223,572.93	0.28
60	LAM RESEARCH CORP	泛林集团	LRCX US	纳斯达克	美国	161.00	1,221,824.65	0.28
61	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽约	美国	752.00	1,212,607.35	0.28
62	AT&T INC	美国电话电报公司	T US	纽约	美国	8,842.00	1,204,219.81	0.27
63	BOOKING HOLDING	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	纳斯达克	美国	42.00	1,185,778.36	0.27

	GS INC							
64	CONOCO PHILLIP S	康菲石油	COP US	纽约	美国	1,442.00	1,175,465.60	0.27
65	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达 克	美国	5,249.00	1,158,543.51	0.26
66	AMERIC AN EXPRES S CO	美国运通	AXP US	纽约	美国	700.00	1,155,147.38	0.26
67	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	纽约	美国	705.00	1,107,677.90	0.25
68	ELEVAN CE HEALTH INC	Elevance 健康股份 有限公司	ELV US	纽约	美国	286.00	1,104,454.16	0.25
69	EATON CORP PLC	伊顿	ETN US	纽约	美国	493.00	1,101,661.81	0.25
70	TJX COS INC/THE	TJX 公司	TJX US	纽约	美国	1,396.00	1,095,386.31	0.25
71	PROGRE SSIVE CORP/TH E	前进保险 公司	PGR US	纽约	美国	722.00	1,068,782.11	0.24
72	MORGA N STANLE Y	摩根士丹 利	MS US	纽约	美国	1,543.00	1,068,764.65	0.24
73	CITIGRO UP INC	花旗集团	C US	纽约	美国	2,352.00	1,063,731.34	0.24
74	VERTEX PHARM ACEUTI CAL S INC	福泰制药	VRTX US	纳斯达 克	美国	318.00	1,062,270.64	0.24
75	STRYKE R CORP	史赛克	SYK US	纽约	美国	418.00	1,013,605.57	0.23
76	BOSTON SCIENTI FIC CORP	波士顿科 学	BSX US	纽约	美国	1,812.00	994,488.78	0.23
77	ANALOG DEVICES	亚德诺半 导体	ADI US	纳斯达 克	美国	611.00	993,952.42	0.23

	INC							
78	KLA CORP	KLA 公司	KLAC US	纳斯达克	美国	166.00	975,435.57	0.22
79	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克	美国	130.00	973,762.48	0.22
80	CHARLES SCHWAB CORP/THE	嘉信理财	SCHW US	纽约	美国	1,841.00	966,845.14	0.22
81	BLACKROCK INC	贝莱德有限公司	BLK US	纽约	美国	172.00	965,104.41	0.22
82	PALO ALTO NETWORKS INC	Palo Alto Networks 股份有限公司	PANW US	纳斯达克	美国	398.00	961,590.47	0.22
83	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽约	美国	711.00	922,272.85	0.21
84	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约	美国	1,637.00	918,275.85	0.21
85	PROLOGIS INC	安博	PLD US	纽约	美国	1,141.00	913,268.85	0.21
86	MARSH & MCLENNAN COS INC	Marsh & McLennan 股份有限公司	MMC US	纽约	美国	607.00	911,567.89	0.21
87	CHUBB LTD	邱博保险集团	CB US	纽约	美国	500.00	908,952.07	0.21
88	UNITED PARCEL SERVICE INC	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	纽约	美国	899.00	876,797.02	0.20
89	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	ADP 公司	ADP US	纳斯达克	美国	504.00	857,352.33	0.20
90	DEERE & CO	迪尔	DE US	纽约	美国	319.00	849,428.82	0.19

91	CIGNA GROUP/ THE	信诺集团	CI US	纽约	美国	351.00	826,923.10	0.19
92	NIKE INC	耐克公司	NKE US	纽约	美国	1,493.00	801,960.35	0.18
93	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克	美国	636.00	798,561.36	0.18
94	SYNOPSIS INC	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克	美国	188.00	797,284.24	0.18
95	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT US	纽约	美国	575.00	796,551.75	0.18
96	ARISTA NETWORKS INC	Arista 网络股份有限公司	ANET US	纽约	美国	313.00	781,811.67	0.18
97	BLACKSTONE INC	黑石集团股份有限公司	BX US	纽约	美国	881.00	777,304.40	0.18
98	CROWD STRIKE HOLDINGS INC	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克	美国	284.00	775,580.85	0.18
99	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克	美国	1,396.00	774,530.65	0.18
100	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	亿滋国际	MDLZ US	纳斯达克	美国	1,654.00	771,388.87	0.18
101	FISERV INC	Fiserv 公司	FI US	纽约	美国	722.00	766,892.71	0.18
102	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克	美国	1,536.00	751,057.53	0.17
103	SOUTHERN CO/THE	南方公司	SO US	纽约	美国	1,348.00	745,209.28	0.17
104	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝公司	BMY US	纽约	美国	2,499.00	739,644.03	0.17

105	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG US	纽约	美国	1,650.00	736,715.13	0.17
106	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	Cadence 设计系统 股份有限公司	CDNS US	纳斯达克	美国	335.00	734,746.35	0.17
107	AMPHENOL CORP	安费诺公司	APH US	纽约	美国	1,482.00	711,556.39	0.16
108	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	纽约	美国	1,011.00	699,192.10	0.16
109	ZOETIS INC	硕腾股份有限公司	ZTS US	纽约	美国	562.00	694,352.15	0.16
110	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	洲际交易所 (ICE)	ICE US	纽约	美国	707.00	689,740.47	0.16
111	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	纽约	美国	2,119.00	687,881.94	0.16
112	WASTE MANAGEMENT INC	废品管理	WM US	纽约	美国	450.00	684,194.18	0.16
113	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK US	纽约	美国	951.00	679,317.52	0.16
114	MCKESSON CORP	McKesson 公司	MCK US	纽约	美国	160.00	665,973.80	0.15
115	TRANE TECHNOLOGIES PLC	特灵科技 公共有限公司	TT US	纽约	美国	279.00	654,036.91	0.15
116	CVS HEALTH CORP	CVS 健康 公司	CVS US	纽约	美国	1,548.00	651,566.83	0.15
117	EOG RESOUR	EOG 资源	EOG US	纽约	美国	709.00	636,008.67	0.15

	CES INC							
118	EQUINIX INC	Equinix 有限公司	EQIX US	纳斯达克	美国	117.00	630,880.01	0.14
119	TRANSDIGM GROUP INC	TransDigm 集团公司	TDG US	纽约	美国	69.00	628,263.70	0.14
120	CME GROUP INC	芝加哥商业交易所	CME US	纳斯达克	美国	444.00	622,101.22	0.14
121	KKR & CO INC	KKR & Co 有限公司	KKR US	纽约	美国	820.00	615,020.03	0.14
122	FREEPORT-MCMORAN INC	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	纽约	美国	1,771.00	613,407.95	0.14
123	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣伟公司	SHW US	纽约	美国	287.00	610,406.22	0.14
124	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克	美国	315.00	604,091.44	0.14
125	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT US	纽约	美国	570.00	601,379.34	0.14
126	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽约	美国	280.00	598,331.92	0.14
127	BECTON DICKINSON & CO	碧迪	BDX US	纽约	美国	356.00	592,955.18	0.14
128	SCHLUMBERGER NV	斯伦贝谢公众有限公司	SLB US	纽约	美国	1,762.00	592,459.15	0.14
129	AIRBNB INC	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克	美国	544.00	587,866.36	0.13
130	MOODY'S CORP	穆迪	MCO US	纽约	美国	193.00	578,977.60	0.13
131	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	纽约	美国	280.00	578,975.53	0.13
132	CSX	CSX 公司	CSX US	纳斯达克	美国	2,411.00	574,761.81	0.13

