

**国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2022 年年度报告**  
**2022 年 12 月 31 日**

**基金管理人：国泰基金管理有限公司**

**基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司**

**报告送出日期：二〇二三年三月三十日**

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
<b>§5 托管人报告</b>	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
<b>§6 审计报告</b>	20
6.1 审计意见	20
6.2 形成审计意见的基础	20
6.3 管理层对财务报表的责任	21
6.4 注册会计师的责任	21
<b>§7 年度财务报表</b>	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
<b>§8 投资组合报告</b>	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	62
8.3 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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79

8.6	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 .....	79
8.7	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 .....	80
8.8	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 .....	80
8.9	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 .....	80
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	80
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	80
8.12	投资组合报告附注 .....	80
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>81</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	81
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	81
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	82
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	82
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>82</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>82</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	83
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	83
11.4	基金投资策略的改变 .....	83
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	83
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	83
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	83
11.8	其他重大事件 .....	84
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>84</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>85</b>
13.1	备查文件目录 .....	85
13.2	存放地点 .....	85
13.3	查阅方式 .....	85

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 500ETF
场内简称	国泰中证 500ETF
基金主代码	561350
交易代码	561350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	202,700,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 1 日

### 2.2 基金产品说明

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

	<p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-24,985,206.95	7,235,249.08
本期利润	-34,034,356.21	10,688,319.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1636	0.0319
本期加权平均净值利润率	-18.03%	3.13%
本期基金份额净值增长率	-17.78%	4.72%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-28,175,629.86	8,230,092.50
期末可供分配基金份额利润	-0.1390	0.0321
期末基金资产净值	174,524,370.14	268,821,699.55
期末基金份额净值	0.8610	1.0472
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末

基金份额累计净值增长率	-13.90%	4.72%
-------------	---------	-------

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

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

### 3.2 基金净值表现

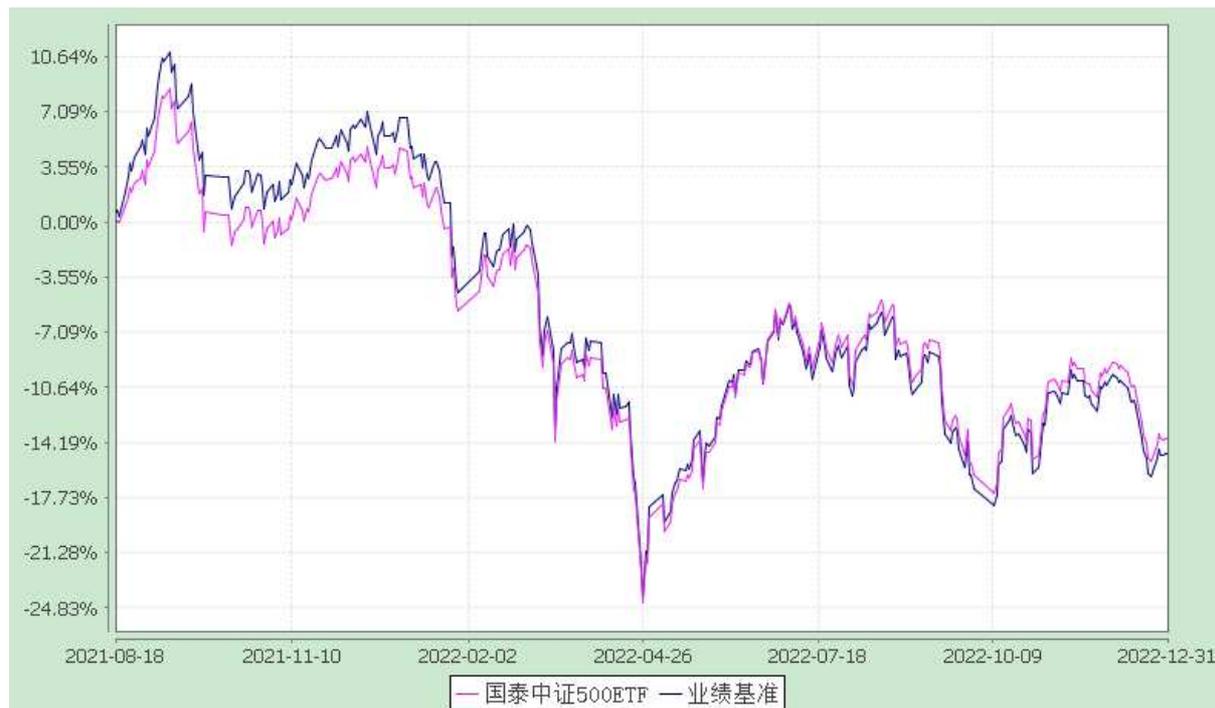
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.87%	1.01%	2.63%	1.03%	0.24%	-0.02%
过去六个月	-8.16%	1.07%	-9.14%	1.10%	0.98%	-0.03%
过去一年	-17.78%	1.34%	-20.31%	1.38%	2.53%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-13.90%	1.23%	-14.94%	1.27%	1.04%	-0.04%

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

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021 年 8 月 18 日至 2022 年 12 月 31 日)

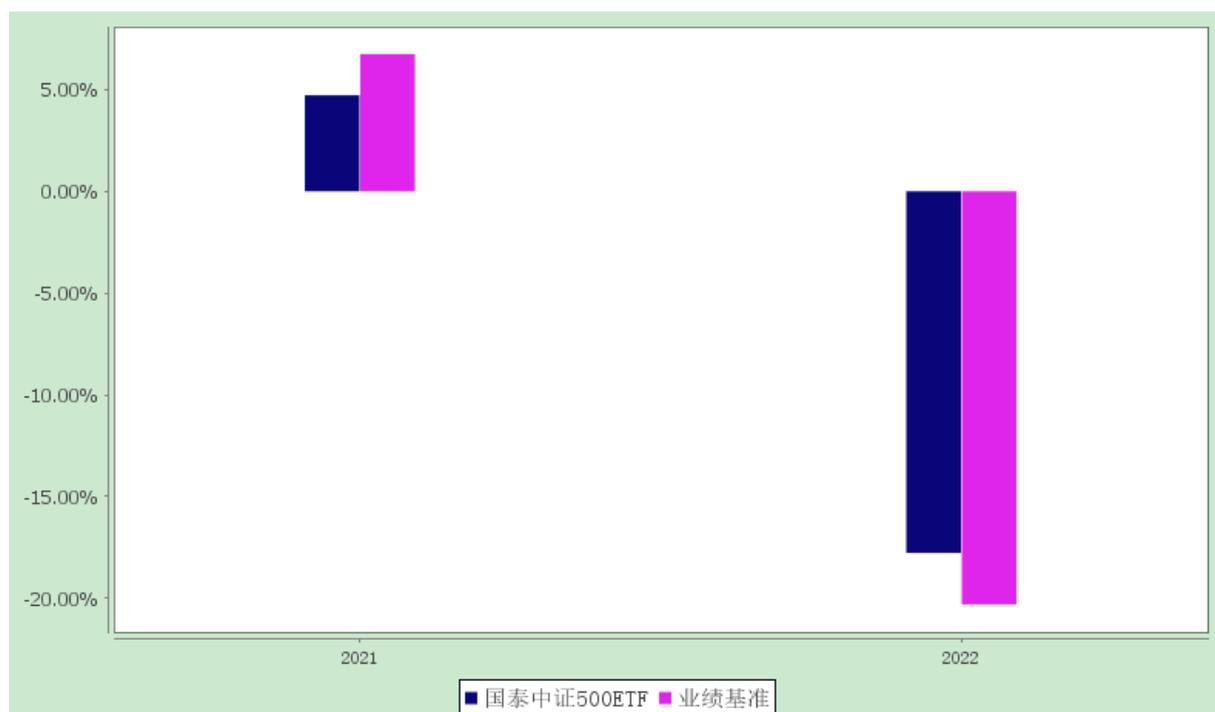


注：本基金的合同生效日为 2021 年 8 月 18 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：2021 年计算期间为基金合同生效日 2021 年 8 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日，未按整个自  
第 9 页共 86 页

