

# 国泰中证 500 指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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>	<b>6</b>
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>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## 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	51,133,833.87 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	47,904,333.78 份	3,229,500.09 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、存托凭证投资策略； 3、债券投资策略； 4、中小企业私募债投资策略； 5、资产支持证券投资策略； 6、权证投资策略； 7、股指期货投资策略； 8、股票期权投资策略； 9、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	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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,264,039.99	119,517.34
本期利润	2,386,156.50	189,134.60
加权平均基金份额本期利润	0.0499	0.0516
本期加权平均净值利润率	4.64%	4.86%
本期基金份额净值增长率	4.95%	4.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	2,684,250.33	129,886.40
期末可供分配基金份额利润	0.0560	0.0402
期末基金资产净值	50,928,728.82	3,387,649.50

期末基金份额净值	1.0631	1.0490
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	12.01%	10.87%

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

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	1.65%	0.79%	-0.77%	0.89%	2.42%	-0.10%
过去三个月	-2.94%	0.72%	-5.10%	0.78%	2.16%	-0.06%
过去六个月	4.95%	0.70%	2.20%	0.75%	2.75%	-0.05%
过去一年	-6.83%	0.88%	-6.65%	0.91%	-0.18%	-0.03%
过去三年	-7.78%	1.16%	2.48%	1.13%	-10.26%	0.03%
自基金合同生效起至今	12.01%	1.18%	17.03%	1.20%	-5.02%	-0.02%

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	1.66%	0.79%	-0.77%	0.89%	2.43%	-0.10%
过去三个月	-2.93%	0.72%	-5.10%	0.78%	2.17%	-0.06%
过去六个月	4.95%	0.70%	2.20%	0.75%	2.75%	-0.05%
过去一年	-6.83%	0.88%	-6.65%	0.91%	-0.18%	-0.03%
过去三年	-7.81%	1.16%	2.48%	1.13%	-10.29%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.87%	1.18%	17.03%	1.20%	-6.16%	-0.02%

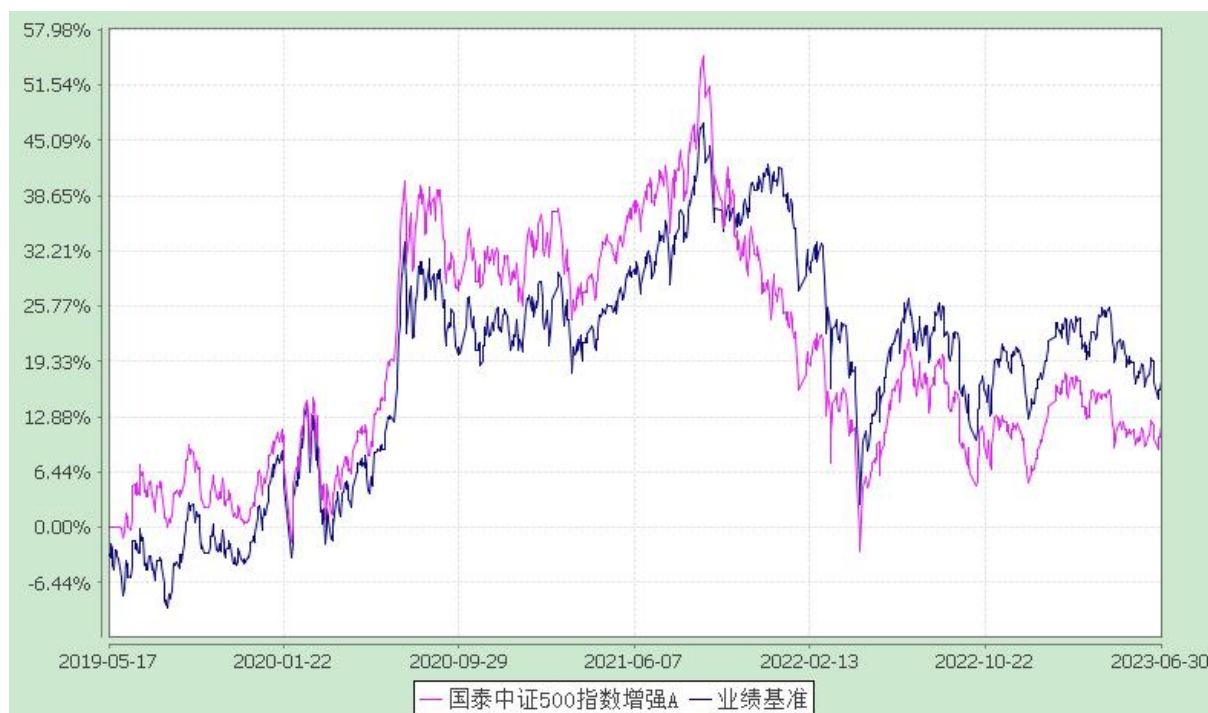
#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