	CORP			克				
133	PARKER-HANNIFIN CORP	派克汉尼汾公司	PH US	纽约	美国	158.00	569,559.46	0.13
134	ILLINOIS TOOL WORKS INC	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW US	纽约	美国	334.00	564,048.02	0.13
135	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	纽约	美国	205.00	564,016.73	0.13
136	AON PLC	怡安集团	AON US	纽约	美国	268.00	560,732.63	0.13
137	CONSTELLATION ENERGY CORP	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克	美国	389.00	555,213.57	0.13
138	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR US	纽约	美国	705.00	553,487.24	0.13
139	HCA HEALTH CARE INC	HCA 医疗保健有限公司	HCA US	纽约	美国	240.00	549,527.59	0.13
140	WELLTOWER INC	Welltower Inc	WELL US	纽约	美国	737.00	547,568.08	0.12
141	US BANCORP	美国合众银行	USB US	纽约	美国	1,924.00	544,364.94	0.12
142	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	PNC 财务服务	PNC US	纽约	美国	490.00	542,956.68	0.12
143	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'Reilly 汽车股份有限公司	ORLY US	纳斯达克	美国	72.00	541,895.65	0.12
144	MARATHON PETROLEUM	马拉松石油公司	MPC US	纽约	美国	435.00	537,815.41	0.12

	CORP							
145	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	纳斯达克	美国	1,290.00	533,502.98	0.12
146	ECOLAB INC	艺康集团	ECL US	纽约	美国	313.00	530,903.84	0.12
147	ROPER TECHNOLOGIES INC	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克	美国	132.00	530,256.16	0.12
148	CINTAS CORP	Cintas 公司	CTAS US	纳斯达克	美国	106.00	529,004.97	0.12
149	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX US	纽约	美国	523.00	526,185.26	0.12
150	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD	万豪国际	MAR US	纳斯达克	美国	296.00	510,021.75	0.12
151	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	空气产品公司	APD US	纽约	美国	274.00	503,905.38	0.12
152	ARTHUR J GALLAGHER & CO	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG US	纽约	美国	269.00	497,125.59	0.11
153	3M CO	3M 公司	MMM US	纽约	美国	682.00	496,692.21	0.11
154	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	爱德华生命科学公司	EW US	纽约	美国	743.00	489,118.77	0.11
155	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT US	纽约	美国	308.00	478,960.87	0.11
156	PACCAR INC	帕卡	PCAR US	纳斯达克	美国	646.00	473,926.78	0.11
157	GENERAL	通用汽车公司	GM US	纽约	美国	1,408.00	466,204.47	0.11

	MOTORS CO							
158	CAPITAL ONE FINANCI AL CORP	第一资本 金融	COF US	纽约	美国	471.00	464,738.27	0.11
159	CARRIE R GLOBAL CORP	开利全球 公司	CARR US	纽约	美国	1,033.00	464,393.98	0.11
160	AUTODE SK INC	欧特克	ADSK US	纳斯达 克	美国	263.00	463,807.51	0.11
161	TRUIST FINANCI AL CORP	Truist 金融 公司	TFC US	纽约	美国	1,650.00	456,845.70	0.10
162	WILLIA MS COS INC/THE	威廉姆斯 公司	WMB US	纽约	美国	1,502.00	454,939.28	0.10
163	VALERO ENERGY CORP	Valero 能 源	VLO US	纽约	美国	404.00	451,347.66	0.10
164	AUTOZO NE INC	AutoZone 股份有限 公司	AZO US	纽约	美国	21.00	443,615.51	0.10
165	MICROC HIP TECHNO LOGY INC	微芯科技 股份有限 公司	MCHP US	纳斯达 克	美国	666.00	434,300.07	0.10
166	SIMON PROPER TY GROUP INC	西蒙房地 产集团公 司	SPG US	纽约	美国	401.00	433,821.14	0.10
167	DIGITAL REALTY TRUST INC	数字房地 产信托有 限公司	DLR US	纽约	美国	400.00	433,451.98	0.10
168	AMERIC AN INTERN ATIONA L GROUP INC	美国国际 集团	AIG US	纽约	美国	819.00	433,327.68	0.10
169	FORD	福特汽车	F US	纽约	美国	4,835.00	432,104.30	0.10

	MOTOR CO							
170	ROSS STORES INC	罗斯百货 股份有限 公司	ROST US	纳斯达 克	美国	413.00	427,730.30	0.10
171	NORFOLK SOUTHE RN CORP	诺福克南 方	NSC US	纽约	美国	278.00	425,354.65	0.10
172	NEWMO NT CORP	纽蒙黄金 公司	NEM US	纽约	美国	1,422.00	424,323.54	0.10
173	SEMPRA	Sempra	SRE US	纽约	美国	780.00	422,810.24	0.10
174	ONEOK INC	Oneok 股 份有限公 司	OKE US	纽约	美国	719.00	417,876.00	0.10
175	COPART INC	Copart 股 份有限公 司	CPRT US	纳斯达 克	美国	1,078.00	416,094.51	0.09
176	GE VERNVO VA INC	通用电气 Vernova 股 份有限公 司	GEV US	纽约	美国	337.00	411,920.99	0.09
177	KIMBER LY-CLAR K CORP	金佰利	KMB US	纽约	美国	415.00	408,743.36	0.09
178	TRAVEL ERS COS INC/THE	旅行家集 团	TRV US	纽约	美国	282.00	408,664.11	0.09
179	AMERIC AN ELECTRI C POWER CO INC	美国电力	AEP US	纳斯达 克	美国	650.00	406,448.53	0.09
180	AFLAC INC	家庭人寿 保险	AFL US	纽约	美国	638.00	406,083.50	0.09
181	TE CONNEC TIVITY LTD	泰科电子 公司	TEL US	纽约	美国	377.00	404,175.87	0.09
182	REALTY INCOME CORP	Realty Income 公 司	O US	纽约	美国	1,073.00	403,917.52	0.09
183	PUBLIC	公共存储	PSA US	纽约	美国	195.00	399,754.68	0.09

	STORAGE							
184	HUMAN A INC	Humana 股 份有限公 司	HUM US	纽约	美国	149.00	396,776.39	0.09
185	DEXCO M INC	Dexcom 股 份有限公 司	DXCM US	纳斯达 克	美国	490.00	395,937.93	0.09
186	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/TH E	纽约梅隆 银行股份 有限公司	BK US	纽约	美国	923.00	393,958.60	0.09
187	JOHNSO N CONTRO LS INTERN ATIONA L PLC	江森自控 国际有限 公司	JCI US	纽约	美国	831.00	393,659.99	0.09
188	UNITED RENTAL S INC	联合租赁 公司	URI US	纽约	美国	82.00	377,947.46	0.09
189	L3HARRI S TECHNO LOGIES INC	L3Harris Technologi es 股份有 限公司	LHX US	纽约	美国	233.00	372,925.06	0.09
190	CROWN CASTLE INC	冠城股份 有限公司	CCI US	纽约	美国	535.00	372,514.27	0.09
191	AMERIP RISE FINANCI AL INC	阿默普莱 斯金融公 司	AMP US	纽约	美国	122.00	371,428.72	0.08
192	ALLSTAT E CORP/TH E	好事达保 险公司	ALL US	纽约	美国	325.00	369,806.09	0.08
193	PRUDEN TIAL FINANCI AL INC	保德信金 融集团	PRU US	纽约	美国	442.00	369,153.84	0.08
194	METLIFE	大都会集	MET US	纽约	美国	737.00	368,669.58	0.08

