

**国泰中证 500 指数增强型证券投资基金**  
**2021 年中期报告**  
**2021 年 6 月 30 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<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遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	56
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>56</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>59</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	60

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰中证 500 指数增强	
基金主代码	003760	
交易代码	003760	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 17 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	43,924,863.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	003760	003761
报告期末下属分级基金的份额总额	35,423,406.18 份	8,501,456.93 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略； 2、债券投资策略； 3、中小企业私募债投资策略； 4、资产支持证券投资策略； 5、权证投资策略； 6、股指期货投资策略； 7、股票期权投资策略； 8、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	朱广科
	联系电话	021-31081600转	0574-87050338
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	0574-83895886

传真	021-31081800	0574-89103213
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345号
邮政编码	200082	315100
法定代表人	邱军	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	3,075,235.15	1,117,682.38
本期利润	4,608,453.50	1,351,797.54
加权平均基金份额本期利润	0.1898	0.1561
本期加权平均净值利润率	15.03%	12.57%
本期基金份额净值增长率	9.16%	9.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	9,019,518.86	2,009,432.42
期末可供分配基金份额利润	0.2546	0.2364
期末基金资产净值	47,312,599.57	11,205,327.56
期末基金份额净值	1.3356	1.3180
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	

	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	40.72%	39.30%

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.63%	0.78%	1.12%	0.69%	1.51%	0.09%
过去三个月	10.43%	0.73%	8.41%	0.65%	2.02%	0.08%
过去六个月	9.16%	0.94%	6.61%	0.94%	2.55%	0.00%
过去一年	15.86%	1.15%	15.35%	1.19%	0.51%	-0.04%
自基金合同生效起至今	40.72%	1.20%	31.73%	1.29%	8.99%	-0.09%

国泰中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.63%	0.78%	1.12%	0.69%	1.51%	0.09%
过去三个月	10.42%	0.73%	8.41%	0.65%	2.01%	0.08%
过去六个月	9.15%	0.94%	6.61%	0.94%	2.54%	0.00%
过去一年	15.83%	1.15%	15.35%	1.19%	0.48%	-0.04%
自基金合同生效起至今	39.30%	1.20%	31.73%	1.29%	7.57%	-0.09%

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

国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 5 月 17 日至 2021 年 6 月 30 日）

国泰中证 500 指数增强 A



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

国泰中证 500 指数增强 C



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



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国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）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混

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

金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投

资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、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、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、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证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、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证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、国泰中证细分化工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、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢东旭	国泰沪深 300 指数增强、国泰中证 500 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰上证综合 ETF 联接、国泰创业板指数（LOF）、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证钢铁 ETF 联接、国泰中证新能源汽车 ETF 联接、国泰中证全指家用电器 ETF 联接、国泰国证房地产行业指数的基金经理	2019-11-01	-	10 年	硕士研究生。曾任职于中信证券、华安基金管理有限公司、创金合信基金管理有限公司。2018 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，任基金经理助理。2019 年 11 月至 2020 年 12 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）和国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰沪深 300 指数证券投资基金和国泰上证综合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 7 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证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。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### （一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。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。

### 4.3.2 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所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

2021 年是十四五的开局之年，疫苗已陆续获批，全球来看新冠疫情仍存在较大的不确定性，疫苗已陆续获批，随着新冠疫苗接种在主要经济体的逐步推广，市场对全球经济复苏的前景较为乐观；国内来看受去年低基数的影响，预计今年整体经济增长较好，从财政和货币政策的执行来看，去年对冲疫情对经济冲击的临时性政策正逐步有序退出，宏观流动性呈现边际收紧态势，A 股市场上前期受资金追捧的核心资产以及绝对估值水平较高、弹性较大的行业如军工、证券、新能源汽车、电子半导体等调整幅度较大，绝对估值水平较低、分红率较高的低估值板块如钢铁、银行表现不俗。

一季度来看，上证指数微跌 0.9%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 2.78%，沪深 300 指数下跌 3.13%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 1.78%，板块上科技股占比较多的创业板指下跌 7%，科创板 50 下跌 10.39%。

二季度在迎接中国共产党成立 100 周年的氛围下，政策总体偏暖，市场流动性边际趋松，在基数效应逐步减弱的情况下，上市公司经营业绩更能较客观的得到反映。随着季末的临近，科创板推出 2 周年临近，科创板上市公司的科创成色逐步显现，业绩预期普遍表现出色，高景气度行业上市公司业绩预增提振了市场做多热情，市场风格相较一季度发生了较大的变化，包括半导体芯片、新能源汽车、医疗等表现出色，中证新能源汽车指数、中华半导体芯片指数季度涨幅分别达到 45.74%、41.04%，一季度表现较好的银行等低市盈率板块表现相对逊色。

二季度，上证指数上涨 4.34%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 1.15%，沪深 300 指数上涨 3.48%，成长性中盘股表征指数如中证 500 上涨 8.86%，板块上科技股占比较多的创业板指上涨 26.05%，科创板 50 上涨 27.23%。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 9.16%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 9.15%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着新冠疫苗在主要经济体的逐步接种并普及，全球经济有望从新冠疫情的阴霾中逐步恢复，不过经济总体上仍然比较脆弱，尤其是在中国经济体量逐步赶超主要发达国家的过程中，全球位居前列的经济体的博弈和竞争料将带来更多的不确定性，我们预计政策料将保持温和，兼具行业高景气度和未来经济社会发展方向的新能源领域以及包括半导体芯片为代表的科技领域投资价值逐步凸显，兼具高景气度以及为我国经济体量相匹配的军工行业是我们中长期坚定看好的方向。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本基金自本报告期初至 2021 年 03 月 25 日期间存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。