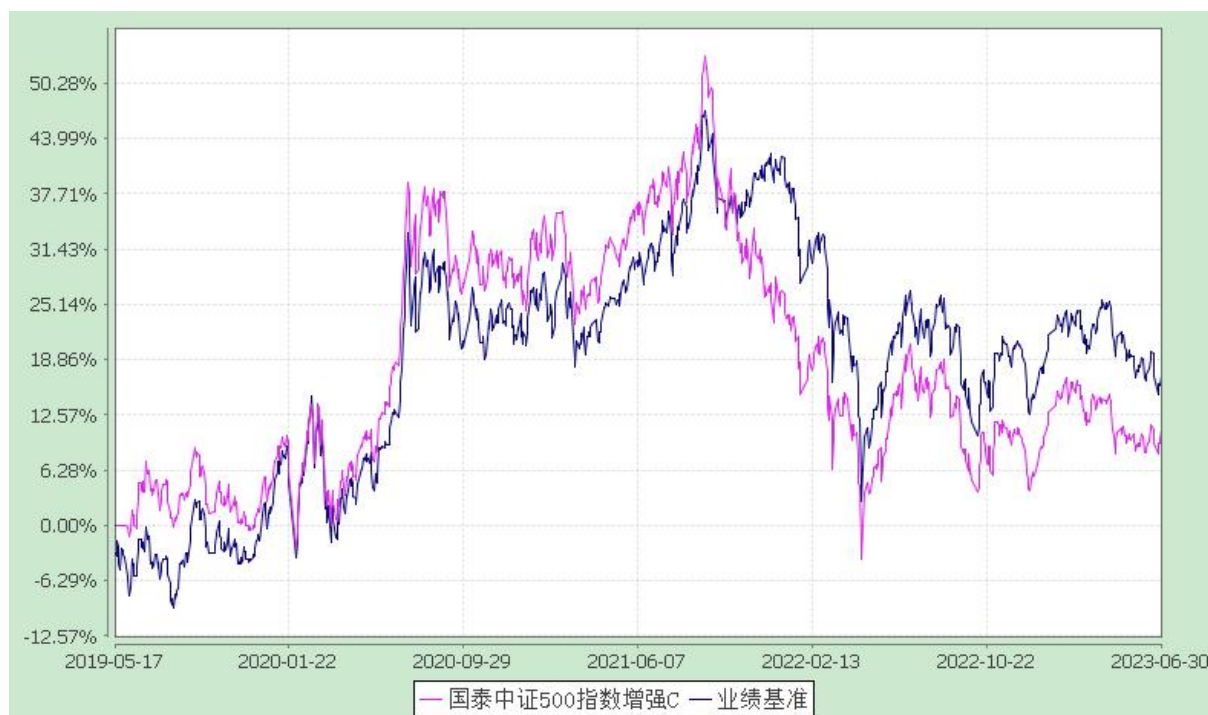
(2019 年 5 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日)

国泰中证 500 指数增强 A



注：本基金合同生效日为 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。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		
吴中昊	国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、国泰沪深 300 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、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略	2022-01-28	-	8 年	硕士研究生。曾任职于 Arrowstreet Capital（美国）。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投

	ETF、国泰中证 1000 增强策略 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证煤炭 ETF、国泰创业板指数 (LOF)、国泰中证香港内地国有企业 ETF (QDII) 的基金经理				资基金的基金经理，2023 年 2 月起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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、组合间同向交易记录配对。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

A 股上半年整体波动较大。一季度受到大语言模型 ChatGPT 及其突破性的用户交互体验的影响，计算机，通信，传媒等 TMT 板块受到了投资人的追捧，成交活跃，带动 A 股震荡抬升。二季度经济复苏不及预期，5 月的出口数据走弱，出口金额同比下降 7.5%，CPI 和 PPI 同比继续走低。投资人风险偏好下降，投资由一季度的概念导向转向业绩导向，使得市场整体呈现快速轮转的效应。