	INC	团						
195	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	繁德信息技术有限公司	FIS US	纽约	美国	686.00	368,433.89	0.08
196	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽约	美国	820.00	368,345.81	0.08
197	DR HORTON INC	霍顿房屋公司	DHI US	纽约	美国	365.00	366,598.67	0.08
198	CONSTELLATION BRANDS INC	星座品牌股份有限公司	STZ US	纽约	美国	198.00	363,049.45	0.08
199	SUPER MICRO COMPUTER INC	Super Micro Computer 股份有限公司	SMCI US	纳斯达克	美国	62.00	362,039.30	0.08
200	DOMINION ENERGY INC	Dominion 能源股份有限公司	D US	纽约	美国	1,033.00	360,737.24	0.08
201	HESS CORP	赫斯公司	HES US	纽约	美国	340.00	357,457.48	0.08
202	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	芯源系统有限公司	MPWR US	纳斯达克	美国	60.00	351,356.94	0.08
203	IDEXX LABORATORIES INC	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克	美国	101.00	350,689.87	0.08
204	REPUBLIC SERVICES INC	公共服务公司	RSG US	纽约	美国	252.00	349,025.62	0.08

205	MODERNA INC	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克	美国	411.00	347,832.38	0.08
206	OTIS WORLDWIDE CORP	奥的斯电梯公司	OTIS US	纽约	美国	498.00	341,640.83	0.08
207	WW GRAINGER INC	固安捷股份有限公司	GWV US	纽约	美国	53.00	340,794.45	0.08
208	AMETEK INC	阿美特克股份有限公司	AME US	纽约	美国	285.00	338,611.02	0.08
209	VERISK ANALYTICS INC	Verisk 分析公司	VRSK US	纳斯达克	美国	176.00	338,101.09	0.08
210	IQVIA HOLDINGS INC	艾昆纬	IQV US	纽约	美国	224.00	337,543.49	0.08
211	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽约	美国	2,381.00	337,172.26	0.08
212	FORTINET INC	Fortinet 股份有限公司	FTNT US	纳斯达克	美国	781.00	335,464.68	0.08
213	PAYCHEX INC	Paychex 公司	PAYX US	纳斯达克	美国	395.00	333,756.60	0.08
214	AGILENT TECHNOLOGIES INC	安捷伦	A US	纽约	美国	361.00	333,508.80	0.08
215	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	纽约	美国	296.00	333,474.95	0.08
216	MSCI INC	MSCI 明晟	MSCI US	纽约	美国	97.00	333,033.58	0.08
217	CUMMINS INC	康明斯	CMI US	纽约	美国	168.00	331,568.95	0.08
218	ARCH CAPITAL GROUP LTD	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克	美国	461.00	331,469.53	0.08
219	ROYAL CARIBBEAN	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL US	纽约	美国	291.00	330,641.69	0.08

	CRUISES LTD	司						
220	CORTEVA INC	科迪华公司	CTVA US	纽约	美国	859.00	330,216.43	0.08
221	PG&E CORP	太平洋煤气电力	PCG US	纽约	美国	2,635.00	327,883.40	0.07
222	DOW INC	陶氏公司	DOW US	纽约	美国	867.00	327,792.53	0.07
223	YUM! BRANDS INC	百胜餐饮集团	YUM US	纽约	美国	347.00	327,573.53	0.07
224	CENCORA INC	Cencora 股份有限公司	COR US	纽约	美国	204.00	327,556.28	0.07
225	QUANTA SERVICES INC	Quanta 服务股份有限公司	PWR US	纽约	美国	180.00	325,952.75	0.07
226	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	公共服务企业集团	PEG US	纽约	美国	614.00	322,500.53	0.07
227	INGERSOLL RAND INC	英格索兰股份有限公司	IR US	纽约	美国	497.00	321,757.06	0.07
228	LENNAR CORP	Lennar 公司	LEN US	纽约	美国	301.00	321,496.15	0.07
229	FAIR ISAAC CORP	费埃哲公司	FICO US	纽约	美国	30.00	318,281.46	0.07
230	FASTENAL CO	法思诺公司	FAST US	纳斯达克	美国	706.00	316,180.77	0.07
231	GENERAL MILLS INC	通用磨坊	GIS US	纽约	美国	696.00	313,785.59	0.07
232	DIAMONDBACK ENERGY INC	Diamondback 能源股份有限公司	FANG US	纳斯达克	美国	219.00	312,450.39	0.07
233	SYSCO CORP	Sysco 公司	SYU US	纽约	美国	614.00	312,392.30	0.07
234	MONSTER	怪兽饮料	MNST US	纳斯达	美国	874.00	311,129.72	0.07

	R BEVERA GE CORP	公司		克				
235	CENTEN E CORP	Centene 公 司	CNC US	纽约	美国	658.00	310,909.50	0.07
236	BAKER HUGHES CO	贝克休斯 公司	BKR US	纳斯达 克	美国	1,230.00	308,298.95	0.07
237	KEURIG DR PEPPER INC	Keurig Dr Pepper 有 限公司	KDP US	纳斯达 克	美国	1,287.00	306,351.20	0.07
238	KENVUE INC	Kenvue Inc	KVUE US	纽约	美国	2,361.00	305,903.49	0.07
239	EXELON CORP	Exelon 公 司	EXC US	纳斯达 克	美国	1,233.00	304,129.99	0.07
240	GARTNE R INC	Gartner 公 司	IT US	纽约	美国	95.00	304,034.28	0.07
241	LULULE MON ATHLETI CA INC	Lululemon Athletica 股份有限 公司	LULU US	纳斯达 克	美国	141.00	300,157.30	0.07
242	ELECTR ONIC ARTS INC	电子艺界	EA US	纳斯达 克	美国	300.00	297,893.11	0.07
243	COGNIZ ANT TECHNO LOGY SOLUTI ONS CORP	高知特科 技公司	CTSH US	纳斯达 克	美国	613.00	297,073.53	0.07
244	DUPONT DE NEMOU RS INC	杜邦公司	DD US	纽约	美国	516.00	295,996.24	0.07
245	BIOGEN INC	渤健公司	BIIB US	纳斯达 克	美国	179.00	295,732.12	0.07
246	KROGER CO/THE	克罗格公 司	KR US	纽约	美国	825.00	293,568.93	0.07
247	MARTIN MARIET TA MATERI	Martin Marietta 材料股份 有限公司	MLM US	纽约	美国	76.00	293,458.82	0.07