然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2021 年 8 月 18 日）至本报告期末未发生利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 239 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证券投资基金（由国泰民安增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来）、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（LOF）（由国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、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、国泰浩益混合型证券投资基金（原国泰浩益 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、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金、国泰中证光伏产业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发起式联接基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值领航股票型证券投资基金、国泰价值远见两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、国泰兴泽优选一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰惠元混合型证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰景气优选混合型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、国泰中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、国泰致和两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金、国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰睿毅三年持有期混合型证券投资基金、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰行业轮动一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）、国泰智享科技 1 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金、国泰国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞悦 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、国泰睿鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、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）、国泰信瑞纯债债券型证券投资基金、国泰国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰利盈 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰鑫裕纯债债券

型证券投资基金、国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰利安中短债债券型证券投资基金、国泰利享安益短债债券型证券投资基金、国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰国证绿色电力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		
黄岳	国泰中证生物医药 ETF、国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰中证医疗 ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF、国泰中证科创创业 50ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF 发起联接、国泰中证 500ETF、国泰中证科创创业 50ETF 发起联接、国泰中证智能汽车主题 ETF、国泰中证 500ETF 发起联接、国泰中证消费电子主题 ETF、国泰中证消费电子主题 ETF 发起联接、国	2021-08-18	-	8 年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 2 月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 9 月起兼任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起

	泰中证沪港深动漫游戏 ETF 的基金经理			式联接基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 3 月起兼任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	----------------------	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

##### (一) 本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见, 我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析, 我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下, 且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### (二) 扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口, 将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均, 并以此为依据, 进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对 (样本数 $\geq 30$ ), 溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见, 对于溢价率均值过大的基金或组合配对, 我们也进行了模拟溢价金额计算。

##### (三) 基金或组合间模拟溢价金额分析

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金组合与其他投资组合之间, 由于组合流动性管理或投资策略调整需要, 参

与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 1 次。本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年市场跌宕起伏，整体弱势运行。上半年在俄乌冲突突然爆发，美联储货币政策加速收紧，上海为代表的华东地区疫情爆发等多重因素影响下，A 股出现较大波动，上证指数创下 2863 点年内低点。随后随着上海疫情逐渐结束，在乘用车购置税减免等一系列强有力的经济政策支撑下，以汽车、新能源为代表的板块走出一波强势反弹，并逐渐扩散到小盘股。下半年国内饱受疫情扰动，基本面和情绪同步走弱，上证指数创下 2885 年内次低点。随后随着疫情管控措施的大幅调整，地产三箭齐发，市场情绪快速回暖。以软硬科技、金融地产、消费等板块先后走出强劲反弹。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为-17.78%，同期业绩比较基准收益率为-20.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

中证 500 估值水平处于历史低位，配置性价比凸显。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，

提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 20889 号

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“国泰中证 500ETF”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国泰中证 500ETF 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

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

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

### 6.3 管理层对财务报表的责任

国泰中证 500ETF 的基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

基金管理人治理层负责监督国泰中证 500ETF 的财务报告过程。

### 6.4 注册会计师的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张炯 张晓阳

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,486,460.55	5,204,656.85
结算备付金		177,157.02	940,810.34
存出保证金		233,521.48	1,002,557.56
交易性金融资产	7.4.7.2	171,982,299.45	261,991,440.78
其中：股票投资		171,947,298.99	261,961,440.78

基金投资		-	-
债券投资		35,000.46	30,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		346,048.68	1,685,759.49
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	2,300.96
资产总计		175,225,487.18	270,827,525.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,132.73	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		77,851.58	115,379.78
应付托管费		15,570.34	23,075.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.02	0.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	601,562.37	1,867,370.43
负债合计		701,117.04	2,005,826.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	202,700,000.00	256,700,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-28,175,629.86	12,121,699.55
净资产合计		174,524,370.14	268,821,699.55
负债和净资产总计		175,225,487.18	270,827,525.98

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8610 元，基金份额总额 202,700,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日 (基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-32,717,880.49	13,177,367.92
1.利息收入		61,594.55	162,162.50
其中：存款利息收入	7.4.7.9	60,032.49	137,986.05
债券利息收入		-	27.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	24,149.43
证券出借利息收入		1,562.06	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,035,323.57	8,813,641.45
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-27,883,378.12	8,509,202.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	78,762.57	33,787.24
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	2,769,291.98	270,651.65
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-9,049,149.26	3,453,070.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	1,304,997.79	748,493.96
<b>减：二、营业总支出</b>		1,316,475.72	2,489,048.83
1. 管理人报酬		947,012.36	640,607.66
2. 托管费		189,402.42	128,121.49
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		5.91	0.07
8. 其他费用	7.4.7.16	180,055.03	1,720,319.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-34,034,356.21</b>	<b>10,688,319.09</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-34,034,356.21</b>	<b>10,688,319.09</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-34,034,356.21</b>	<b>10,688,319.09</b>

注：比较财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	256,700,000.00	12,121,699.55	268,821,699.55
二、本期期初净资产（基金净值）	256,700,000.00	12,121,699.55	268,821,699.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-54,000,000.00	-40,297,329.41	-94,297,329.41
（一）、综合收益总额	-	-34,034,356.21	-34,034,356.21
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-54,000,000.00	-6,262,973.20	-60,262,973.20
其中：1.基金申购款	1,119,000,000.00	-125,102,272.49	993,897,727.51
2.基金赎回款	-1,173,000,000.00	118,839,299.29	-1,054,160,700.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	202,700,000.00	-28,175,629.86	174,524,370.14

项目	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	727,700,000.00	-	727,700,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-471,000,000.00	12,121,699.55	-458,878,300.45
（一）、综合收益总额	-	10,688,319.09	10,688,319.09
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-471,000,000.00	1,433,380.46	-469,566,619.54
其中：1.基金申购款	699,000,000.00	27,946,096.12	726,946,096.12
2.基金赎回款	-1,170,000,000.00	-26,512,715.66	-1,196,512,715.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	256,700,000.00	12,121,699.55	268,821,699.55

注：比较财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇 主管会计工作负责人：倪莹 会计机构负责人：吴洪涛

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1958 号《关于准予国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%, 因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准: 中证 500 指数收益率。

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

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准

则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

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

##### (1) 金融资产

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

## 债务工具

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

### 以摊余成本计量：

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

### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

## 权益工具

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

### (2) 金融负债

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

### (3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 5,204,656.85 元、940,810.34 元、1,002,557.56 元、2,300.96 元和 1,685,759.49 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 5,205,991.13 元、941,276.08 元、1,003,053.77 元、0.00 元和 1,685,759.49 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 261,991,440.78 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 261,991,445.51 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 115,379.78 元、23,075.95 元、135,152.24 元和 1,616,218.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 115,379.78 元、23,075.95 元、135,152.24 元和 1,616,218.19 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、

“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、

财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、

财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,486,460.55	5,204,656.85
等于：本金	2,485,889.99	5,204,656.85
加：应计利息	570.56	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	2,486,460.55	5,204,656.85

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		177,543,378.24	-	171,947,298.99	-5,596,079.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	35,000.00	0.46	35,000.46	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	35,000.00	0.46	35,000.46	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		177,578,378.24	0.46	171,982,299.45	-5,596,079.25
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		258,508,370.77	-	261,961,440.78	3,453,070.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	30,000.00	-	30,000.00	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	30,000.00	-	30,000.00	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	258,538,370.77	-	261,991,440.78	3,453,070.01

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	2,300.96
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,300.96

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	61,431.29	135,152.24
其中：交易所市场	61,431.29	135,152.24
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	116,000.00
可退替代款	464.10	602.40
应付替代款	359,666.98	1,615,615.79
合计	601,562.37	1,867,370.43

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

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

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	256,700,000.00	256,700,000.00
本期申购	1,119,000,000.00	1,119,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,173,000,000.00	-1,173,000,000.00
本期末	202,700,000.00	202,700,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,230,092.50	3,891,607.05	12,121,699.55
本期利润	-24,985,206.95	-9,049,149.26	-34,034,356.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,448,651.96	-3,814,321.24	-6,262,973.20

其中：基金申购款	-91,789,173.42	-33,313,099.07	-125,102,272.49
基金赎回款	89,340,521.46	29,498,777.83	118,839,299.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,203,766.41	-8,971,863.45	-28,175,629.86

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	39,835.43	111,472.28
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	12,618.03	22,563.56
其他	7,579.03	3,950.21
合计	60,032.49	137,986.05

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,667,932.82	2,890,298.04
股票投资收益——赎回差价收入	-11,215,445.30	5,618,904.52
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	-27,883,378.12	8,509,202.56