### 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 4.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 4.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如何提振消费仍然是经济复苏的核心问题。在货币政策效果不及预期的情况下，经济的恢复期可能要持续的更长，这很大程度上影响了投资人的风险偏好。下半年是否会出现财政刺激，财政、

货币政策如何形成合力，接下来的政策“组合拳”可能是推动 A 股走势的核心。除此之外，AI 作为跨时代的产物，仍具有很强的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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《中华人民共和国证券投资基金法》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。

### 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“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,640,397.20	2,324,698.73
结算备付金		1,247,877.66	915,787.45
存出保证金		13,302.30	9,239.18
交易性金融资产	6.4.7.2	49,709,454.00	48,360,097.72
其中：股票投资		49,709,454.00	47,549,825.06
基金投资		-	-
债券投资		-	810,272.66
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	701,328.67
应收股利		-	-
应收申购款		9,411.10	4,636.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		54,620,442.26	52,315,788.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		5,331.19	946.59
应付管理人报酬		44,174.98	45,073.05
应付托管费		4,417.50	4,507.31
应付销售服务费		28.10	30.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	250,112.17	254,733.64
负债合计		304,063.94	305,290.97
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	51,133,833.87	51,390,690.48
未分配利润	6.4.7.8	3,182,544.45	619,807.25
净资产合计		54,316,378.32	52,010,497.73
负债和净资产总计		54,620,442.26	52,315,788.70

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 51,133,833.87 份，其中 A 类基金份额净值 1.0631 元，份额总额 47,904,333.78 份；C 类基金份额净值 1.0490 元，份额总额 3,229,500.09 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,041,403.52	-1,191,599.81
1.利息收入		26,935.47	29,533.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,935.47	29,533.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,820,238.23	-5,431,600.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,311,787.77	-5,595,000.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	29,811.62	21,553.95
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.12	-	-527,203.86
股利收益	6.4.7.13	478,638.84	669,050.34
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,191,733.77	4,197,948.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,496.05	12,518.77
<b>减：二、营业总支出</b>		466,112.42	403,078.38
1. 管理人报酬		274,047.89	234,770.70
2. 托管费		27,404.78	23,477.09
3. 销售服务费		192.91	199.61
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.07	-
8. 其他费用	6.4.7.16	164,466.77	144,630.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,575,291.10</b>	<b>-1,594,678.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,575,291.10</b>	<b>-1,594,678.19</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,575,291.10	-1,594,678.19

### 6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	51,390,690.48	619,807.25	52,010,497.73
二、本期期初净资产（基金净值）	51,390,690.48	619,807.25	52,010,497.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-256,856.61	2,562,737.20	2,305,880.59

(一)、综合收益总额	-	2,575,291.10	2,575,291.10
(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)	-256,856.61	-12,553.90	-269,410.51
其中: 1.基金申购款	3,051,338.29	237,076.38	3,288,414.67
2.基金赎回款	-3,308,194.90	-249,630.28	-3,557,825.18
(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)	51,133,833.87	3,182,544.45	54,316,378.32
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	40,423,317.26	8,579,159.46	49,002,476.72
二、本期期初净资产(基金净值)	40,423,317.26	8,579,159.46	49,002,476.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,124,933.31	-1,499,071.80	8,625,861.51
(一)、综合收益总额	-	-1,594,678.19	-1,594,678.19
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	10,124,933.31	95,606.39	10,220,539.70
其中: 1.基金申购款	19,143,582.73	1,216,512.31	20,360,095.04
2.基金赎回款	-9,018,649.42	-1,120,905.92	-10,139,555.34
(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）	50,548,250.57	7,080,087.66	57,628,338.23

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》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、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证)、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 2023 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,640,397.20
等于：本金	3,639,523.01

加：应计利息	874.19
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	3,640,397.20

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	50,899,388.80	-	49,709,454.00	-1,189,934.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	50,899,388.80	-	49,709,454.00	-1,189,934.80

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	135,645.40
其中：交易所市场	135,645.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
应付指数使用费	50,000.00
合计	250,112.17

#### 6.4.7.7 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	47,773,962.88	47,773,962.88
本期申购	911,992.50	911,992.50
本期赎回（以“-”号填列）	-781,621.60	-781,621.60
本期末	47,904,333.78	47,904,333.78