	ALS INC							
248	GE HEALTH CARE TECHNO LOGIES INC	GE HealthCare Technologi es Inc	GEHC US	纳斯达 克	美国	523.00	290,432.49	0.07
249	EXTRA SPACE STORAG E INC	Extra Space Storage 有 限公司	EXR US	纽约	美国	261.00	289,077.33	0.07
250	VULCAN MATERI ALS CO	Vulcan 材 料	VMC US	纽约	美国	163.00	288,883.70	0.07
251	DISCOV ER FINANCI AL SERVICE S	Discover 金 融服务公 司	DFS US	纽约	美国	309.00	288,067.32	0.07
252	XYLEM INC/NY	赛莱默公 司	XYL US	纽约	美国	298.00	288,049.15	0.07
253	OLD DOMINI ON FREIGHT LINE INC	Old Dominion Freight Line 股份 有限公司	ODFL US	纳斯达 克	美国	219.00	275,631.84	0.06
254	ROCKW ELL AUTOMA TION INC	罗克韦尔 自动化	ROK US	纽约	美国	140.00	274,661.17	0.06
255	CONSOL IDATED EDISON INC	联合爱迪 生	ED US	纽约	美国	426.00	271,480.62	0.06
256	DELTA AIR LINES INC	达美航空 有限公司	DAL US	纽约	美国	795.00	268,785.84	0.06
257	COSTAR GROUP INC	CoStar 集 团股份有 限公司	CSGP US	纳斯达 克	美国	503.00	265,775.62	0.06
258	HP INC	惠普	HPQ US	纽约	美国	1,064.00	265,553.69	0.06
259	HOWME	Howmet 航	HWM US	纽约	美国	478.00	264,455.17	0.06

	T AEROSP ACE INC	空航天股 份有限公 司						
260	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN US	纽约	美国	780.00	263,492.05	0.06
261	CDW CORP/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达 克	美国	165.00	263,218.38	0.06
262	CORNIN G INC	康宁公司	GLW US	纽约	美国	950.00	263,032.37	0.06
263	ARCHER -DANIEL S-MIDLA ND CO	Archer-Dan iels-Midlan d 公司	ADM US	纽约	美国	610.00	262,797.19	0.06
264	HALLIB URTON CO	哈利伯顿	HAL US	纽约	美国	1,091.00	262,650.94	0.06
265	EQUIFA X INC	Equifax 股 份有限公 司	EFX US	纽约	美国	152.00	262,650.52	0.06
266	VICI PROPER TIES INC	VICI Properties 股份有限 公司	VICI US	纽约	美国	1,286.00	262,487.46	0.06
267	HARTFO RD FINANCI AL SERVICE S GROUP INC/THE	哈特福德 金融服务	HIG US	纽约	美国	364.00	260,816.36	0.06
268	XCEL ENERGY INC	Xcel 能源	XEL US	纳斯达 克	美国	685.00	260,740.04	0.06
269	PPG INDUST RIES INC	PPG 工业	PPG US	纽约	美国	290.00	260,185.93	0.06
270	METTLE R-TOLED O INTERN ATIONA L INC	梅特勒-托 利多国际 股份有限 公司	MTD US	纽约	美国	26.00	258,968.95	0.06
271	ON SEMICO	安森美半 导体公司	ON US	纳斯达 克	美国	530.00	258,927.33	0.06

	INDUCTOR CORP							
272	AVALON BAY COMMUNITIES INC	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB US	纽约	美国	175.00	258,031.14	0.06
273	CHARTER COMMUNICATIONS INC	Charter 通信公司	CHTR US	纳斯达克	美国	120.00	255,675.38	0.06
274	DOLLAR GENERAL CORP	达乐公司	DG US	纽约	美国	270.00	254,441.73	0.06
275	TRACTOR SUPPLY CO	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克	美国	132.00	253,999.15	0.06
276	TARGA RESOURCES CORP	Targa 资源公司	TRGP US	纽约	美国	273.00	250,556.48	0.06
277	VISTRA CORP	Vistra 公司	VST US	纽约	美国	403.00	246,943.19	0.06
278	RESMED INC	瑞思迈股份有限公司	RMD US	纽约	美国	181.00	246,922.38	0.06
279	WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP	西屋制动公司	WAB US	纽约	美国	218.00	245,553.18	0.06
280	ANSYS INC	ANSYS 股份有限公司	ANSS US	纳斯达克	美国	107.00	245,165.48	0.06
281	EDISON INTERNATIONAL	爱迪生国际	EIX US	纽约	美国	474.00	242,581.59	0.06
282	HEWLETT PACKARD	慧与	HPE US	纽约	美国	1,603.00	241,851.59	0.06

	D ENTERP RISE CO							
283	EBAY INC	eBay 公司	EBAY US	纳斯达 克	美国	624.00	238,899.46	0.05
284	HERSHE Y CO/THE	好时公司	HSY US	纽约	美国	182.00	238,441.78	0.05
285	CBRE GROUP INC	世邦魏理 仕	CBRE US	纽约	美国	371.00	235,610.65	0.05
286	WILLIS TOWERS WATSON PLC	韦莱韬睿 惠悦公共 有限公司	WTW US	纳斯达 克	美国	126.00	235,395.64	0.05
287	NETAPP INC	美国网域 存储技术 有限公司	NTAP US	纳斯达 克	美国	254.00	233,154.69	0.05
288	IRON MOUNT AIN INC	美国铁山 公司	IRM US	纽约	美国	361.00	230,572.08	0.05
289	FORTIVE CORP	福迪威公 司	FTV US	纽约	美国	434.00	229,193.61	0.05
290	T ROWE PRICE GROUP INC	普徠仕	TROW US	纳斯达 克	美国	275.00	225,992.61	0.05
291	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏 公司	KHC US	纳斯达 克	美国	973.00	223,425.61	0.05
292	CHURCH & DWIGHT CO INC	切迟杜威 股份有限 公司	CHD US	纽约	美国	301.00	222,410.89	0.05
293	M&T BANK CORP	M&T 银行	MTB US	纽约	美国	205.00	221,136.05	0.05
294	AMERIC AN WATER WORKS CO INC	美国自来 水股份有 限公司	AWK US	纽约	美国	240.00	220,919.40	0.05
295	GARMIN LTD	佳明有限 公司	GRMN US	纽约	美国	189.00	219,447.57	0.05

296	FIFTH THIRD BANCOR P	五三银行	FITB US	纳斯达克	美国	843.00	219,227.99	0.05
297	DOVER CORP	都福	DOV US	纽约	美国	170.00	218,625.28	0.05
298	ESTEE LAUDER COS INC/THE	雅诗兰黛	EL US	纽约	美国	287.00	217,629.67	0.05
299	WEC ENERGY GROUP INC	WEC 能源 集团股份 有限公司	WEC US	纽约	美国	389.00	217,516.64	0.05
300	GLOBAL PAYMEN TS INC	环汇有限 公司	GPN US	纽约	美国	315.00	217,085.89	0.05
301	WESTER N DIGITAL CORP	西部数据 公司	WDC US	纳斯达克	美国	402.00	217,079.05	0.05
302	LYONDE LLBASE LL INDUST RIES NV	利安德巴 塞尔工业 公司	LYB US	纽约	美国	317.00	216,114.65	0.05
303	TAKE-T WO INTERA CTIVE SOFTWA RE INC	Take-Two 互动软件 股份有限 公司	TTWO US	纳斯达克	美国	195.00	216,088.50	0.05
304	DECKER S OUTDOO R CORP	德克斯户 外用品公 司	DECK US	纽约	美国	31.00	213,849.97	0.05
305	INTERN ATIONA L FLAVOR S & FRAGRA NCES INC	国际香料	IFF US	纽约	美国	314.00	213,062.39	0.05
306	FIRST	福思第一	FSLR US	纳斯达	美国	132.00	212,098.70	0.05