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

		日
卖出股票成交总额	585,487,762.93	676,256,883.29
减：卖出股票成本总额	601,151,842.92	673,366,585.25
减：交易费用	1,003,852.83	-
买卖股票差价收入	-16,667,932.82	2,890,298.04

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合 同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,054,160,700.71	1,196,512,715.66
减：现金支付赎回款总额	509,988,755.71	605,196,518.66
减：赎回股票成本总额	555,387,390.30	585,697,292.48
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-11,215,445.30	5,618,904.52

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合 同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	76.32	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	78,686.25	33,787.24
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	78,762.57	33,787.24

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日（基金合 同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 额	458,585.87	165,810.10

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	379,800.00	132,000.00
减：应计利息总额	82.92	22.86
减：交易费用	16.70	-
买卖债券差价收入	78,686.25	33,787.24

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,769,291.98	270,651.65
其中：证券出借权益补偿收入	1,010.07	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,769,291.98	270,651.65

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-9,049,149.26	3,453,070.01
——股票投资	-9,049,149.26	3,453,070.01
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-9,049,149.26	3,453,070.01

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF 替代损益	1,304,997.79	607,084.38
其他	-	141,409.58
合计	1,304,997.79	748,493.96

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。

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	66,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
存托服务费	55.03	-
交易费用	-	1,604,319.61
合计	180,055.03	1,720,319.61

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰中证 500ETF 发起联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	947,012.36	640,607.66
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	189,402.42	128,121.49

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰中证 500ETF 发起联接	15,378,717.00	7.59%	10,842,229.00	4.22%

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月18日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	2,486,460.55	39,835.43	5,204,656.85	111,472.28

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型							
688035	德邦科技	2022-09-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	46.12	48.82	1,594.00	73,515.28	77,819.08	-	
688141	杰华特	2022-12-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	38.26	43.89	1,740.00	66,572.40	76,368.60	-	
688244	永信至诚	2022-10-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	49.19	50.14	1,248.00	61,389.12	62,574.72	-	
688503	聚和材料	2022-12-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	110.00	136.39	409.00	44,990.00	55,783.51	-	
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.65	69.68	216.00	7,268.40	15,050.88	-	
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	32.69	87.94	131.00	4,282.39	11,520.14	-	
301175	中科环保	2022-06-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	3.82	6.01	1,853.00	7,078.46	11,136.53	-	
301095	广立微	2022-07-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	58.00	86.49	122.00	7,076.00	10,551.78	-	
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.00	7.53	1,184.00	5,920.00	8,915.52	-	
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	50.88	66.20	133.00	6,767.04	8,804.60	-	
301297	富乐德	2022-12-23	6 个月以上	新股锁定	8.48	12.99	671.00	5,690.08	8,716.29	-	

				流通受限							
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	237.50	176.97	49.00	11,637.50	8,671.53	-	
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	119.88	175.78	47.00	5,634.36	8,261.66	-	
301391	卡莱特	2022-11-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	96.00	80.97	75.00	7,200.00	6,072.75	-	
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	30.66	37.85	154.00	4,721.64	5,828.90	-	
301277	新天地	2022-11-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	27.00	25.78	220.00	5,940.00	5,671.60	-	
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	22.88	17.63	318.00	7,275.84	5,606.34	-	
301379	天山电子	2022-11-19	6 个月以上	新股锁定流通受限	31.51	24.63	208.00	6,554.08	5,123.04	-	
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月以上	新股锁定流通受限	25.25	29.14	171.00	4,317.75	4,982.94	-	
301273	瑞晨环保	2022-11-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	37.89	37.79	129.00	4,887.81	4,874.91	-	
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	7.60	14.32	303.00	2,302.80	4,338.96	-	
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月以上	新股锁定流通	78.80	76.96	56.00	4,412.80	4,309.76	-	

				受限						
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	25.68	28.37	147.00	3,774.96	4,170.39	-
301306	西测测试	2022-07-19	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	43.23	42.29	95.00	4,106.85	4,017.55	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	13.28	11.40	324.00	4,302.72	3,693.60	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	18.18	17.72	207.00	3,763.26	3,668.04	-
301197	工大科雅	2022-07-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	25.50	20.08	182.00	4,641.00	3,654.56	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	47.75	53.27	68.00	3,247.00	3,622.36	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	30.38	25.25	117.00	3,554.46	2,954.25	-
301318	维海德	2022-08-03	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	64.68	41.74	69.00	4,462.92	2,880.06	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	138.88	103.52	27.00	3,749.76	2,795.04	-
<b>7.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注

118030	睿创转债	2022-12-30	1-6 个月(含)	配债未上市	100.00	100.00	350.00	35,000.00	35,000.46	-
--------	------	------------	-----------	-------	--------	--------	--------	-----------	-----------	---

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金获配的创业板股票如经摇号限售或者比例限售方式锁定的，锁定期限至少为自发行人股票上市之日起 6 个月。

#### 7.4.12.2 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	复牌开盘单盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	-	-	5,400.00	320,463.35	287,712.00	-
600038	中直股份	2022-12-26	重大事项停牌	46.41	-	-	8,100.00	354,900.18	375,921.00	-

注：本基金截至 2022 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货

币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金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。本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有信用类债券比例为 0.02%(2021 年 12 月 31 日：0.01%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风

险来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,486,460.55	-	-	-	2,486,460.55
结算备付金	177,157.02	-	-	-	177,157.02
存出保证金	233,521.48	-	-	-	233,521.48
交易性金融资产	-	-	35,000.46	171,947,298.99	171,982,299.45
应收清算款	-	-	-	346,048.68	346,048.68
资产总计	2,897,139.05	-	35,000.46	172,293,347.67	175,225,487.18
负债					
应付清算款	-	-	-	6,132.73	6,132.73
应付管理人报酬	-	-	-	77,851.58	77,851.58
应付托管费	-	-	-	15,570.34	15,570.34
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	601,562.37	601,562.37
负债总计	-	-	-	701,117.04	701,117.04
利率敏感度缺口	2,897,139.05	-	35,000.46	171,592,230.63	174,524,370.14
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	5,204,656.85	-	-	-	5,204,656.85
结算备付金	940,810.34	-	-	-	940,810.34

存出保证金	1,002,557.56	-	-	-	1,002,557.56
交易性金融资产	-	-	30,000.00	261,961,440.78	261,991,440.78
应收清算款	-	-	-	1,685,759.49	1,685,759.49
其他资产	-	-	-	2,300.96	2,300.96
资产总计	7,148,024.75	-	30,000.00	263,649,501.23	270,827,525.98
负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	115,379.78	115,379.78
应付托管费	-	-	-	23,075.95	23,075.95
应交税费	-	-	-	0.27	0.27
其他负债	-	-	-	1,867,370.43	1,867,370.43
负债总计	-	-	-	2,005,826.43	2,005,826.43
利率敏感度缺口	7,148,024.75	-	30,000.00	261,643,674.80	268,821,699.55

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.02%（2021 年 12 月 31 日：0.01%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求

进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	171,947,298.99	98.52	261,961,440.78	97.45
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	-	-	-	-
合计	171,947,298.99	98.52	261,961,440.78	97.45

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 8,492,323.11	-
	业绩比较基准下降 5%	减少约 8,492,323.11	-

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	170,841,226.10	260,720,517.36
第二层次	698,633.46	865,523.07
第三层次	442,439.89	405,400.35
合计	171,982,299.45	261,991,440.78

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	405,400.35	405,400.35
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	803,291.69	803,291.69
转出第三层次	-	748,617.91	748,617.91
当期利得或损失总额	-	-17,634.24	-17,634.24
其中：计入损益的	-	-17,634.24	-17,634.24

利得或损失			
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-		-
期末余额	-	442,439.89	442,439.89
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	51,403.21	51,403.21
项目	上年度可比期间		
	2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-		-
当期购买	-	385,919.98	385,919.98
当期出售/结算	-		-
转入第三层次	-		-
转出第三层次	-		-
当期利得或损失总额	-	19,480.37	19,480.37
其中：计入损益的利得或损失	-	19,480.37	19,480.37
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-		-
期末余额	-	405,400.35	405,400.35
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	19,480.37	19,480.37

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股	442,439.89	平均价格亚式期	预期波动		负相关