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额	账面金额
上年度末	3,616,727.60	3,616,727.60
本期申购	2,139,345.79	2,139,345.79
本期赎回（以“-”号填列）	-2,526,573.30	-2,526,573.30
本期末	3,229,500.09	3,229,500.09

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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	1,407,078.87	-785,563.09	621,515.78
本期利润	1,264,039.99	1,122,116.51	2,386,156.50
本期基金份额交易产生的变动数	13,131.47	3,591.29	16,722.76
其中：基金申购款	64,842.07	7,742.55	72,584.62
基金赎回款	-51,710.60	-4,151.26	-55,861.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,684,250.33	340,144.71	3,024,395.04

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	50,655.29	-52,363.82	-1,708.53
本期利润	119,517.34	69,617.26	189,134.60
本期基金份额交易产生的变动数	-40,286.23	11,009.57	-29,276.66
其中：基金申购款	107,371.55	57,120.21	164,491.76
基金赎回款	-147,657.78	-46,110.64	-193,768.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,886.40	28,263.01	158,149.41

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,046.02
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	8,785.82
其他	103.63
合计	26,935.47

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	172,945,349.94
减：卖出股票成本总额	171,184,522.55
减：交易费用	449,039.62
买卖股票差价收入	1,311,787.77

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	150.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,661.20
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	29,811.62

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	954,581.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	914,090.46
减：应计利息总额	10,823.72
减：交易费用	5.77
买卖债券差价收入	29,661.20

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。



#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	478,638.84
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	478,638.84

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	1,191,733.77
——股票投资	1,192,243.31
——债券投资	-509.54
——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	1,191,733.77

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,828.59
转换费收入	667.46
合计	2,496.05

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。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	164,466.77

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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	274,047.89	234,770.70
其中：支付销售机构的客户维护费	13,139.31	12,648.24

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,404.78	23,477.09

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		
	2023年1月1日至2023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	-	27.84	27.84
合计	-	27.84	27.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	43.05	43.05
合计	-	43.05	43.05

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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
基金合同生效日 (2019年5月17日) 持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	43,135,642.68	96,786.68	33,342,302.82	-
期间申购/买入总份额	-	-	9,793,339.86	-
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	43,135,642.68	96,786.68	43,135,642.68	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	84.36%	0.19%	85.34%	-

##### 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均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	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	3,640,397.20	18,046.02	3,787,445.17	21,805.51

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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人宁波银行，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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 2023 年 06 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,640,397.20	-	-	-	3,640,397.20
结算备付金	1,247,877.66	-	-	-	1,247,877.66
存出保证金	13,302.30	-	-	-	13,302.30
交易性金融资产	-	-	-	49,709,454.00	49,709,454.00
应收申购款	-	-	-	9,411.10	9,411.10
资产总计	4,901,577.16	-	-	49,718,865.10	54,620,442.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,331.19	5,331.19
应付管理人报酬	-	-	-	44,174.98	44,174.98
应付托管费	-	-	-	4,417.50	4,417.50



应付销售服务费	-	-	-	28.10	28.10
其他负债	-	-	-	250,112.17	250,112.17
负债总计	-	-	-	304,063.94	304,063.94
利率敏感度缺口	4,901,577.16	-	-	49,414,801.16	54,316,378.32
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	2,324,698.73	-	-	-	2,324,698.73
结算备付金	915,787.45	-	-	-	915,787.45
存出保证金	9,239.18	-	-	-	9,239.18
交易性金融资产	810,272.66	-	-	47,549,825.06	48,360,097.72
应收清算款	-	-	-	701,328.67	701,328.67
应收申购款	194.04	-	-	4,442.91	4,636.95
资产总计	4,060,192.06	-	-	48,255,596.64	52,315,788.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	946.59	946.59
应付管理人报酬	-	-	-	45,073.05	45,073.05
应付托管费	-	-	-	4,507.31	4,507.31
应付销售服务费	-	-	-	30.37	30.37
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	254,733.64	254,733.64
负债总计	-	-	-	305,290.97	305,290.97
利率敏感度缺口	4,060,192.06	-	-	47,950,305.67	52,010,497.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：1.56%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	49,709,454.00	91.52	47,549,825.06	91.42
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>	<b>49,709,454.00</b>	<b>91.52</b>	<b>47,549,825.06</b>	<b>91.42</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 248	增加约 248
	业绩比较基准下降 5%	减少约 248	减少约 248