	SOLAR INC	太阳能公司		克				
307	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	西氏医药服务公司	WST US	纽约	美国	90.00	211,274.70	0.05
308	CARDINAL HEALTH INC	嘉德诺健康集团	CAH US	纽约	美国	300.00	210,212.09	0.05
309	EQUITY RESIDENTIAL	公寓物业权益信托	EQR US	纽约	美国	425.00	210,023.23	0.05
310	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	是德科技公司	KEYS US	纽约	美国	215.00	209,536.83	0.05
311	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR US	纽约	美国	145.00	203,577.04	0.05
312	PULTEGROUP INC	Pulte 集团公司	PHM US	纽约	美国	259.00	203,227.12	0.05
313	TERADYNE INC	泰瑞达	TER US	纳斯达克	美国	192.00	202,911.97	0.05
314	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Raymond James 金融股份有限公司	RJF US	纽约	美国	230.00	202,617.06	0.05
315	DTE ENERGY CO	DTE 能源	DTE US	纽约	美国	255.00	201,742.25	0.05
316	NASDAQ INC	纳斯达克股份有限公司	NDAQ US	纳斯达克	美国	469.00	201,417.19	0.05
317	ENTERGY CORP	Entergy 公司	ETR US	纽约	美国	263.00	200,555.28	0.05
318	ZIMMER	捷迈邦美	ZBH US	纽约	美国	254.00	196,461.79	0.04

	BIOMET HOLDINGS INC	控股股份有限公司						
319	STATE STREET CORP	道富集团	STT US	纽约	美国	371.00	195,659.17	0.04
320	DOLLAR TREE INC	美元树公司	DLTR US	纳斯达克	美国	255.00	194,036.75	0.04
321	PTC INC	PTC 公司	PTC US	纳斯达克	美国	147.00	190,324.69	0.04
322	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	纽约	美国	121.00	189,318.74	0.04
323	TYLER TECHNOLOGIES INC	Tyler 科技公司	TYL US	纽约	美国	52.00	186,327.05	0.04
324	BROWN & BROWN INC	Brown & Brown 股份有限公司	BRO US	纽约	美国	291.00	185,427.29	0.04
325	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA 通信公司	SBAC US	纳斯达克	美国	132.00	184,666.79	0.04
326	VERALTO CORP	Veralto 公司	VLTO US	纽约	美国	270.00	183,706.81	0.04
327	AXON ENTERPRISE INC	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON US	纳斯达克	美国	87.00	182,438.10	0.04
328	VENTAS INC	Ventas 公司	VTR US	纽约	美国	499.00	182,294.56	0.04
329	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY US	纽约	美国	899.00	181,894.54	0.04
330	INVITATION HOMES INC	邀请家园公司	INVH US	纽约	美国	710.00	181,604.40	0.04
331	PPL CORP	PPL 公司	PPL US	纽约	美国	909.00	179,123.92	0.04
332	SEAGATE	Seagate	STX US	纳斯达克	美国	240.00	176,636.31	0.04

	E TECHNO LOGY HOLDIN GS PLC	Technology 控股公共 有限公司		克				
333	EVERSO URCE ENERGY	Eversource 能源公司	ES US	纽约	美国	434.00	175,405.80	0.04
334	COTERR A ENERGY INC	Coterra 能 源股份有 限公司	CTRA US	纽约	美国	918.00	174,485.87	0.04
335	FIRSTEN ERGY CORP	第一能源	FE US	纽约	美国	638.00	174,009.80	0.04
336	CENTER POINT ENERGY INC	中点能源	CNP US	纽约	美国	788.00	173,981.15	0.04
337	LEIDOS HOLDIN GS INC	Leidos 控 股公司	LDOS US	纽约	美国	167.00	173,622.82	0.04
338	GODAD DY INC	GoDaddy 股份有限 公司	GDDY US	纽约	美国	173.00	172,253.54	0.04
339	HUBBEL L INC	哈贝尔公 司	HUBB US	纽约	美国	66.00	171,910.39	0.04
340	STEEL DYNAMI CS INC	Steel Dynamics 股份有限 公司	STLD US	纳斯达 克	美国	183.00	168,894.47	0.04
341	APTIV PLC	Aptiv 公共 有限公司	APTV US	纽约	美国	336.00	168,628.07	0.04
342	GENUIN E PARTS CO	原配部件	GPC US	纽约	美国	171.00	168,568.20	0.04
343	HUNTIN GTON BANCSH ARES INC/OH	俄亥俄州 亨廷顿银 行控股公 司	HBAN US	纳斯达 克	美国	1,787.00	167,855.10	0.04
344	SYNCHR ONY FINANCI AL	同步金融 公司	SYF US	纽约	美国	496.00	166,811.59	0.04

345	AMEREN CORP	Ameren 公 司	AEE US	纽约	美国	328.00	166,226.05	0.04
346	CARNIV AL CORP	嘉年华公 司	CCL US	纽约	美国	1,245.00	166,100.05	0.04
347	CORPAY INC	Corpay 股 份有限公 司	CPAY US	纽约	美国	87.00	165,182.62	0.04
348	BALL CORP	波尔	BALL US	纽约	美国	383.00	163,828.46	0.04
349	CINCINN ATI FINANCI AL CORP	辛辛那提 金融	CINF US	纳斯达 克	美国	193.00	162,443.29	0.04
350	ULTA BEAUTY INC	Ulta 美容 产品公司	ULTA US	纳斯达 克	美国	59.00	162,251.08	0.04
351	ALEXAN DRIA REAL ESTATE EQUITIE S INC	亚历山大 房地产股 份有限公 司	ARE US	纽约	美国	194.00	161,722.63	0.04
352	REGION S FINANCI AL CORP	地区金融 公司	RF US	纽约	美国	1,129.00	161,244.99	0.04
353	TELEDY NE TECHNO LOGIES INC	Teledyne 科 技股份有 限公司	TDY US	纽约	美国	58.00	160,373.24	0.04
354	DARDEN RESTAU RANTS INC	达登餐饮 公司	DRI US	纽约	美国	147.00	158,528.82	0.04
355	DOMINO 'S PIZZA INC	达美乐披 萨公司	DPZ US	纽约	美国	43.00	158,230.57	0.04
356	MCCOR MICK & CO INC/MD	味好美股 份有限公 司/马里兰 州	MKC US	纽约	美国	310.00	156,728.31	0.04
357	CBOE GLOBAL MARKET	Cboe 环球 市场公司	CBOE US	芝加哥	美国	129.00	156,345.89	0.04

	S INC							
358	CMS ENERGY CORP	CMS 能源	CMS US	纽约	美国	368.00	156,127.09	0.04
359	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纽约	美国	175.00	155,636.84	0.04
360	ATMOS ENERGY CORP	Atmos 能源公司	ATO US	纽约	美国	186.00	154,629.47	0.04
361	AVERY DENNISON CORP	艾利丹尼森	AVY US	纽约	美国	99.00	154,269.21	0.04
362	OMNICO M GROUP INC	Omnicom 集团	OMC US	纽约	美国	241.00	154,065.02	0.04
363	JACOBS SOLUTIONS INC	嘉科解决方案股份有限公司	J US	纽约	美国	154.00	153,335.53	0.03
364	ESSEX PROPERTY TRUST INC	埃塞克斯房地产信托公司	ESS US	纽约	美国	79.00	153,253.28	0.03
365	MOLINA HEALTH CARE INC	Molina Healthcare 股份有限公司	MOH US	纽约	美国	72.00	152,553.43	0.03
366	COOPER COS INC/THE	库柏股份有限公司	COO US	纳斯达克	美国	245.00	152,431.56	0.03
367	HOLOGIC INC	豪洛捷公司	HOLX US	纳斯达克	美国	287.00	151,870.33	0.03
368	WATERS CORP	沃特世公司	WAT US	纽约	美国	73.00	150,936.79	0.03
369	NORTHERN TRUST	北美信托	NTRS US	纳斯达克	美国	252.00	150,824.18	0.03