票		权模型	率	23.19%-247.56%	
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	405,400.35	平均价格亚式期权模型	预期波动率	21.89%-274.17%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日:同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于本会计期间,本基金申购基金份额的对价总额为 993,897,727.51 元(2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止:726,946,096.12 元),其中包括以股票支付的申购款 419,127,817.90 元和以现金支付的申购款 574,769,909.61 元(2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止:其中包括以股票支付的申购款 305,319,314.18 元和以现金支付的申购款 421,626,781.94 元)。

(2) 除基金申购款外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	171,947,298.99	98.13
	其中:股票	171,947,298.99	98.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,000.46	0.02
	其中:债券	35,000.46	0.02
	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	2,663,617.57	1.52
8	其他各项资产	579,570.16	0.33
9	合计	175,225,487.18	100.00

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

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

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,617,032.60	0.93
B	采矿业	7,422,645.56	4.25
C	制造业	102,855,684.38	58.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,658,953.90	3.24
E	建筑业	1,501,660.80	0.86
F	批发和零售业	7,172,978.20	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	3,766,303.96	2.16
H	住宿和餐饮业	441,440.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,158,269.55	6.97
J	金融业	14,716,234.05	8.43

K	房地产业	3,504,377.15	2.01
L	租赁和商务服务业	1,969,554.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	1,853,456.12	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	946,372.27	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	334,229.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	2,237,876.00	1.28
S	综合	1,011,341.00	0.58
	合计	169,168,408.54	96.93

### 8.2.2 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	3,495.00	0.00
C	制造业	1,013,735.07	0.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	462,070.00	0.26
E	建筑业	798,764.00	0.46
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	86,247.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,461.53	0.06
J	金融业	261,392.00	0.15
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	12,733.84	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	11,136.53	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,855.48	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,778,890.45	1.59

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	002340	格林美	136,400	1,013,452.00	0.58
2	300012	华测检测	44,600	994,580.00	0.57
3	600157	永泰能源	590,300	903,159.00	0.52
4	002384	东山精密	36,300	897,699.00	0.51
5	688777	中控技术	9,332	847,625.56	0.49
6	300724	捷佳伟创	7,400	843,748.00	0.48
7	603613	国联股份	9,360	827,798.40	0.47
8	688122	西部超导	8,606	814,902.14	0.47
9	300003	乐普医疗	35,000	803,950.00	0.46
10	002422	科伦药业	30,100	800,961.00	0.46
11	601117	中国化学	100,600	798,764.00	0.46
12	600487	亨通光电	52,400	789,144.00	0.45
13	688063	派能科技	2,500	789,125.00	0.45
14	002385	大北农	88,100	784,090.00	0.45
15	002966	苏州银行	97,410	757,849.80	0.43
16	603345	安井食品	4,600	744,648.00	0.43
17	600885	宏发股份	22,220	742,370.20	0.43
18	603606	东方电缆	10,900	739,347.00	0.42
19	600765	中航重机	23,380	726,884.20	0.42
20	600079	人福医药	30,300	723,867.00	0.41
21	600096	云天化	34,200	719,568.00	0.41
22	002497	雅化集团	30,600	711,450.00	0.41
23	601555	东吴证券	106,460	695,183.80	0.40
24	600352	浙江龙盛	69,100	684,090.00	0.39

25	002625	光启技术	40,100	682,502.00	0.39
26	002407	多氟多	20,400	679,728.00	0.39
27	002603	以岭药业	22,240	666,310.40	0.38
28	000009	中国宝安	54,900	663,741.00	0.38
29	600884	杉杉股份	35,900	653,380.00	0.37
30	002738	中矿资源	9,800	653,268.00	0.37
31	601058	赛轮轮胎	65,100	652,302.00	0.37
32	601233	桐昆股份	44,800	647,360.00	0.37
33	688390	固德威	1,996	644,887.64	0.37
34	600988	赤峰黄金	35,400	638,970.00	0.37
35	600489	中金黄金	77,300	633,087.00	0.36
36	603688	石英股份	4,800	630,336.00	0.36
37	603605	珀莱雅	3,760	629,724.80	0.36
38	600298	安琪酵母	13,900	628,558.00	0.36
39	002028	思源电气	16,300	622,986.00	0.36
40	300146	汤臣倍健	27,100	618,422.00	0.35
41	601108	财通证券	86,380	615,025.60	0.35
42	000807	云铝股份	55,300	614,936.00	0.35
43	603939	益丰药房	9,600	612,864.00	0.35
44	600536	中国软件	10,490	611,881.70	0.35
45	600418	江淮汽车	46,400	609,232.00	0.35
46	300390	天华超净	10,900	609,092.00	0.35
47	300144	宋城演艺	41,700	608,820.00	0.35
48	300073	当升科技	10,700	603,480.00	0.35
49	600399	抚顺特钢	42,000	601,020.00	0.34
50	600141	兴发集团	20,700	600,300.00	0.34
51	300037	新宙邦	13,800	599,886.00	0.34
52	300699	光威复材	8,300	599,675.00	0.34
53	603517	绝味食品	9,800	598,682.00	0.34
54	600859	王府井	21,100	593,754.00	0.34
55	300285	国瓷材料	21,400	589,998.00	0.34
56	601077	渝农商行	164,500	580,685.00	0.33
57	300568	星源材质	27,200	578,272.00	0.33
58	600873	梅花生物	56,500	575,170.00	0.33
59	002185	华天科技	68,200	565,378.00	0.32
60	603456	九洲药业	13,300	564,319.00	0.32
61	603816	顾家家居	13,160	562,063.60	0.32
62	002138	顺络电子	21,400	560,252.00	0.32
63	600563	法拉电子	3,500	559,580.00	0.32
64	600160	巨化股份	35,900	556,809.00	0.32
65	000630	铜陵有色	177,800	554,736.00	0.32
66	603589	口子窖	9,600	553,632.00	0.32
67	601128	常熟银行	72,800	549,640.00	0.31
68	000783	长江证券	102,800	547,924.00	0.31

69	600153	建发股份	39,900	544,635.00	0.31
70	000629	钒钛股份	114,300	540,639.00	0.31
71	300357	我武生物	9,800	539,980.00	0.31
72	688099	晶晨股份	7,652	539,542.52	0.31
73	002192	融捷股份	5,500	538,450.00	0.31
74	605358	立昂微	12,600	536,760.00	0.31
75	601699	潞安环能	31,800	535,830.00	0.31
76	601162	天风证券	184,200	528,654.00	0.30
77	000683	远兴能源	67,400	528,416.00	0.30
78	002568	百润股份	14,000	523,040.00	0.30
79	688567	孚能科技	19,300	521,679.00	0.30
80	601607	上海医药	29,200	520,636.00	0.30
81	600392	盛和资源	37,177	520,478.00	0.30
82	600161	天坛生物	21,900	519,687.00	0.30
83	603596	伯特利	6,500	518,700.00	0.30
84	000932	华菱钢铁	110,100	517,470.00	0.30
85	600109	国金证券	59,400	516,780.00	0.30
86	000831	中国稀土	15,700	516,216.00	0.30
87	601168	西部矿业	50,600	516,120.00	0.30
88	600521	华海药业	23,600	515,896.00	0.30
89	600499	科达制造	36,200	514,402.00	0.29
90	600027	华电国际	86,700	509,796.00	0.29
91	002223	鱼跃医疗	16,000	509,760.00	0.29
92	600486	扬农化工	4,884	507,447.60	0.29
93	000975	银泰黄金	45,700	504,528.00	0.29
94	002797	第一创业	89,300	502,759.00	0.29
95	603077	和邦生物	164,300	499,472.00	0.29
96	600862	中航高科	22,200	494,838.00	0.28
97	002078	太阳纸业	42,800	493,056.00	0.28
98	000999	华润三九	10,500	491,505.00	0.28
99	688385	复旦微电	7,000	488,670.00	0.28
100	601636	旗滨集团	42,700	486,353.00	0.28
101	002294	信立泰	14,800	486,180.00	0.28
102	601872	招商轮船	86,400	482,976.00	0.28
103	002268	卫士通	15,800	482,374.00	0.28
104	600497	驰宏锌锗	94,776	479,566.56	0.27
105	600143	金发科技	49,400	478,686.00	0.27
106	002532	天山铝业	61,800	477,096.00	0.27
107	002025	航天电器	7,200	477,000.00	0.27
108	002299	圣农发展	19,800	469,062.00	0.27
109	300253	卫宁健康	45,600	468,768.00	0.27
110	601696	中银证券	44,300	468,251.00	0.27
111	600177	雅戈尔	73,796	467,128.68	0.27
112	601990	南京证券	58,800	466,284.00	0.27