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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,437,560.93	1,638,821.70
结算备付金		590,156.71	565,906.40
存出保证金		434,892.12	27,814.09
交易性金融资产	6.4.7.2	52,478,121.53	44,433,166.02
其中：股票投资		52,447,180.73	43,152,632.82
基金投资		-	-
债券投资		30,940.80	1,280,533.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,954.17	28,472.58
应收股利		-	-
应收申购款		5,890.87	6,109,436.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>58,948,576.33</b>	<b>52,803,617.42</b>

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		95,921.20	152,479.23
应付管理人报酬		46,920.25	39,998.46
应付托管费		4,692.00	3,999.84
应付销售服务费		88.62	320.64
应付交易费用	6.4.7.7	175,014.43	138,397.96
应交税费		3,464.38	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,548.32	210,003.73
负债合计		430,649.20	545,199.86
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	43,924,863.11	43,117,801.24
未分配利润	6.4.7.10	14,593,064.02	9,140,616.32
所有者权益合计		58,517,927.13	52,258,417.56
负债和所有者权益总计		58,948,576.33	52,803,617.42

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金的份额净值 1.3356 元，国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类基金的份额净值 1.3180 元。国泰中证 500 指数增强型证券投资基金份额总额 43,924,863.11 份，其中国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金的份额总额 35,423,406.18 份，国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类基金的份额总额 8,501,456.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>6,986,912.09</b>	<b>7,605,977.69</b>
1.利息收入		26,344.26	66,048.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,787.05	19,523.38

债券利息收入		1,557.21	46,525.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,171,685.15	7,914,093.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,573,562.17	7,389,183.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,667.59	25,183.04
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	103,106.80	82,446.60
股利收益	6.4.7.15	484,348.59	417,279.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,767,333.51	-379,720.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	21,549.17	5,555.98
<b>减：二、费用</b>		<b>1,026,661.05</b>	<b>1,309,701.92</b>
1. 管理人报酬		204,753.55	277,374.25
2. 托管费		20,475.35	27,737.42
3. 销售服务费		532.68	2,531.05
4. 交易费用	6.4.7.18	645,980.32	812,254.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		371.18	296.80
7. 其他费用	6.4.7.19	154,547.97	189,507.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,960,251.04</b>	<b>6,296,275.77</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,960,251.04</b>	<b>6,296,275.77</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,117,801.24	9,140,616.32	52,258,417.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	5,960,251.04	5,960,251.04

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	807,061.87	-507,803.34	299,258.53
其中: 1.基金申购款	33,102,996.59	7,115,326.23	40,218,322.82
2.基金赎回款	-32,295,934.72	-7,623,129.57	-39,919,064.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	43,924,863.11	14,593,064.02	58,517,927.13
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	88,993,426.20	4,860,847.11	93,854,273.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,296,275.77	6,296,275.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-51,168,161.72	-3,571,665.80	-54,739,827.52
其中: 1.基金申购款	6,797,733.35	505,724.91	7,303,458.26
2.基金赎回款	-57,965,895.07	-4,077,390.71	-62,043,285.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	37,825,264.48	7,585,457.08	45,410,721.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据经持有人大会表决通过的《关于国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》以及相关法律法规的相关规定, 由原国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金经

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

本基金已经中国证监会许可[2018]1593 号(文《关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》)准予变更注册。根据本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2019 年 4 月 16 日发布的《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》自 2019 年 5 月 17 日起生效,原《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自同日起失效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。原基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 52,819,484.65 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据申购费、销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,在投资人申购基金时收取申购费用,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人申购基金时不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服

务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

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

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

(c)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,437,560.93
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,437,560.93

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	49,875,678.89	52,447,180.73	2,571,501.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	30,940.80	6,940.80
	银行间市场	-	-
	合计	30,940.80	6,940.80
资产支持证券	-	-	-



基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	49,899,678.89	52,478,121.53	2,578,442.64

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	2,640,760.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,640,760.00	-	-	-

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有股指期货 IC2107，持仓为 2 手，合约市值为 2,706,880.00 元，公允价值变动为 66,120.00 元。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,217.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	699.16

应收债券利息	13.26
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.94
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	22.68
合计	1,954.17

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	175,014.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	175,014.43

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.35
应付证券出借违约金	-
预提费用	54,547.97
应付指数使用费	50,000.00
合计	104,548.32

#### 6.4.7.9 实收基金

国泰中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	12,187,355.91	12,187,355.91

本期申购	25,238,267.50	25,238,267.50
本期赎回（以“-”号填列）	-2,002,217.23	-2,002,217.23
本期末	35,423,406.18	35,423,406.18

国泰中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	30,930,445.33	30,930,445.33
本期申购	7,864,729.09	7,864,729.09
本期赎回（以“-”号填列）	-30,293,717.49	-30,293,717.49
本期末	8,501,456.93	8,501,456.93

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

国泰中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,522,006.62	1,201,337.45	2,723,344.07
本期利润	3,075,235.15	1,533,218.35	4,608,453.50
本期基金份额交易产生的变动数	4,422,277.09	135,118.73	4,557,395.82
其中：基金申购款	4,819,678.20	272,151.86	5,091,830.06
基金赎回款	-397,401.11	-137,033.13	-534,434.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,019,518.86	2,869,674.53	11,889,193.39