	CORP							
370	SOUTH WEST AIRLINE S CO	西南航空	LUV US	纽约	美国	738.00	150,476.54	0.03
371	BAXTER INTERNATIONAL INC	百特	BAX US	纽约	美国	628.00	149,709.84	0.03
372	SKYWORKS SOLUTIONS INC	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克	美国	197.00	149,636.15	0.03
373	LABCORP HOLDINGS INC	Labcorp 控股股份有限公司	LH US	纽约	美国	103.00	149,388.63	0.03
374	CLOROX CO/THE	高乐氏公司	CLX US	纽约	美国	153.00	148,806.94	0.03
375	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	信安金融	PFGE US	纳斯达克	美国	266.00	148,719.92	0.03
376	ALIGN TECHNOLOGY INC	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克	美国	86.00	147,973.61	0.03
377	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR US	纽约	美国	150.00	147,963.06	0.03
378	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	Mid-America Apartment Communities 股份有限公司	MAA US	纽约	美国	144.00	146,354.82	0.03
379	WARNER BROS DISCOVERY INC	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克	美国	2,749.00	145,761.30	0.03

380	TEXTRO N INC	德事隆	TXT US	纽约	美国	236.00	144,410.06	0.03
381	CITIZEN S FINANCI AL GROUP INC	公民金融 集团股份 有限公司	CFG US	纽约	美国	562.00	144,309.58	0.03
382	EVERES T GROUP LTD	Everest 集 团有限公 司	EG US	纽约	美国	53.00	143,919.03	0.03
383	EQT CORP	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	544.00	143,370.69	0.03
384	TYSON FOODS INC	泰森食品 公司	TSN US	纽约	美国	352.00	143,343.32	0.03
385	NRG ENERGY INC	NRG 能源 股份有限 公司	NRG US	纽约	美国	258.00	143,162.30	0.03
386	BEST BUY CO INC	百思买	BBY US	纽约	美国	237.00	142,370.16	0.03
387	MARATH ON OIL CORP	Marathon 石油公司	MRO US	纽约	美国	696.00	142,210.45	0.03
388	LAS VEGAS SANDS CORP	拉斯维加 斯金沙集 团	LVS US	纽约	美国	450.00	141,912.41	0.03
389	PACKAG ING CORP OF AMERIC A	美国包装 公司	PKG US	纽约	美国	109.00	141,816.48	0.03
390	EXPEDIA GROUP INC	亿客行集 团股份有 限公司	EXPE US	纳斯达 克	美国	157.00	140,971.17	0.03
391	UNITED AIRLINE S HOLDIN GS INC	美国联合 航空控股 股份有限 公司	UAL US	纳斯达 克	美国	405.00	140,449.99	0.03
392	WR BERKLE Y CORP	WR Berkley 公 司	WRB US	纽约	美国	249.00	139,445.96	0.03

393	ZEBRA TECHNO LOGIES CORP	斑马技术 公司	ZBRA US	纳斯达 克	美国	63.00	138,705.99	0.03
394	FACTSET RESEAR CH SYSTEM S INC	FactSet 研 究系统股 份有限公 司	FDS US	纽约	美国	47.00	136,753.96	0.03
395	VERISIG N INC	威瑞信股 份有限公 司	VRSN US	纳斯达 克	美国	107.00	135,584.52	0.03
396	IDEX CORP	艺达思集 团	IEX US	纽约	美国	93.00	133,353.83	0.03
397	KELLAN OVA	Kellanova	K US	纽约	美国	324.00	133,187.92	0.03
398	BUNGE GLOBAL SA	Bunge Global SA	BG US	纽约	美国	175.00	133,162.48	0.03
399	QUEST DIAGNO STICS INC	Quest Diagnostics 股份有限 公司	DGX US	纽约	美国	136.00	132,670.23	0.03
400	INTERN ATIONA L PAPER CO	国际纸业	IP US	纽约	美国	428.00	131,619.17	0.03
401	MASCO CORP	马斯可	MAS US	纽约	美国	271.00	128,763.96	0.03
402	AMCOR PLC	安姆科公 司	AMCR US	纽约	美国	1,782.00	124,205.59	0.03
403	INSULET CORP	Insulet 股 份有限公 司	PODD US	纳斯达 克	美国	86.00	123,684.19	0.03
404	HEALTH PEAK PROPER TIES INC	Healthpeak Properties Inc	DOC US	纽约	美国	867.00	121,107.14	0.03
405	SNAP-O N INC	实耐宝	SNA US	纽约	美国	65.00	121,086.83	0.03
406	GEN DIGITAL INC	Gen Digital 股份有限 公司	GEN US	纳斯达 克	美国	680.00	121,058.68	0.03
407	TRIMBL	天宝股份	TRMB US	纳斯达	美国	302.00	120,356.26	0.03

	E INC	有限公司		克				
408	ROLLINS INC	Rollins 公 司	ROL US	纽约	美国	346.00	120,309.93	0.03
409	NEWS CORP	新闻集团	NWSA US	纳斯达 克	美国	467.00	91,758.90	0.02
			NWS US	纳斯达 克	美国	141.00	28,528.51	0.01
410	AKAMAI TECHNO LOGIES INC	阿卡迈技 术公司	AKAM US	纳斯达 克	美国	187.00	120,050.66	0.03
411	CF INDUST RIES HOLDIN GS INC	CF 工业控 股股份有 限公司	CF US	纽约	美国	226.00	119,381.88	0.03
412	CONAGR A BRANDS INC	康尼格拉 品牌股份 有限公司	CAG US	纽约	美国	589.00	119,298.21	0.03
413	LOEWS CORP	罗斯公司	L US	纽约	美国	223.00	118,782.52	0.03
414	ENPHAS E ENERGY INC	Enphase 能 源股份有 限公司	ENPH US	纳斯达 克	美国	167.00	118,672.41	0.03
415	CELANE SE CORP	塞拉尼斯 公司	CE US	纽约	美国	123.00	118,244.09	0.03
416	KEYCOR P	KeyCorp 公司	KEY US	纽约	美国	1,162.00	117,677.86	0.03
417	LIVE NATION ENTERT AINMEN T INC	Live Nation 娱 乐公司	LYV US	纽约	美国	175.00	116,911.59	0.03
418	JABIL INC	捷普集团	JBL US	纽约	美国	149.00	115,523.36	0.03
419	ALLIAN T ENERGY CORP	Alliant 能 源公司	LNT US	纳斯达 克	美国	316.00	114,630.30	0.03
420	JB HUNT TRANSP ORT	JB Hunt 运 输服务股 份有限公	JBHT US	纳斯达 克	美国	100.00	114,028.80	0.03