113	002624	完美世界	36,400	463,008.00	0.27
114	600705	中航产融	140,900	462,152.00	0.26
115	600803	新奥股份	28,700	462,070.00	0.26
116	002439	启明星辰	17,700	461,616.00	0.26
117	688301	奕瑞科技	1,000	457,880.00	0.26
118	000591	太阳能	62,400	457,392.00	0.26
119	603737	三棵树	4,000	455,320.00	0.26
120	600348	华阳股份	31,900	454,575.00	0.26
121	000998	隆平高科	28,000	449,960.00	0.26
122	000738	航发控制	17,400	446,136.00	0.26
123	600026	中远海能	36,900	444,645.00	0.25
124	600549	厦门钨业	22,630	442,416.50	0.25
125	600258	首旅酒店	17,800	441,440.00	0.25
126	000728	国元证券	69,500	439,935.00	0.25
127	002850	科达利	3,700	439,597.00	0.25
128	600482	中国动力	28,699	438,807.71	0.25
129	000988	华工科技	26,700	438,147.00	0.25
130	000519	中兵红箭	22,200	436,008.00	0.25
131	002273	水晶光电	36,900	435,051.00	0.25
132	002673	西部证券	71,200	433,608.00	0.25
133	300604	长川科技	9,700	432,426.00	0.25
134	601997	贵阳银行	77,700	426,573.00	0.24
135	002507	涪陵榨菜	16,500	425,205.00	0.24
136	300136	信维通信	25,700	424,307.00	0.24
137	300832	新产业	8,400	421,176.00	0.24
138	300363	博腾股份	10,100	412,585.00	0.24
139	002092	中泰化学	55,300	412,538.00	0.24
140	000703	恒逸石化	58,400	410,552.00	0.24
141	002430	杭氧股份	10,400	409,344.00	0.23
142	600325	华发股份	45,000	407,700.00	0.23
143	002030	达安基因	26,120	406,427.20	0.23
144	002739	万达电影	29,000	406,000.00	0.23
145	002557	洽洽食品	8,100	405,000.00	0.23
146	002056	横店东磁	21,600	404,784.00	0.23
147	300308	中际旭创	14,900	402,747.00	0.23
148	600529	山东药玻	14,100	400,440.00	0.23
149	601666	平煤股份	36,900	398,889.00	0.23
150	600704	物产中大	82,756	398,056.36	0.23
151	603233	大参林	10,049	397,940.40	0.23
152	002465	海格通信	49,000	397,880.00	0.23
153	601198	东兴证券	51,500	397,580.00	0.23
154	002156	通富微电	24,100	397,168.00	0.23
155	000729	燕京啤酒	37,388	397,060.56	0.23
156	601016	节能风电	103,890	395,820.90	0.23

157	600655	豫园股份	51,800	394,198.00	0.23
158	600879	航天电子	57,800	393,040.00	0.23
159	300088	长信科技	65,200	389,244.00	0.22
160	688116	天奈科技	5,000	385,700.00	0.22
161	603658	安图生物	6,200	383,470.00	0.22
162	002409	雅克科技	7,600	382,812.00	0.22
163	002353	杰瑞股份	13,700	382,367.00	0.22
164	600415	小商品城	72,900	381,996.00	0.22
165	002080	中材科技	17,800	381,454.00	0.22
166	600546	山煤国际	26,300	381,087.00	0.22
167	000830	鲁西化工	30,600	379,134.00	0.22
168	600038	中直股份	8,100	375,921.00	0.22
169	603444	吉比特	1,200	375,408.00	0.22
170	000960	锡业股份	26,600	375,060.00	0.21
171	000878	云南铜业	31,900	374,825.00	0.21
172	002683	广东宏大	13,900	374,744.00	0.21
173	603267	鸿远电子	3,700	374,292.00	0.21
174	000400	许继电气	18,700	373,439.00	0.21
175	600516	方大炭素	60,737	371,710.44	0.21
176	000623	吉林敖东	24,700	370,253.00	0.21
177	600170	上海建工	141,900	368,940.00	0.21
178	603160	汇顶科技	7,300	366,460.00	0.21
179	002444	巨星科技	19,200	364,416.00	0.21
180	600637	东方明珠	54,500	362,425.00	0.21
181	300418	昆仑万维	25,100	361,691.00	0.21
182	002531	天顺风能	23,900	361,607.00	0.21
183	300017	网宿科技	64,800	361,584.00	0.21
184	601577	长沙银行	53,400	360,984.00	0.21
185	002372	伟星新材	16,900	360,646.00	0.21
186	600739	辽宁成大	28,500	358,815.00	0.21
187	002326	永太科技	16,400	358,012.00	0.21
188	600166	福田汽车	127,400	357,994.00	0.21
189	600642	申能股份	65,200	357,948.00	0.21
190	300373	扬杰科技	6,800	357,680.00	0.20
191	688002	睿创微纳	9,606	357,247.14	0.20
192	600699	均胜电子	25,400	356,870.00	0.20
193	601456	国联证券	31,700	356,625.00	0.20
194	603712	七一二	10,200	356,184.00	0.20
195	002203	海亮股份	31,300	353,690.00	0.20
196	000970	中科三环	25,845	352,525.80	0.20
197	002508	老板电器	12,600	349,776.00	0.20
198	000155	川能动力	19,600	349,664.00	0.20
199	600673	东阳光	40,000	347,600.00	0.20
200	600372	中航电子	21,724	346,932.28	0.20

201	689009	九号公司	11,372	346,732.28	0.20
202	600380	健康元	30,700	346,603.00	0.20
203	603127	昭衍新药	5,932	346,488.12	0.20
204	000039	中集集团	49,000	344,960.00	0.20
205	600909	华安证券	74,900	343,791.00	0.20
206	603026	胜华新材	3,700	341,510.00	0.20
207	300676	华大基因	6,600	341,154.00	0.20
208	600867	通化东宝	37,000	339,660.00	0.19
209	600118	中国卫星	15,700	338,335.00	0.19
210	000739	普洛药业	15,700	338,178.00	0.19
211	600056	中国医药	19,620	338,052.60	0.19
212	600985	淮北矿业	26,400	337,920.00	0.19
213	002065	东华软件	59,600	337,336.00	0.19
214	000750	国海证券	101,300	337,329.00	0.19
215	300058	蓝色光标	66,200	334,310.00	0.19
216	300244	迪安诊断	13,300	334,229.00	0.19
217	600369	西南证券	88,600	332,250.00	0.19
218	600008	首创环保	117,000	331,110.00	0.19
219	688009	中国通号	68,835	329,719.65	0.19
220	002152	广电运通	33,000	328,020.00	0.19
221	300558	贝达药业	6,600	325,182.00	0.19
222	300474	景嘉微	5,950	324,691.50	0.19
223	002831	裕同科技	9,800	324,086.00	0.19
224	600998	九州通	24,826	323,731.04	0.19
225	601880	辽港股份	199,800	323,676.00	0.19
226	000027	深圳能源	50,575	321,657.00	0.18
227	600435	北方导航	27,725	321,610.00	0.18
228	000513	丽珠集团	9,900	321,552.00	0.18
229	002936	郑州银行	136,590	320,986.50	0.18
230	000547	航天发展	34,100	320,199.00	0.18
231	300866	安克创新	5,400	320,058.00	0.18
232	000636	风华高科	21,500	318,845.00	0.18
233	300070	碧水源	67,400	318,802.00	0.18
234	002408	齐翔腾达	45,260	318,630.40	0.18
235	002131	利欧股份	179,500	317,715.00	0.18
236	300026	红日药业	55,800	316,944.00	0.18
237	002506	协鑫集成	108,800	316,608.00	0.18
238	603883	老百姓	7,820	316,475.40	0.18
239	002926	华西证券	41,900	315,507.00	0.18
240	002212	天融信	31,420	313,885.80	0.18
241	600378	昊华科技	7,300	313,243.00	0.18
242	300383	光环新网	38,200	311,712.00	0.18
243	002183	怡亚通	48,300	310,569.00	0.18
244	300682	朗新科技	14,100	309,918.00	0.18