国泰中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,354,901.21	3,062,371.04	6,417,272.25
本期利润	1,117,682.38	234,115.16	1,351,797.54
本期基金份额交易产生的变动数	-2,463,151.17	-2,602,047.99	-5,065,199.16
其中：基金申购款	1,442,108.00	581,388.17	2,023,496.17
基金赎回款	-3,905,259.17	-3,183,436.16	-7,088,695.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,009,432.42	694,438.21	2,703,870.63

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,124.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,230.65
其他	432.34
合计	24,787.05

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	242,435,040.04
减：卖出股票成本总额	237,861,477.87
买卖股票差价收入	4,573,562.17

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,123,533.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,079,476.00
减：应收利息总额	33,389.94
买卖债券差价收入	10,667.59

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
买卖股指期货差价收入	103,106.80

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	484,348.59
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	484,348.59

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	1,701,213.51
——股票投资	1,698,567.91
——债券投资	2,645.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	66,120.00
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,767,333.51

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	20,380.07
转换费收入	1,169.10
合计	21,549.17

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

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	645,980.32
银行间市场交易费用	-
合计	645,980.32

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	154,547.97

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

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	204,753.55	277,374.25
其中：支付销售机构的客户维护费	7,231.89	7,725.24

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,475.35	27,737.42

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	440.02	440.02
合计	-	440.02	440.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C	合计
国泰基金管理有限公	-	2,396.04	2,396.04

司			
合计	-	2,396.04	2,396.04

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C	国泰中证500指数增强A	国泰中证500指数增强C
期初持有的基金份额	9,158,331.51	-	-	-
期间申购/买入总份额	24,183,971.31	-	4,196,045.51	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	33,342,302.82	-	4,196,045.51	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	75.91%	-	11.09%	-

注：基金管理人国泰基金管理有限公司在本会计期间申购本基金的交易委托国泰基金管理有限公司直销柜台办理，适用费用为 1,000.00 元。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。



#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	5,437,560.93	18,124.06	2,944,296.48	6,762.87

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配的情况。

#### 6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项	3.05	2021-07-14	3.36	200.00	674.99	610.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.05%(2020 年 12 月 31 日：0.06%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,437,560.93	-	-	-	5,437,560.93
结算备付金	590,156.71	-	-	-	590,156.71
存出保证金	434,892.12	-	-	-	434,892.12

交易性金融资产	-	-	30,940.80	52,447,180.73	52,478,121.53
应收利息	-	-	-	1,954.17	1,954.17
应收申购款	932.92	-	-	4,957.95	5,890.87
资产总计	6,463,542.68	-	30,940.80	52,454,092.85	58,948,576.33
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	95,921.20	95,921.20
应付管理人报酬	-	-	-	46,920.25	46,920.25
应付托管费	-	-	-	4,692.00	4,692.00
应付销售服务费	-	-	-	88.62	88.62
应付交易费用	-	-	-	175,014.43	175,014.43
应交税费	-	-	-	3,464.38	3,464.38
其他负债	-	-	-	104,548.32	104,548.32
负债总计	-	-	-	430,649.20	430,649.20
利率敏感度缺口	6,463,542.68	-	30,940.80	52,023,443.65	58,517,927.13
<b>上年度末</b>					
<b>2020 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					
银行存款	1,638,821.70	-	-	-	1,638,821.70
结算备付金	565,906.40	-	-	-	565,906.40
存出保证金	27,814.09	-	-	-	27,814.09
交易性金融资产	1,249,875.00	-	30,658.20	43,152,632.82	44,433,166.02
应收利息	-	-	-	28,472.58	28,472.58
应收申购款	209.99	-	-	6,109,226.64	6,109,436.63
资产总计	3,482,627.18	-	30,658.20	49,290,332.04	52,803,617.42
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	152,479.23	152,479.23
应付管理人报酬	-	-	-	39,998.46	39,998.46
应付托管费	-	-	-	3,999.84	3,999.84
应付销售服务费	-	-	-	320.64	320.64
应付交易费用	-	-	-	138,397.96	138,397.96
其他负债	-	-	-	210,003.73	210,003.73
负债总计	-	-	-	545,199.86	545,199.86
利率敏感度缺口	3,482,627.18	-	30,658.20	48,745,132.18	52,258,417.56

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2021 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资产净值的比例为 0.05%(2020 年 12 月 31 日:2.45%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	52,447,180.7	89.63	43,152,632.82	82.58

	3			
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	52,447,180.7	89.63	43,152,632.82	82.58
	3			

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基准指数外其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证 500 指数收益率上升 5%	增加约 276	增加约 233
	中证 500 指数收益率下降 5%	减少约 276	减少约 233

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 52,477,511.53 元，属于第二层次的余额为 610.00 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 43,149,519.27 元，第二层次 1,283,646.75 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。(2020 年 12 月 31 日,同)

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	52,447,180.73	88.97
	其中：股票	52,447,180.73	88.97