	SERVICE S INC	司						
421	KIMCO REALTY CORP	Kimco Realty Corp	KIM US	纽约	美国	822.00	114,001.15	0.03
422	WESTRO CK CO	WestRock 公司	WRK US	纽约	美国	318.00	113,905.36	0.03
423	REVVIT Y INC	Revvity 股 份有限公 司	RVTY US	纽约	美国	152.00	113,592.07	0.03
424	NISOUR CE INC	NiSource 公司	NI US	纽约	美国	552.00	113,338.36	0.03
425	PENTAIR PLC	Pentair 公 共有限公 司	PNR US	纽约	美国	204.00	111,468.00	0.03
426	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	869.00	111,353.54	0.03
427	VIATRIS INC	晖致	VTRS US	纳斯达 克	美国	1,468.00	111,212.57	0.03
428	NORDSO N CORP	诺信公司	NDSN US	纳斯达 克	美国	67.00	110,750.33	0.03
429	AES CORP/TH E	爱伊斯公 司	AES US	纽约	美国	876.00	109,690.86	0.03
430	UDR INC	UDR 公司	UDR US	纽约	美国	373.00	109,388.90	0.02
431	STANLE Y BLACK & DECKER INC	史丹利百 得公司	SWK US	纽约	美国	189.00	107,609.05	0.02
432	FOX CORP	福克斯公 司	FOXA US	纳斯达 克	美国	286.00	70,055.16	0.02
			FOX US	纳斯达 克	美国	162.00	36,968.42	0.01
433	EVERGY INC	Evergy 股 份有限公 司	EVRG US	纳斯达 克	美国	283.00	106,834.37	0.02
434	LAMB WESTON HOLDIN	蓝威斯顿 控股股份 有限公司	LW US	纽约	美国	178.00	106,661.40	0.02

	GS INC							
435	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克	美国	89.00	105,304.03	0.02
436	JUNIPER NETWORKS INC	瞻博网络股份有限公司	JNPR US	纽约	美国	400.00	103,937.25	0.02
437	POOL CORP	Pool 公司	POOL US	纳斯达克	美国	47.00	102,943.13	0.02
438	CAMDEN PROPERTY TRUST	Camden 房地产信托公司	CPT US	纽约	美国	131.00	101,866.27	0.02
439	CARMAX INC	CarMax 股份有限公司	KMX US	纽约	美国	194.00	101,399.83	0.02
440	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	EMN US	纽约	美国	145.00	101,240.83	0.02
441	JM SMUCKER CO/THE	JM 斯马克公司	SJM US	纽约	美国	130.00	101,023.82	0.02
442	BIO-TECHNE CORP	Bio-technique 公司	TECH US	纳斯达克	美国	194.00	99,063.23	0.02
443	INCYTE CORP	因赛特公司	INCY US	纳斯达克	美国	229.00	98,934.10	0.02
444	QORVO INC	Qorvo 股份有限公司	QRVO US	纳斯达克	美国	119.00	98,412.27	0.02
445	MGM RESORTS INTERNATIONAL	美高梅国际酒店集团	MGM US	纽约	美国	310.00	98,181.65	0.02
446	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB US	纽约	美国	144.00	98,028.28	0.02
447	UNIVERSAL	Universal 保健服务	UHS US	纽约	美国	74.00	97,528.98	0.02

	HEALTH SERVICE S INC	股份有限公司						
448	LKQ CORP	LKQ 公司	LKQ US	纳斯达克	美国	328.00	97,220.38	0.02
449	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE	Interpublic 集团	IPG US	纽约	美国	466.00	96,610.47	0.02
450	EPAM SYSTEMS INC	EPAM 系统公司	EPAM US	纽约	美国	71.00	95,184.19	0.02
451	APA CORP	APA	APA US	纳斯达克	美国	444.00	93,156.97	0.02
452	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	查尔斯河实验室国际有限公司	CRL US	纽约	美国	63.00	92,752.02	0.02
453	CHROBINSON WORLDWIDE INC	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW US	纳斯达克	美国	144.00	90,433.96	0.02
454	ALLEGION PLC	安朗杰公共有限公司	ALLE US	纽约	美国	107.00	90,097.36	0.02
455	REGENCY CENTERS CORP	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克	美国	202.00	89,543.97	0.02
456	CATALANT INC	康泰伦特股份有限公司	CTLT US	纽约	美国	223.00	89,365.01	0.02
457	F5 INC	F5 股份有限公司	FFIV US	纳斯达克	美国	72.00	88,376.31	0.02
458	TELEFLIX INC	泰利福公司	TFX US	纽约	美国	58.00	86,940.83	0.02
459	AO SMITH CORP	AO 史密斯公司	AOS US	纽约	美国	149.00	86,841.63	0.02

460	TAPESTRY INC	TPR-DRS-RS	TPR US	纽约	美国	283.00	86,302.48	0.02
461	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	Huntington Ingalls 工业公司	HII US	纽约	美国	48.00	84,266.14	0.02
462	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS US	纽约	美国	397.00	81,767.91	0.02
463	MOLSON COORS BEVERAGE CO	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	纽约	美国	225.00	81,507.43	0.02
464	BXP INC	波士顿地产公司	BXP US	纽约	美国	178.00	78,093.19	0.02
465	CAMPBELL SOUP CO	金宝汤	CPB US	纽约	美国	242.00	77,938.54	0.02
466	HORMEL FOODS CORP	荷美尔食品有限公司	HRL US	纽约	美国	357.00	77,574.72	0.02
467	BATH & BODY WORKS INC	Bath & Body Works 股份有限公司	BBWI US	纽约	美国	275.00	76,532.92	0.02
468	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	Pinnacle 西部资本	PNW US	纽约	美国	140.00	76,208.30	0.02
469	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	沃博联股份有限公司	WBA US	纳斯达克	美国	883.00	76,113.44	0.02
470	ASSURANT INC	安信龙集团	AIZ US	纽约	美国	64.00	75,829.15	0.02
471	CAESARS ENTERTAINMENT INC	凯撒娱乐集团	CZR US	纳斯达克	美国	266.00	75,336.26	0.02
472	WYNN RESORTS LTD	永利渡假村有限公司	WYNN US	纳斯达克	美国	116.00	73,990.44	0.02

473	HENRY SCHEIN INC	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克	美国	158.00	72,178.81	0.02
474	MATCH GROUP INC	Match 集团股份有限公司	MTCH US	纳斯达克	美国	328.00	71,016.00	0.02
475	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	纽约	美国	529.00	70,839.75	0.02
476	GENERAL HOLDINGS INC	Generac 控股公司	GNRC US	纽约	美国	74.00	69,730.61	0.02
477	DAYFORCE INC	Dayforce 股份有限公司	DAY US	纽约	美国	194.00	68,576.92	0.02
478	BROWN-FORMAN CORP	百富门公司	BF/B US	纽约	美国	220.00	67,717.43	0.02
479	HASBRO INC	孩之宝	HAS US	纳斯达克	美国	161.00	67,123.77	0.02
480	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	联邦房地产投资信托公司	FRT US	纽约	美国	92.00	66,202.56	0.02
481	MARKET AXESS HOLDINGS INC	MarketAxess 控股公司	MKTX US	纳斯达克	美国	46.00	65,740.31	0.02
482	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	美国航空集团公司	AAL US	纳斯达克	美国	809.00	65,324.03	0.01
483	BORGWARNER INC	博格华纳股份有限公司	BWA US	纽约	美国	280.00	64,335.05	0.01
484	SOLVENTUM CORP	Solventum 公司	SOLV US	纽约	美国	170.00	64,067.08	0.01