245	603858	步长制药	14,700	308,847.00	0.18
246	600820	隧道股份	58,500	308,295.00	0.18
247	002572	索菲亚	16,900	306,904.00	0.18
248	600271	航天信息	29,400	306,054.00	0.18
249	002195	二三四五	152,100	305,721.00	0.18
250	300296	利亚德	53,800	304,508.00	0.17
251	600580	卧龙电驱	24,400	304,024.00	0.17
252	000887	中鼎股份	21,000	303,870.00	0.17
253	002250	联化科技	19,600	303,800.00	0.17
254	600390	五矿资本	59,800	303,784.00	0.17
255	002500	山西证券	57,200	303,160.00	0.17
256	600848	上海临港	25,400	302,768.00	0.17
257	603893	瑞芯微	4,400	302,764.00	0.17
258	600863	内蒙华电	86,700	302,583.00	0.17
259	603156	养元饮品	13,500	300,645.00	0.17
260	600021	上海电力	29,900	299,299.00	0.17
261	688779	长远锂科	20,500	299,095.00	0.17
262	002958	青农商行	103,300	298,537.00	0.17
263	601958	金铂股份	25,700	296,835.00	0.17
264	688538	和辉光电	110,700	296,676.00	0.17
265	300024	机器人	32,920	295,621.60	0.17
266	002368	太极股份	10,500	295,365.00	0.17
267	300001	特锐德	19,400	295,074.00	0.17
268	688256	寒武纪	5,400	294,624.00	0.17
269	600755	厦门国贸	41,000	292,740.00	0.17
270	002244	滨江集团	33,100	292,273.00	0.17
271	300009	安科生物	31,100	291,096.00	0.17
272	600208	新湖中宝	114,300	290,322.00	0.17
273	002155	湖南黄金	22,400	290,080.00	0.17
274	600315	上海家化	9,100	289,835.00	0.17
275	300776	帝尔激光	2,300	289,800.00	0.17
276	300850	新强联	5,400	287,712.00	0.16
277	002511	中顺洁柔	20,900	287,166.00	0.16
277	600316	洪都航空	11,400	287,166.00	0.16
279	688521	芯原股份	6,500	286,455.00	0.16
280	000997	新大陆	22,000	286,220.00	0.16
281	603885	吉祥航空	17,640	285,415.20	0.16
282	000060	中金岭南	69,500	284,950.00	0.16
283	601231	环旭电子	17,500	284,025.00	0.16
284	600060	海信视像	20,900	282,986.00	0.16
285	000050	深天马 A	32,600	282,316.00	0.16
286	601992	金隅集团	110,800	281,432.00	0.16
287	601005	重庆钢铁	178,100	281,398.00	0.16
288	603927	中科软	9,500	281,295.00	0.16

289	600511	国药股份	9,982	278,497.80	0.16
290	688188	柏楚电子	1,280	277,862.40	0.16
291	601717	郑煤机	24,400	272,304.00	0.16
292	688185	康希诺	1,861	271,743.22	0.16
293	600528	中铁工业	35,500	270,865.00	0.16
294	300251	光线传媒	31,200	270,192.00	0.15
295	600801	华新水泥	18,100	268,242.00	0.15
296	600201	生物股份	29,700	267,597.00	0.15
297	600566	济川药业	9,800	266,756.00	0.15
298	000021	深科技	24,900	266,181.00	0.15
299	002939	长城证券	32,100	265,788.00	0.15
300	300168	万达信息	31,500	265,545.00	0.15
301	600066	宇通客车	35,300	265,103.00	0.15
302	600171	上海贝岭	15,200	264,936.00	0.15
303	000825	太钢不锈	61,000	263,520.00	0.15
304	002373	千方科技	29,400	262,248.00	0.15
305	603218	日月股份	12,900	261,870.00	0.15
306	600908	无锡银行	49,600	261,392.00	0.15
307	600906	财达证券	34,500	261,165.00	0.15
308	600598	北大荒	18,900	260,064.00	0.15
309	600839	四川长虹	98,100	258,984.00	0.15
310	300677	英科医疗	12,300	258,669.00	0.15
311	600827	百联股份	21,330	258,519.60	0.15
312	600282	南钢股份	81,700	257,355.00	0.15
313	600535	天士力	23,900	257,164.00	0.15
314	600663	陆家嘴	26,300	256,162.00	0.15
315	600970	中材国际	30,065	256,153.80	0.15
316	601866	中远海发	105,300	254,826.00	0.15
317	601665	齐鲁银行	60,900	253,953.00	0.15
318	601778	晶科科技	46,100	253,550.00	0.15
319	002128	电投能源	20,400	251,736.00	0.14
320	603568	伟明环保	13,559	251,248.27	0.14
321	601179	中国西电	54,500	251,245.00	0.14
322	002127	南极电商	52,200	251,082.00	0.14
323	300861	美畅股份	5,100	250,716.00	0.14
324	002153	石基信息	16,700	250,333.00	0.14
325	600498	烽火通信	18,900	248,346.00	0.14
326	000930	中粮科技	29,700	248,292.00	0.14
327	000709	河钢股份	109,800	248,148.00	0.14
328	002595	豪迈科技	10,600	245,390.00	0.14
329	300182	捷成股份	54,800	244,956.00	0.14
330	603000	人民网	14,500	244,615.00	0.14
331	000012	南玻 A	36,400	244,244.00	0.14
332	600398	海澜之家	45,900	243,270.00	0.14

333	300888	稳健医疗	3,400	243,100.00	0.14
334	600500	中化国际	36,670	242,388.70	0.14
335	002701	奥瑞金	47,900	241,895.00	0.14
336	000987	越秀资本	39,955	239,330.45	0.14
337	002019	亿帆医药	19,500	238,875.00	0.14
338	002124	天邦食品	39,060	238,656.60	0.14
339	002985	北摩高科	5,270	237,677.00	0.14
340	002396	星网锐捷	12,400	237,584.00	0.14
341	600959	江苏有线	79,700	236,709.00	0.14
342	000581	威孚高科	13,300	235,809.00	0.14
343	600895	张江高科	20,607	233,683.38	0.13
344	603707	健友股份	12,923	233,130.92	0.13
345	000401	冀东水泥	28,300	232,909.00	0.13
346	000598	兴蓉环境	47,600	232,764.00	0.13
347	000778	新兴铸管	63,600	232,140.00	0.13
348	300618	寒锐钴业	5,791	231,929.55	0.13
349	300115	长盈精密	22,400	231,392.00	0.13
350	600582	天地科技	43,952	228,550.40	0.13
351	002670	国盛金控	30,800	228,228.00	0.13
352	688690	纳微科技	4,400	227,788.00	0.13
353	600718	东软集团	22,800	226,860.00	0.13
354	600297	广汇汽车	107,800	226,380.00	0.13
355	002249	大洋电机	44,200	226,304.00	0.13
356	300482	万孚生物	7,100	226,277.00	0.13
357	002690	美亚光电	9,400	224,660.00	0.13
358	688208	道通科技	7,095	223,847.25	0.13
359	600507	方大特钢	37,100	223,342.00	0.13
360	002266	浙富控股	57,000	222,870.00	0.13
361	600329	达仁堂	7,600	221,160.00	0.13
362	603225	新凤鸣	20,300	220,864.00	0.13
363	600517	国网英大	45,600	220,704.00	0.13
364	000883	湖北能源	52,400	220,080.00	0.13
365	603866	桃李面包	14,220	218,988.00	0.13
366	002505	鹏都农牧	84,700	218,526.00	0.13
367	600409	三友化工	32,956	217,839.16	0.12
368	000656	金科股份	113,500	216,785.00	0.12
369	300212	易华录	10,600	216,346.00	0.12
370	601000	唐山港	78,700	215,638.00	0.12
371	600022	山东钢铁	145,400	215,192.00	0.12
372	002002	鸿达兴业	66,400	215,136.00	0.12
373	600871	石化油服	108,500	214,830.00	0.12
374	000089	深圳机场	27,300	214,578.00	0.12
375	601106	中国一重	72,900	213,597.00	0.12
376	600259	广晟有色	5,300	213,060.00	0.12