2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,940.80	0.05
	其中：债券	30,940.80	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,027,717.64	10.23
8	其他各项资产	442,737.16	0.75
9	合计	58,948,576.33	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	88,356.00	0.15
B	采矿业	1,452,699.28	2.48
C	制造业	35,146,204.22	60.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,908,371.32	3.26
E	建筑业	412,305.76	0.70
F	批发和零售业	2,320,309.00	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	2,301,242.80	3.93
H	住宿和餐饮业	605,615.80	1.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,128,516.28	1.93
J	金融业	2,301,839.60	3.93
K	房地产业	1,309,454.20	2.24
L	租赁和商务服务业	344,160.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	368,771.00	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	38,697.80	0.07
Q	卫生和社会工作	275,760.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	1,197,739.00	2.05
S	综合	772.28	0.00
	合计	51,200,814.34	87.50

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,041,227.67	1.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	644.30	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	651.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,175.30	0.18
J	金融业	5,358.06	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,940.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	76,370.06	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,246,366.39	2.13

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603486	科沃斯	4,100	935,128.00	1.60
2	000799	酒鬼酒	3,300	843,480.00	1.44
3	603737	三棵树	4,646	817,696.00	1.40
4	600884	杉杉股份	34,200	797,544.00	1.36
5	600885	宏发股份	11,386	713,902.20	1.22
6	603638	艾迪精密	16,156	692,607.72	1.18
7	600563	法拉电子	4,078	645,792.08	1.10
8	300482	万孚生物	9,840	636,549.60	1.09
9	002709	天赐材料	5,712	608,784.96	1.04
10	600315	上海家化	10,000	601,400.00	1.03
11	603260	合盛硅业	7,722	593,899.02	1.01
12	603605	珀莱雅	2,974	585,015.54	1.00
13	603866	桃李面包	17,990	561,288.00	0.96
14	600779	水井坊	4,348	549,369.80	0.94
15	600486	扬农化工	4,900	547,673.00	0.94
16	600038	中直股份	10,154	535,521.96	0.92
17	300463	迈克生物	12,700	534,543.00	0.91
18	600329	中新药业	18,854	529,608.86	0.91
19	601233	桐昆股份	21,900	527,571.00	0.90
20	600754	锦江酒店	9,084	517,333.80	0.88
21	603290	斯达半导	1,600	512,000.00	0.87
22	300037	新宙邦	5,100	510,510.00	0.87
23	603355	莱克电气	7,900	491,617.00	0.84
24	603589	口子窖	7,200	487,368.00	0.83
25	603225	新凤鸣	24,000	487,200.00	0.83
26	002080	中材科技	18,312	479,225.04	0.82
27	603883	老百姓	9,000	474,120.00	0.81
28	603893	瑞芯微	3,346	466,633.16	0.80
29	002212	天融信	23,600	466,572.00	0.80
30	603228	景旺电子	17,548	459,757.60	0.79
31	600022	山东钢铁	265,400	456,488.00	0.78
32	600729	重庆百货	16,460	451,827.00	0.77
33	000039	中集集团	24,800	450,864.00	0.77
34	600642	申能股份	72,775	446,838.50	0.76
35	300699	光威复材	5,850	444,307.50	0.76

36	603786	科博达	5,810	438,655.00	0.75
37	600373	中文传媒	44,100	434,826.00	0.74
38	601689	拓普集团	11,400	426,702.00	0.73
39	600507	方大特钢	62,516	423,858.48	0.72
40	603515	欧普照明	16,356	419,858.52	0.72
41	002595	豪迈科技	15,500	413,850.00	0.71
42	002985	北摩高科	4,230	412,425.00	0.70
43	603708	家家悦	23,700	411,669.00	0.70
44	601128	常熟银行	66,300	411,060.00	0.70
45	601928	凤凰传媒	57,200	408,408.00	0.70
46	601139	深圳燃气	62,160	407,769.60	0.70
47	600350	山东高速	66,200	407,130.00	0.70
48	603868	飞科电器	9,592	403,439.52	0.69
49	601512	中新集团	40,400	402,384.00	0.69
50	603056	德邦股份	36,440	400,475.60	0.68
51	002382	蓝帆医疗	19,000	396,150.00	0.68
52	600282	南钢股份	109,900	391,244.00	0.67
53	601298	青岛港	61,960	382,912.80	0.65
54	600188	兖州煤业	24,700	379,392.00	0.65
55	600808	马钢股份	86,600	371,514.00	0.63
56	600859	王府井	12,600	363,888.00	0.62
57	002648	卫星石化	8,980	351,926.20	0.60
58	002653	海思科	16,323	351,270.96	0.60
59	002966	苏州银行	47,700	350,595.00	0.60
60	600027	华电国际	98,400	338,496.00	0.58
61	600094	大名城	89,700	338,169.00	0.58
62	603568	伟明环保	14,700	335,601.00	0.57
63	000513	丽珠集团	6,600	330,132.00	0.56
64	002242	九阳股份	9,900	321,651.00	0.55
65	002901	大博医疗	4,400	320,716.00	0.55
66	300316	晶盛机电	6,300	318,150.00	0.54
67	600377	宁沪高速	32,500	317,200.00	0.54
68	601577	长沙银行	34,700	310,218.00	0.53
69	002925	盈趣科技	7,884	306,766.44	0.52
70	300223	北京君正	2,900	292,668.00	0.50
71	600398	海澜之家	39,800	288,152.00	0.49
72	300357	我武生物	4,483	287,449.96	0.49
73	600985	淮北矿业	23,300	284,493.00	0.49
74	601717	郑煤机	24,100	280,283.00	0.48
75	601991	大唐发电	104,800	276,672.00	0.47
76	001872	招商港口	16,300	275,796.00	0.47
77	300244	迪安诊断	7,200	275,760.00	0.47
78	601000	唐山港	113,100	272,571.00	0.47
79	600801	华新水泥	15,100	265,307.00	0.45