485	DAVITA INC	DaVita 股份有限公司	DVA US	纽约	美国	64.00	63,203.88	0.01
486	FMC CORP	FMC 公司	FMC US	纽约	美国	153.00	62,752.54	0.01
487	GLOBE LIFE INC	Globe Life 股份有限公司	GL US	纽约	美国	104.00	60,984.88	0.01
488	ETSY INC	Etsy 股份有限公司	ETSY US	纳斯达克	美国	145.00	60,949.11	0.01
489	PAYCOM SOFTWARE INC	Paycom 软件股份有限公司	PAYC US	纽约	美国	59.00	60,145.63	0.01
490	RALPH LAUREN CORP	拉夫劳伦	RL US	纽约	美国	48.00	59,885.65	0.01
491	INVESCO LTD	景顺有限公司	IVZ US	纽约	美国	554.00	59,065.78	0.01
492	FRANKLIN RESOURCES INC	富兰克林资源	BEN US	纽约	美国	369.00	58,775.79	0.01
493	MOHAWK INDUSTRIES INC	Mohawk 工业股份有限公司	MHK US	纽约	美国	65.00	52,619.66	0.01
494	BIO-RAD LABORATORIES INC	伯乐生命医学产品有限公司	BIO US	纽约	美国	25.00	48,660.01	0.01
495	PARAMOUNT GLOBAL	派拉蒙全球	PARA US	纳斯达克	美国	609.00	45,094.90	0.01

7.4.2 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。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 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	MICROSOFT CORP	MSFT US	13,238,103.65	6.92
2	APPLE INC	AAPL US	11,427,247.22	5.98
3	NVIDIA CORP	NVDA US	8,485,417.41	4.44
4	ALPHABET INC	GOOGL US	3,771,700.42	1.97
		GOOG US	3,149,410.50	1.65
5	AMAZON.COM INC	AMZN US	6,861,508.88	3.59
6	META PLATFORMS INC	META US	4,393,791.23	2.30
7	WALMART INC	WMT US	4,307,965.55	2.25
8	BERKSHIRE HATHAWAY INC	BRK/B US	3,119,988.60	1.63
9	EXXON MOBIL CORP	XOM US	2,883,687.86	1.51
10	ELI LILLY & CO	LLY US	2,545,892.32	1.33
11	BROADCOM INC	AVGO US	2,395,538.97	1.25
12	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	2,273,675.95	1.19
13	TESLA INC	TSLA US	2,271,288.97	1.19
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	1,987,528.17	1.04
15	VISA INC	V US	1,856,162.16	0.97
16	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	1,641,302.20	0.86
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	1,634,564.83	0.85
18	MASTERCARD INC	MA US	1,628,612.56	0.85
19	HOME DEPOT INC/THE	HD US	1,550,595.81	0.81
20	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	1,414,043.36	0.74

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。

7.5.2 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	VISA INC	V US	3,796,036.95	1.99
2	WALMART INC	WMT US	3,220,179.76	1.68
3	AMPHENOL CORP	APH US	707,571.34	0.37
4	EXXON MOBIL CORP	XOM US	535,611.59	0.28
5	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	519,236.16	0.27
6	COOPER COS INC/THE	COO US	352,511.09	0.18
7	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	308,047.49	0.16

8	OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	ODFL US	300,176.13	0.16
9	CORPAY INC	CPAY US	170,090.24	0.09
10	ILLUMINA INC	ILMN US	149,184.17	0.08
11	APPLE INC	AAPL US	144,570.12	0.08
12	ALPHABET INC	GOOG US	52,470.68	0.03
		GOOGL US	29,058.73	0.02
13	3M CO	MMM US	77,100.95	0.04
14	META PLATFORMS INC	META US	75,510.11	0.04
15	SOLVENTUM CORP	SOLV US	74,017.42	0.04
16	GENERAL MOTORS CO	GM US	66,743.30	0.03
17	ROBERT HALF INC	RHI US	59,377.14	0.03
18	DAYFORCE INC	DAY US	59,133.09	0.03
19	COMERICA INC	CMA US	54,450.70	0.03
20	WELLS FARGO & CO	WFC US	52,750.07	0.03

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。

7.5.3 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	191,044,126.90
卖出收入（成交）总额	11,717,130.41

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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	-------	-------	------	--------------

1	股指期货	S&P500 EMINI Sep24	-	-
---	------	-----------------------	---	---

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。

7.10 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

本基金本报告期末未持有基金。

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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 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	2,312,646.60
2	应收清算款	10,838.94
3	应收股利	201,895.14
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	2,525,380.68

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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		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
6,502	46,124.06	43,068,036.00	14.36%	140,012,633.00	46.69%	116,817,982.00	38.95%

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	杨巧伟	21,514,005.00	7.17%
2	招商银行股份有限公司—华夏养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	4,440,306.00	1.48%
3	陆家嘴国际信托有限公司	3,899,900.00	1.30%
4	中国工商银行股份有限公司—广发养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	3,835,800.00	1.28%
5	上海浦东发展银行股份有限公司—兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金 (FOF-LOF)	3,749,100.00	1.25%
6	BARCLAYS BANK PLC	3,310,900.00	1.10%
7	中国民生银行股份有限公司—兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	2,994,700.00	1.00%
8	中国工商银行股份有限公司—兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	1,922,300.00	0.64%
9	杨爱军	1,500,000.00	0.50%
10	王海锋	1,498,600.00	0.50%
-	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投	116,817,982.00	38.95%

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。

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 (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	150,898,651.00
本报告期基金总申购份额	155,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	299,898,651.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 3 月 27 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十六次会议审议通过，周向勇先生离任公司总经理、转任董事长并代为履行总经理职务。

2024 年 7 月 25 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十九次会议审议通过，聘任李昇先生担任本基金管理人总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
China Galaxy International Financial Holdings Limited	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	1	188,204,131.91	93.30%	35,713.12	94.20%	-
China Merchants Securities (HK) Co. Ltd	1	12,967,695.44	6.43%	2,105.00	5.55%	-
Haitong International Securities Co. Ltd	1	550,957.64	0.27%	93.76	0.25%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总额的	成交金额	占当期基金成交总

		比例		额的比例		比例		额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
东北 证券	-	-	40,00 0,000. 00	44.44%	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	30,00 0,000. 00	33.33%	-	-	-	-
中信 建投	-	-	20,00 0,000. 00	22.22%	-	-	-	-
Chin a Gala xy Inter natio nal Finan cial Holdi ngs Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	20,28 3,510. 04	100.00%
Chin a Merc hants Secur ities (HK) Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Inter natio nal Secur ities	-	-	-	-	-	-	-	-

Co. Ltd								
------------	--	--	--	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2024-01-05
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》	2024-01-10
3	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2024-01-25
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》	2024-02-06
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》	2024-03-26
6	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》	2024-03-27
7	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购业务的公告	《上海证券报》	2024-05-07
8	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停赎回业务的公告	《上海证券报》	2024-05-22
9	关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 恢复申购业务的公告	《上海证券报》	2024-06-05
10	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》	2024-06-14
11	国泰基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2024-06-25
12	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 暂停申购业务的公告	《上海证券报》	2024-06-26

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
个人	1	2024年01月08日至2024年01月	28,438,304.0	53,082,600.0	60,006,899.00	21,514,005.00	7.17%

		09 日	0	0			
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)	1	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	37,682,700.00	95,528,200.00	16,392,918.00	116,817,982.00	38.95%
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

12.2 存放地点

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

基金托管人住所或办公场所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人; 部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话: (021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话: (021) 31089000

公司网址: <http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日