377	600567	山鹰国际	85,900	213,032.00	0.12
378	600064	南京高科	32,180	212,709.80	0.12
379	000785	居然之家	52,000	212,680.00	0.12
380	300376	易事特	30,800	210,364.00	0.12
381	002429	兆驰股份	60,200	210,098.00	0.12
382	002468	申通快递	20,300	209,699.00	0.12
383	600216	浙江医药	17,902	209,274.38	0.12
384	600782	新钢股份	50,800	207,772.00	0.12
385	002081	金螳螂	42,400	205,640.00	0.12
386	601333	广深铁路	90,100	204,527.00	0.12
387	601718	际华集团	70,000	203,700.00	0.12
388	600667	太极实业	39,200	202,272.00	0.12
389	601187	厦门银行	35,100	201,123.00	0.12
390	601118	海南橡胶	45,500	199,290.00	0.11
391	002010	传化智联	37,200	198,648.00	0.11
392	600062	华润双鹤	11,100	198,579.00	0.11
393	002191	劲嘉股份	27,400	198,102.00	0.11
394	600737	中粮糖业	28,478	197,637.32	0.11
395	600728	佳都科技	37,400	197,472.00	0.11
396	300463	迈克生物	11,400	197,220.00	0.11
397	600597	光明乳业	18,299	196,897.24	0.11
398	000540	中天金融	130,300	196,753.00	0.11
399	000537	广宇发展	14,839	196,319.97	0.11
400	688029	南微医学	2,380	195,469.40	0.11
401	600155	华创阳安	30,035	195,227.50	0.11
402	600376	首开股份	34,300	195,167.00	0.11
403	601156	东航物流	12,600	192,276.00	0.11
404	002221	东华能源	25,100	191,513.00	0.11
405	600131	国网信通	12,800	191,488.00	0.11
406	002745	木林森	23,600	191,396.00	0.11
407	601098	中南传媒	19,100	190,618.00	0.11
408	300072	海新能科	43,700	190,532.00	0.11
409	002416	爱施德	19,800	187,704.00	0.11
410	600967	内蒙一机	22,700	187,502.00	0.11
411	600126	杭钢股份	44,839	185,185.07	0.11
412	000156	华数传媒	24,600	184,254.00	0.11
413	601991	大唐发电	65,900	183,861.00	0.11
414	603379	三美股份	6,460	183,851.60	0.11
415	603228	景旺电子	9,000	182,160.00	0.10
416	002048	宁波华翔	13,000	180,700.00	0.10
417	600808	马钢股份	64,200	180,402.00	0.10
418	601568	北元集团	31,640	179,398.80	0.10
419	000937	冀中能源	28,200	179,352.00	0.10
420	002423	中粮资本	24,500	175,420.00	0.10

421	002281	光迅科技	11,100	174,492.00	0.10
422	600901	江苏租赁	31,700	173,716.00	0.10
423	300630	普利制药	7,000	172,620.00	0.10
424	600095	湘财股份	22,800	172,368.00	0.10
425	600373	中文传媒	18,000	172,260.00	0.10
426	001914	招商积余	11,200	172,256.00	0.10
427	003035	南网能源	30,200	171,234.00	0.10
428	000559	万向钱潮	35,100	170,937.00	0.10
429	301029	怡合达	2,600	170,924.00	0.10
430	688289	圣湘生物	7,784	170,858.80	0.10
431	603056	德邦股份	8,200	170,806.00	0.10
432	000898	鞍钢股份	63,700	170,079.00	0.10
433	002434	万里扬	20,900	168,245.00	0.10
434	603317	天味食品	6,100	167,628.00	0.10
435	000402	金融街	31,700	166,425.00	0.10
436	002867	周大生	11,600	162,748.00	0.09
437	600556	天下秀	24,000	161,760.00	0.09
438	601598	中国外运	41,900	160,896.00	0.09
439	601608	中信重工	46,100	160,889.00	0.09
440	601928	凤凰传媒	20,300	160,776.00	0.09
441	601611	中国核建	21,100	160,360.00	0.09
442	000563	陕国投 A	52,700	159,681.00	0.09
443	600195	中牧股份	13,600	158,032.00	0.09
444	600707	彩虹股份	38,100	157,734.00	0.09
445	002948	青岛银行	46,890	157,550.40	0.09
446	300257	开山股份	10,500	157,500.00	0.09
447	000959	首钢股份	41,600	156,832.00	0.09
448	600968	海油发展	54,000	155,520.00	0.09
449	001203	大中矿业	12,000	155,160.00	0.09
450	600167	联美控股	24,300	153,576.00	0.09
451	000967	盈峰环境	33,800	153,452.00	0.09
452	002110	三钢闽光	32,600	153,220.00	0.09
453	603650	彤程新材	4,800	147,984.00	0.08
454	002705	新宝股份	8,800	146,520.00	0.08
455	000415	渤海租赁	65,700	145,197.00	0.08
456	000990	诚志股份	16,200	142,560.00	0.08
457	688006	杭可科技	3,241	141,858.57	0.08
458	688819	天能股份	3,800	139,612.00	0.08
459	600307	酒钢宏兴	83,200	137,280.00	0.08
460	002925	盈趣科技	8,300	137,116.00	0.08
461	300869	康泰医学	4,200	136,794.00	0.08
462	601828	美凯龙	28,800	135,072.00	0.08
463	002242	九阳股份	8,184	134,872.32	0.08
464	603638	艾迪精密	8,948	133,504.16	0.08

465	600339	中油工程	44,500	132,610.00	0.08
466	600764	中国海防	5,630	129,264.80	0.07
467	000031	大悦城	34,200	128,592.00	0.07
468	002399	海普瑞	9,900	127,215.00	0.07
469	600623	华谊集团	20,100	127,032.00	0.07
470	002653	海思科	5,700	126,825.00	0.07
471	002146	荣盛发展	57,700	125,209.00	0.07
472	600928	西安银行	35,500	124,960.00	0.07
473	688088	虹软科技	5,467	123,062.17	0.07
474	601969	海南矿业	16,300	120,783.00	0.07
475	600006	东风汽车	21,300	118,854.00	0.07
476	600648	外高桥	9,900	118,305.00	0.07
477	603719	良品铺子	3,200	117,984.00	0.07
478	600787	中储股份	23,200	115,304.00	0.07
479	002563	森马服饰	21,500	112,660.00	0.06
480	000961	中南建设	50,800	111,252.00	0.06
481	000869	张裕 A	3,600	108,864.00	0.06
482	600377	宁沪高速	13,200	108,504.00	0.06
483	601869	长飞光纤	3,300	107,679.00	0.06
484	601298	青岛港	18,600	104,346.00	0.06
485	000553	安道麦 A	11,500	104,075.00	0.06
486	000062	深圳华强	8,400	102,564.00	0.06
487	600350	山东高速	17,900	101,851.00	0.06
488	601139	深圳燃气	15,300	100,062.00	0.06
489	002945	华林证券	7,200	94,896.00	0.05
490	601228	广州港	28,100	88,515.00	0.05
491	600299	安迪苏	10,700	88,382.00	0.05
492	001872	招商港口	6,116	87,825.76	0.05
493	603868	飞科电器	1,300	87,529.00	0.05
494	001965	招商公路	11,100	86,247.00	0.05
495	603355	莱克电气	3,060	85,802.40	0.05
496	601158	重庆水务	15,300	78,489.00	0.04
497	600956	新天绿能	8,100	78,084.00	0.04
498	688035	德邦科技	1,594	77,819.08	0.04
499	300741	华宝股份	3,300	77,649.00	0.04
500	688141	杰华特	1,740	76,368.60	0.04
501	603786	科博达	1,100	72,413.00	0.04
502	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
503	600927	永安期货	4,200	67,704.00	0.04
504	600917	重庆燃气	8,400	66,864.00	0.04
505	600032	浙江新能	5,500	63,195.00	0.04
506	001227	兰州银行	16,600	62,582.00	0.04
507	688244	永信至诚	1,248	62,574.72	0.04
508	688772	珠海冠宇	3,000	55,920.00	0.03