80	600901	江苏租赁	50,368	261,913.60	0.45
81	002603	以岭药业	8,928	260,340.48	0.44
82	603719	良品铺子	5,600	252,000.00	0.43
83	300630	普利制药	4,600	241,040.00	0.41
84	603712	七一二	6,600	238,260.00	0.41
85	002818	富森美	19,600	236,376.00	0.40
86	000528	柳工	28,600	234,520.00	0.40
87	002250	联化科技	8,300	231,570.00	0.40
88	300474	景嘉微	2,342	229,328.64	0.39
89	600782	新钢股份	40,700	227,106.00	0.39
90	000501	鄂武商 A	19,400	226,980.00	0.39
91	002074	国轩高科	5,200	226,512.00	0.39
92	600409	三友化工	22,276	225,210.36	0.38
93	002233	塔牌集团	21,800	224,104.00	0.38
94	601699	潞安环能	18,900	223,209.00	0.38
95	002078	太阳纸业	16,700	222,945.00	0.38
96	600567	山鹰国际	64,300	221,835.00	0.38
97	000581	威孚高科	10,300	214,549.00	0.37
98	600195	中牧股份	17,900	214,084.00	0.37
99	002867	周大生	10,742	212,369.34	0.36
100	002557	洽洽食品	4,900	211,190.00	0.36
101	600566	济川药业	11,594	207,532.60	0.35
102	603858	步长制药	9,200	206,908.00	0.35
103	002423	中粮资本	22,700	205,435.00	0.35
104	000090	天健集团	36,900	204,057.00	0.35
105	002839	张家港行	37,100	201,824.00	0.34
106	600089	特变电工	15,632	200,871.20	0.34
107	603198	迎驾贡酒	4,500	199,350.00	0.34
108	002353	杰瑞股份	4,400	196,680.00	0.34
109	600064	南京高科	21,100	196,019.00	0.33
110	603379	三美股份	10,360	193,835.60	0.33
111	603983	丸美股份	3,700	192,807.00	0.33
112	601801	皖新传媒	40,000	188,800.00	0.32
113	600497	驰宏锌锗	43,392	187,019.52	0.32
114	000685	中山公用	21,376	174,428.16	0.30
115	300115	长盈精密	8,220	169,332.00	0.29
116	688099	晶晨股份	1,487	166,841.40	0.29
117	601098	中南传媒	18,700	164,934.00	0.28
118	600166	福田汽车	47,800	164,910.00	0.28
119	601997	贵阳银行	22,800	163,248.00	0.28
120	600380	健康元	11,700	160,641.00	0.27
121	603707	健友股份	3,800	158,650.00	0.27
122	002138	顺络电子	4,066	157,638.82	0.27
123	603156	养元饮品	5,500	157,190.00	0.27

124	688208	道通科技	1,788	155,538.12	0.27
125	600498	烽火通信	8,300	154,629.00	0.26
126	600549	厦门钨业	7,300	152,059.00	0.26
127	002690	美亚光电	2,700	150,552.00	0.26
128	002507	涪陵榨菜	3,900	146,874.00	0.25
129	600529	山东药玻	4,300	145,985.00	0.25
130	600803	新奥股份	8,800	145,288.00	0.25
131	000623	吉林敖东	9,300	144,057.00	0.25
132	600126	杭钢股份	27,500	141,075.00	0.24
133	600060	海信视像	8,300	140,270.00	0.24
134	601975	招商南油	64,800	138,672.00	0.24
135	000825	太钢不锈	17,500	131,075.00	0.22
136	002926	华西证券	13,600	130,968.00	0.22
137	600131	国网信通	9,400	124,456.00	0.21
138	000999	华润三九	4,594	122,889.50	0.21
139	600895	张江高科	6,500	118,755.00	0.20
140	600325	华发股份	17,500	117,950.00	0.20
141	002683	宏大爆破	4,200	116,634.00	0.20
142	600728	佳都科技	15,400	114,114.00	0.20
143	000898	鞍钢股份	25,530	113,608.50	0.19
144	002511	中顺洁柔	4,100	112,955.00	0.19
145	600998	九州通	7,300	112,201.00	0.19
146	600039	四川路桥	17,300	108,471.00	0.19
147	600167	联美控股	11,910	106,356.30	0.18
148	603444	吉比特	200	106,000.00	0.18
149	000089	深圳机场	13,400	104,118.00	0.18
150	000990	诚志股份	8,148	103,724.04	0.18
151	600835	上海机电	6,300	102,375.00	0.17
152	002705	新宝股份	3,896	102,270.00	0.17
153	000758	中色股份	21,200	100,700.00	0.17
154	600633	浙数文化	13,600	97,648.00	0.17
155	300146	汤臣倍健	2,900	95,410.00	0.16
156	600219	南山铝业	26,200	94,320.00	0.16
157	600201	生物股份	5,300	92,485.00	0.16
158	300741	华宝股份	1,800	91,296.00	0.16
159	002299	圣农发展	3,700	88,356.00	0.15
160	600258	首旅酒店	3,700	88,282.00	0.15
161	600862	中航高科	2,800	86,184.00	0.15
162	002831	裕同科技	2,744	81,469.36	0.14
163	002030	达安基因	3,823	81,200.52	0.14
164	601198	东兴证券	7,400	80,882.00	0.14
165	002203	海亮股份	7,200	76,608.00	0.13
166	600580	卧龙电驱	5,716	76,022.80	0.13
167	601608	中信重工	20,200	75,548.00	0.13

168	002701	奥瑞金	13,900	71,446.00	0.12
169	600908	无锡银行	12,300	71,340.00	0.12
170	600643	爱建集团	9,900	69,102.00	0.12
171	600388	龙净环保	8,100	69,012.00	0.12
172	600707	彩虹股份	7,200	67,752.00	0.12
173	000869	张裕 A	1,800	66,852.00	0.11
174	600623	华谊集团	7,500	66,075.00	0.11
175	600764	中国海防	2,300	65,090.00	0.11
176	600871	石化油服	32,800	64,616.00	0.11
177	000061	农产品	11,700	64,584.00	0.11
178	600392	盛和资源	3,700	64,232.00	0.11
179	000031	大悦城	15,812	56,923.20	0.10
180	601117	中国化学	5,600	49,056.00	0.08
181	600068	葛洲坝	6,400	47,936.00	0.08
182	601168	西部矿业	4,000	47,720.00	0.08
183	300618	寒锐钴业	600	47,304.00	0.08
184	601828	美凯龙	3,600	43,200.00	0.07
185	001914	招商积余	2,500	42,950.00	0.07
186	002128	露天煤业	4,100	42,681.00	0.07
187	600390	五矿资本	6,900	41,262.00	0.07
188	601992	金隅集团	14,900	40,081.00	0.07
189	601179	中国西电	9,700	39,964.00	0.07
190	600597	光明乳业	2,700	38,907.00	0.07
191	603377	东方时尚	3,620	38,697.80	0.07
192	600446	金证股份	2,600	37,544.00	0.06
193	002124	天邦股份	4,800	33,648.00	0.06
194	000826	启迪环境	6,200	33,170.00	0.06
195	000732	泰禾集团	14,300	30,888.00	0.05
196	601636	旗滨集团	1,600	29,696.00	0.05
197	603650	彤程新材	400	19,240.00	0.03
198	300207	欣旺达	490	15,954.40	0.03
199	002294	信立泰	480	15,792.00	0.03
200	000028	国药一致	325	12,298.00	0.02
201	002048	宁波华翔	600	11,700.00	0.02
202	688002	睿创微纳	100	9,983.00	0.02
203	300418	昆仑万维	600	9,828.00	0.02
204	600956	新天绿能	800	9,368.00	0.02
205	603317	天味食品	300	8,829.00	0.02
206	000830	鲁西化工	400	7,492.00	0.01
207	601869	长飞光纤	300	7,308.00	0.01
208	002572	索菲亚	300	7,260.00	0.01
209	600739	辽宁成大	300	6,243.00	0.01
210	002372	伟星新材	300	6,201.00	0.01
211	000050	深天马 A	300	4,254.00	0.01

212	002281	光迅科技	170	4,182.00	0.01
213	002434	万里扬	500	4,055.00	0.01
214	600827	百联股份	200	4,030.00	0.01
215	002368	太极股份	198	3,971.88	0.01
216	002056	横店东磁	300	3,900.00	0.01
217	600348	华阳股份	500	3,710.00	0.01
218	002028	思源电气	100	3,079.00	0.01
219	002440	闰土股份	300	2,655.00	0.00
220	000959	首钢股份	458	2,573.96	0.00
221	000021	深科技	132	2,526.48	0.00
222	002815	崇达技术	200	2,496.00	0.00
223	300257	开山股份	166	2,385.42	0.00
224	000598	兴蓉环境	456	2,375.76	0.00
225	000988	华工科技	100	2,352.00	0.00
226	600056	中国医药	184	2,235.60	0.00
227	600155	华创阳安	200	2,140.00	0.00
228	002396	星网锐捷	100	2,135.00	0.00
229	600639	浦东金桥	140	1,911.00	0.00
230	600820	隧道股份	320	1,692.80	0.00
231	600648	外高桥	100	1,478.00	0.00
232	300166	东方国信	100	1,236.00	0.00
233	000401	冀东水泥	100	1,235.00	0.00
234	600867	通化东宝	100	1,194.00	0.00
235	002075	沙钢股份	106	1,156.46	0.00
236	002155	湖南黄金	148	1,147.00	0.00
237	600312	平高电气	190	1,109.60	0.00
238	002221	东华能源	100	1,095.00	0.00
239	002375	亚厦股份	138	1,092.96	0.00
240	600787	中储股份	200	1,066.00	0.00
241	002191	劲嘉股份	100	1,064.00	0.00
242	002416	爱施德	100	1,003.00	0.00
243	600649	城投控股	200	952.00	0.00
244	600160	巨化股份	100	884.00	0.00
245	000686	东北证券	100	845.00	0.00
246	600755	厦门国贸	100	821.00	0.00
247	600435	北方导航	100	794.00	0.00
248	600673	东阳光	172	772.28	0.00
249	000156	华数传媒	100	771.00	0.00
250	601003	柳钢股份	127	749.30	0.00
251	601958	金钼股份	112	725.76	0.00
252	600657	信达地产	200	696.00	0.00
253	002419	天虹股份	100	656.00	0.00
254	000563	陕国投 A	200	644.00	0.00
255	600811	东方集团	200	610.00	0.00