509	688503	聚和材料	409	55,783.51	0.03
510	002901	大博医疗	1,600	54,448.00	0.03
511	301239	普瑞眼科	216	15,050.88	0.01
512	301269	华大九天	131	11,520.14	0.01
513	301175	中科环保	1,853	11,136.53	0.01
514	301095	广立微	122	10,551.78	0.01
515	301301	川宁生物	1,184	8,915.52	0.01
516	301267	华夏眼科	133	8,804.60	0.01
517	301297	富乐德	671	8,716.29	0.00
518	301327	华宝新能	49	8,671.53	0.00
519	301367	怡和嘉业	47	8,261.66	0.00
520	301391	卡莱特	75	6,072.75	0.00
521	301363	美好医疗	154	5,828.90	0.00
522	301277	新天地	220	5,671.60	0.00
523	301377	鼎泰高科	318	5,606.34	0.00
524	301379	天山电子	208	5,123.04	0.00
525	301313	凡拓数创	171	4,982.94	0.00
526	301273	瑞晨环保	129	4,874.91	0.00
527	301316	慧博云通	303	4,338.96	0.00
528	301328	维峰电子	56	4,309.76	0.00
529	301270	汉仪股份	147	4,170.39	0.00
530	301306	西测测试	95	4,017.55	0.00
531	301265	华新环保	324	3,693.60	0.00
532	301171	易点天下	207	3,668.04	0.00
533	301197	工大科雅	182	3,654.56	0.00
534	301319	唯特偶	68	3,622.36	0.00
535	000983	山西焦煤	300	3,495.00	0.00
536	301282	金禄电子	117	2,954.25	0.00
537	301318	维海德	69	2,880.06	0.00
538	301349	信德新材	27	2,795.04	0.00
539	002085	万丰奥威	400	2,380.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601117	中国化学	100,600	798,764.00	0.46
2	600884	杉杉股份	35,900	653,380.00	0.37
3	600803	新奥股份	28,700	462,070.00	0.26
4	600908	无锡银行	49,600	261,392.00	0.15
5	001965	招商公路	11,100	86,247.00	0.05
6	688035	德邦科技	1,594	77,819.08	0.04

7	688141	杰华特	1,740	76,368.60	0.04
8	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
9	688244	永信至诚	1,248	62,574.72	0.04
10	688503	聚和材料	409	55,783.51	0.03
11	301239	普瑞眼科	216	15,050.88	0.01
12	301269	华大九天	131	11,520.14	0.01
13	301175	中科环保	1,853	11,136.53	0.01
14	301095	广立微	122	10,551.78	0.01
15	301301	川宁生物	1,184	8,915.52	0.01
16	301267	华夏眼科	133	8,804.60	0.01
17	301297	富乐德	671	8,716.29	0.00
18	301327	华宝新能	49	8,671.53	0.00
19	301367	怡和嘉业	47	8,261.66	0.00
20	301391	卡莱特	75	6,072.75	0.00
21	301363	美好医疗	154	5,828.90	0.00
22	301277	新天地	220	5,671.60	0.00
23	301377	鼎泰高科	318	5,606.34	0.00
24	301379	天山电子	208	5,123.04	0.00
25	301313	凡拓数创	171	4,982.94	0.00
26	301273	瑞晨环保	129	4,874.91	0.00
27	301316	慧博云通	303	4,338.96	0.00
28	301328	维峰电子	56	4,309.76	0.00
29	301270	汉仪股份	147	4,170.39	0.00
30	301306	西测测试	95	4,017.55	0.00
31	301265	华新环保	324	3,693.60	0.00
32	301171	易点天下	207	3,668.04	0.00
33	301197	工大科雅	182	3,654.56	0.00
34	301319	唯特偶	68	3,622.36	0.00
35	000983	山西焦煤	300	3,495.00	0.00
36	301282	金禄电子	117	2,954.25	0.00
37	301318	维海德	69	2,880.06	0.00
38	301349	信德新材	27	2,795.04	0.00
39	002085	万丰奥威	400	2,380.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	000009	中国宝安	5,349,214.00	1.99
2	002180	纳思达	5,079,432.00	1.89

3	002384	东山精密	4,934,412.69	1.84
4	002340	格林美	4,732,643.00	1.76
5	300285	国瓷材料	4,432,403.00	1.65
6	000733	振华科技	4,410,825.00	1.64
7	002385	大北农	4,401,661.39	1.64
8	002268	电科网安	4,255,593.00	1.58
9	002028	思源电气	4,241,243.67	1.58
10	000983	山西焦煤	4,169,284.11	1.55
11	300763	锦浪科技	4,024,506.00	1.50
12	000630	铜陵有色	3,970,176.00	1.48
13	002603	以岭药业	3,864,452.56	1.44
14	300073	当升科技	3,831,594.00	1.43
15	002240	盛新锂能	3,787,906.00	1.41
16	300012	华测检测	3,782,343.00	1.41
17	300724	捷佳伟创	3,739,919.00	1.39
18	000519	中兵红箭	3,662,420.80	1.36
19	002353	杰瑞股份	3,661,960.00	1.36
20	002497	雅化集团	3,646,302.00	1.36

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值 比例（%）
1	000733	振华科技	6,393,885.02	2.38
2	002180	纳思达	6,385,917.00	2.38
3	300763	锦浪科技	6,073,099.06	2.26
4	000009	中国宝安	5,984,125.97	2.23
5	002384	东山精密	5,230,905.14	1.95
6	002340	格林美	5,130,947.00	1.91
7	000983	山西焦煤	5,020,718.11	1.87
8	300285	国瓷材料	4,843,908.00	1.80
9	002385	大北农	4,716,109.00	1.75
10	002268	电科网安	4,679,126.22	1.74
11	002028	思源电气	4,592,747.91	1.71
12	000630	铜陵有色	4,310,240.00	1.60
13	002603	以岭药业	4,164,239.38	1.55
14	000723	美锦能源	4,094,850.00	1.52
15	002353	杰瑞股份	4,090,353.49	1.52
16	000519	中兵红箭	3,884,260.00	1.44
17	000988	华工科技	3,837,572.00	1.43

18	000932	华菱钢铁	3,831,035.00	1.43
19	002185	华天科技	3,815,042.00	1.42
20	300724	捷佳伟创	3,760,212.99	1.40

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。

#### 8.4.3 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	656,446,422.79
卖出股票的收入（成交）总额	585,487,762.93

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

#### 8.5 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）	35,000.46	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,000.46	0.02

#### 8.6 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	118030	睿创转债	350	35,000.46	0.02

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	233,521.48
2	应收清算款	346,048.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	579,570.16

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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。

##### 8.12.5.2 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中证 500ETF 联接	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
2,807	72,212.33	115,557,78 3.00	57.01%	71,763,500. 00	35.40%	15,378,717 .00	7.59%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券有限责任公司	32,266,292.00	15.92%
2	招商证券股份有限公司	17,030,619.00	8.40%
3	方正证券股份有限公司	16,248,314.00	8.02%
4	华泰证券股份有限公司	15,000,096.00	7.40%
5	广发证券股份有限公司	12,833,512.00	6.33%

6	申万宏源证券有限公司	11,478,335.00	5.66%
7	中信证券股份有限公司	9,652,115.00	4.76%
8	梁仕璋	2,624,500.00	1.29%
9	王少孟	2,100,000.00	1.04%
10	卢世文	1,000,000.00	0.49%
-	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	15,378,717.00	7.59%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021 年 8 月 18 日)基金份额总额	727,700,000.00
本报告期期初基金份额总额	256,700,000.00
本报告期基金总申购份额	1,119,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,173,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	202,700,000.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 8 月 16 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十六次会议审议通过，张瑞兵先生不再担任本基金管理人副总经理。

本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为李开贞先生，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 60,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	987,548,546.45	80.07%	116,126.43	39.65%	-
长江证券	2	148,781,588.41	12.06%	106,836.64	36.48%	-
东方证券	2	96,950,299.55	7.86%	69,898.67	23.87%	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	226,142.70	49.31%	-	-	-	-
东方证券	232,443.17	50.69%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2022-06-18
2	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》	2022-08-16
3	国泰基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2022-12-28

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2022 年 01 月 19 日至 2022 年 01 月 20 日, 2022 年 01 月 25 日至 2022 年 02 月 24 日, 2022 年 03 月 01 日至 2022 年 03 月 01 日	36,605,000.00	140,196,884.00	161,801,788.00	15,000,096.00	7.40%
	2	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 01 月 18 日	69,000,000.00	2,976,100.00	71,976,100.00	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

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

基金托管人住所或办公场所。

### 13.3 查阅方式

可咨询本基金管理人; 部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

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

客户投诉电话: (021) 31089000

公司网址: <http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日