256	002429	兆驰股份	100	607.00	0.00
257	600376	首开股份	100	560.00	0.00
258	601778	晶科科技	100	546.00	0.00
259	601880	辽港股份	300	513.00	0.00
260	600266	城建发展	100	474.00	0.00
261	600717	天津港	120	470.40	0.00
262	000717	韶钢松山	100	459.00	0.00
263	002244	滨江集团	100	419.00	0.00
264	600823	世茂股份	100	404.00	0.00
265	000937	冀中能源	100	393.00	0.00
266	600582	天地科技	100	390.00	0.00
267	601860	紫金银行	100	363.00	0.00
268	601228	广州港	100	318.00	0.00
269	600959	江苏有线	100	305.00	0.00
270	600968	海油发展	100	259.00	0.00
271	600863	内蒙华电	100	233.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002568	百润股份	2,744	260,103.76	0.44
2	600426	华鲁恒升	5,960	184,462.00	0.32
3	603806	福斯特	1,719	180,718.47	0.31
4	300595	欧普康视	1,160	120,118.00	0.21
5	300496	中科创达	600	94,236.00	0.16
6	002791	坚朗五金	400	77,620.00	0.13
7	603882	金域医学	478	76,370.06	0.13
8	603345	安井食品	260	66,045.20	0.11
9	600132	重庆啤酒	278	55,030.10	0.09
10	300274	阳光电源	300	34,518.00	0.06
11	603338	浙江鼎力	338	19,837.22	0.03
12	601966	玲珑轮胎	400	17,496.00	0.03
13	300012	华测检测	500	15,940.00	0.03
14	002544	杰赛科技	895	11,939.30	0.02
15	601865	福莱特	264	10,435.92	0.02
16	002064	华峰化学	400	5,680.00	0.01
17	600053	九鼎投资	306	5,358.06	0.01
18	600143	金发科技	200	4,172.00	0.01
19	600079	人福医药	100	2,827.00	0.00
20	603328	依顿电子	200	1,490.00	0.00
21	600277	亿利洁能	200	674.00	0.00

22	600575	淮河能源	300	651.00	0.00
23	000543	皖能电力	170	644.30	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600754	锦江酒店	2,097,714.00	4.01
2	002212	天融信	1,798,193.00	3.44
3	002709	天赐材料	1,653,643.00	3.16
4	603486	科沃斯	1,627,983.00	3.12
5	603882	金域医学	1,611,944.00	3.08
6	603638	艾迪精密	1,586,466.94	3.04
7	603866	桃李面包	1,581,082.08	3.03
8	601233	桐昆股份	1,562,170.32	2.99
9	002250	联化科技	1,536,597.00	2.94
10	600901	江苏租赁	1,416,255.00	2.71
11	300357	我武生物	1,387,908.55	2.66
12	300595	欧普康视	1,378,696.39	2.64
13	603355	莱克电气	1,344,772.00	2.57
14	300482	万孚生物	1,330,750.00	2.55
15	600315	上海家化	1,329,929.00	2.54
16	300274	阳光电源	1,312,017.00	2.51
17	603883	老百姓	1,283,073.00	2.46
18	000999	华润三九	1,280,609.00	2.45
19	002138	顺络电子	1,262,138.00	2.42
20	002353	杰瑞股份	1,251,418.00	2.39
21	300496	中科创达	1,243,024.00	2.38
22	600132	重庆啤酒	1,237,159.00	2.37
23	002925	盈趣科技	1,235,728.00	2.36
24	002791	坚朗五金	1,224,516.00	2.34
25	002568	百润股份	1,214,264.00	2.32
26	600566	济川药业	1,203,410.00	2.30
27	603589	口子窖	1,200,182.00	2.30
28	603444	吉比特	1,190,928.00	2.28
29	300699	光威复材	1,188,861.00	2.27
30	002920	德赛西威	1,173,025.00	2.24
31	600729	重庆百货	1,170,953.00	2.24
32	300463	迈克生物	1,168,334.00	2.24
33	600167	联美控股	1,157,204.00	2.21

34	002985	北摩高科	1,152,233.40	2.20
35	603786	科博达	1,147,916.00	2.20
36	600808	马钢股份	1,139,503.00	2.18
37	603345	安井食品	1,129,897.00	2.16
38	300630	普利制药	1,129,306.00	2.16
39	002080	中材科技	1,124,278.56	2.15
40	600038	中直股份	1,120,332.02	2.14
41	603338	浙江鼎力	1,105,132.00	2.11
42	002705	新宝股份	1,105,070.00	2.11
43	000060	中金岭南	1,092,710.48	2.09
44	002648	卫星石化	1,090,896.00	2.09
45	000090	天健集团	1,090,571.00	2.09
46	002557	洽洽食品	1,080,324.00	2.07
47	002839	张家港行	1,079,147.00	2.07
48	603228	景旺电子	1,078,751.35	2.06
49	300244	迪安诊断	1,076,352.00	2.06
50	603816	顾家家居	1,048,255.00	2.01

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	2,406,293.19	4.60
2	603882	金域医学	2,247,616.42	4.30
3	300595	欧普康视	2,040,651.85	3.90
4	002709	天赐材料	1,908,783.22	3.65
5	300496	中科创达	1,878,108.00	3.59
6	600132	重庆啤酒	1,859,230.59	3.56
7	601233	桐昆股份	1,722,509.49	3.30
8	603444	吉比特	1,702,605.00	3.26
9	600754	锦江酒店	1,633,095.19	3.13
10	002138	顺络电子	1,583,889.14	3.03
11	300357	我武生物	1,583,016.00	3.03
12	600426	华鲁恒升	1,552,319.56	2.97
13	603816	顾家家居	1,527,885.50	2.92
14	601799	星宇股份	1,489,315.05	2.85
15	603806	福斯特	1,463,468.80	2.80
16	002250	联化科技	1,441,929.00	2.76
17	601966	玲珑轮胎	1,381,694.33	2.64
18	300012	华测检测	1,364,249.56	2.61

19	603338	浙江鼎力	1,359,603.28	2.60
20	600739	辽宁成大	1,339,162.80	2.56
21	601168	西部矿业	1,338,612.00	2.56
22	002212	天融信	1,333,769.06	2.55
23	002648	卫星石化	1,323,148.77	2.53
24	603866	桃李面包	1,318,660.60	2.52
25	300207	欣旺达	1,307,012.47	2.50
26	002925	盈趣科技	1,287,298.06	2.46
27	002507	涪陵榨菜	1,248,848.00	2.39
28	002078	太阳纸业	1,244,819.28	2.38
29	600079	人福医药	1,235,599.00	2.36
30	002557	洽洽食品	1,227,267.00	2.35
31	002030	达安基因	1,217,023.91	2.33
32	300316	晶盛机电	1,206,464.00	2.31
33	603650	彤程新材	1,203,672.56	2.30
34	002920	德赛西威	1,194,070.00	2.28
35	600143	金发科技	1,186,950.00	2.27
36	002791	坚朗五金	1,179,500.00	2.26
37	603345	安井食品	1,174,456.20	2.25
38	002281	光迅科技	1,165,824.58	2.23
39	000999	华润三九	1,165,479.22	2.23
40	000581	威孚高科	1,157,270.00	2.21
41	002080	中材科技	1,146,696.00	2.19
42	000685	中山公用	1,126,920.56	2.16
43	002233	塔牌集团	1,123,350.32	2.15
44	600901	江苏租赁	1,119,991.68	2.14
45	603486	科沃斯	1,113,982.00	2.13
46	000060	中金岭南	1,113,872.63	2.13
47	600779	水井坊	1,110,880.68	2.13
48	002690	美亚光电	1,094,815.00	2.10
49	603355	莱克电气	1,073,729.00	2.05
50	002075	沙钢股份	1,064,532.02	2.04
51	002353	杰瑞股份	1,064,256.36	2.04
52	000598	兴蓉环境	1,063,805.56	2.04
53	002048	宁波华翔	1,057,895.00	2.02
54	300285	国瓷材料	1,053,443.09	2.02

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	245,457,457.87
卖出股票的收入（成交）总额	242,435,040.04

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	30,940.80	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,940.80	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113623	凤 21 转债	240	30,940.80	0.05

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2107	IC2107	2.00	2,706,880.00	66,120.00	套保
公允价值变动总额合计					66,120.00
股指期货投资本期收益					106,200.00
股指期货投资本期公允价值变动					66,120.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“酒鬼酒”、“三棵树”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

酒鬼酒公司本身由于通过非法定信息披露渠道自行对外发布涉及公司经营的重要信息等原因，受到深圳证券交易所监管关注等监管措施。

三棵树公司本身由于募集资金管理存在一定问题：募集资金管理制度不够完善；设立募集资金专户未经董事会批准；变更后的募投项目部分票据日期早于变更审批程序等原因，受到当地证监局监管关注等监管措施。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	434,892.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,954.17
5	应收申购款	5,890.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,737.16

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

		额	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰中证 500 指数增强 A	342	103,577.21	33,342,302.82	94.13%	2,081,103.36	5.87%
国泰中证 500 指数增强 C	156	54,496.52	5,942,476.82	69.90%	2,558,980.11	30.10%
合计	498	88,202.54	39,284,779.64	89.44%	4,640,083.47	10.56%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰中证 500 指数增强 A	20,099.45	0.06%
	国泰中证 500 指数增强 C	2,148.28	0.03%
	合计	22,247.73	0.05%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰中证 500 指数增强 A	0~10
	国泰中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰中证 500 指数增强 A	0
	国泰中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰中证 500 指数增强 A	国泰中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 17）	503,992.20	52,535,553.55



日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	12,187,355.91	30,930,445.33
本报告期基金总申购份额	25,238,267.50	7,864,729.09
减: 本报告期基金总赎回份额	2,002,217.23	30,293,717.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,423,406.18	8,501,456.93

## 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:

2021 年 3 月 31 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任职公告》, 经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过, 张玮先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日, 本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》, 经本基金管理人股东会审议通过, 对本基金管理人董事会成员进行了调整。

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

报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
华创证券	2	435,633,824.90	89.29%	322,924.11	89.68%	-
东方财富证券	2	52,258,673.01	10.71%	37,173.15	10.32%	本期新增

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	1,652,980.75	100.00%	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
2	国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
3	国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》	2021-04-01

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年01月01日至2021年06月30日	9,158,331.51	24,183,971.31	-	33,342,302.82	75.91%
	2	2021年01月01日至2021年01月26日	12,695,923.64	-	12,695,923.64	-	-
	3	2021年01月01日至2021年01月03日	15,947,401.69	-	15,947,401.69	-	-
	4	2021年02月23日至2021年03月25日	-	5,942,476.82	-	5,942,476.82	13.53%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- 2、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 12.2 存放地点

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

基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日