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	49,709,454.00	47,549,825.06
第二层次	-	810,272.66
第三层次	-	-
合计	49,709,454.00	48,360,097.72

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	49,709,454.00	91.01
	其中：股票	49,709,454.00	91.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,888,274.86	8.95
8	其他各项资产	22,713.40	0.04
9	合计	54,620,442.26	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境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	760,005.00	1.40
B	采矿业	1,302,545.00	2.40
C	制造业	28,766,538.50	52.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,105,299.00	2.03

E	建筑业	440,467.00	0.81
F	批发和零售业	822,401.60	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	1,367,384.00	2.52
H	住宿和餐饮业	335,415.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,203,556.10	2.22
J	金融业	4,928,901.80	9.07
K	房地产业	277,745.00	0.51
L	租赁和商务服务业	381.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	286,065.00	0.53
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	734,574.00	1.35
S	综合	-	-
	合计	42,331,278.00	77.93

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	447,093.00	0.82
C	制造业	4,324,539.00	7.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,915.00	0.01
E	建筑业	118,703.00	0.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	55,556.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,436,981.00	2.65
J	金融业	569,396.00	1.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	181,104.00	0.33
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	78,905.00	0.15
S	综合	159,984.00	0.29
	合计	7,378,176.00	13.58

### 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	300724	捷佳伟创	5,900	662,865.00	1.22
2	002422	科伦药业	21,600	641,088.00	1.18
3	600580	卧龙电驱	39,200	572,712.00	1.05
4	603688	石英股份	5,000	569,200.00	1.05
5	601233	桐昆股份	42,500	563,125.00	1.04
6	300699	光威复材	17,900	552,215.00	1.02
7	600481	双良节能	39,500	552,210.00	1.02
8	002465	海格通信	53,200	550,088.00	1.01
9	000630	铜陵有色	187,700	542,453.00	1.00
10	300144	宋城演艺	43,300	536,920.00	0.99
11	002138	顺络电子	22,400	535,584.00	0.99
12	002078	太阳纸业	49,300	527,017.00	0.97
13	601966	玲珑轮胎	23,700	526,614.00	0.97
14	601077	渝农商行	146,500	525,935.00	0.97
15	600166	福田汽车	153,500	521,900.00	0.96
16	600863	内蒙华电	123,900	514,185.00	0.95
17	002273	水晶光电	42,614	508,811.16	0.94
18	688516	奥特维	2,700	508,680.00	0.94
19	600497	驰宏锌锗	101,100	507,522.00	0.93
20	000728	国元证券	77,800	507,256.00	0.93
21	002384	东山精密	19,500	505,050.00	0.93
22	000513	丽珠集团	12,800	498,048.00	0.92
23	002299	圣农发展	25,900	495,985.00	0.91
24	600038	中直股份	12,400	493,768.00	0.91

25	002507	涪陵榨菜	26,900	492,539.00	0.91
26	600535	天士力	33,700	488,987.00	0.90
27	600380	健康元	38,400	488,064.00	0.90
28	000636	风华高科	31,800	487,812.00	0.90
29	002249	大洋电机	85,500	487,350.00	0.90
30	600582	天地科技	82,600	481,558.00	0.89
31	000027	深圳能源	72,900	480,411.00	0.88
32	000729	燕京啤酒	38,400	478,848.00	0.88
33	600909	华安证券	102,300	477,741.00	0.88
34	000060	中金岭南	100,300	476,425.00	0.88
35	000750	国海证券	141,800	475,030.00	0.87
36	601000	唐山港	134,200	473,726.00	0.87
37	002508	老板电器	18,700	472,923.00	0.87
38	600109	国金证券	54,000	468,180.00	0.86
39	300438	鹏辉能源	9,600	461,184.00	0.85
40	000778	新兴铸管	112,800	460,224.00	0.85
41	600707	彩虹股份	96,400	458,864.00	0.84
42	603225	新凤鸣	41,400	457,470.00	0.84
43	601717	郑煤机	36,700	456,915.00	0.84
44	601058	赛轮轮胎	39,900	454,461.00	0.84
45	300357	我武生物	13,500	454,005.00	0.84
46	603885	吉祥航空	29,200	450,556.00	0.83
47	000089	深圳机场	63,600	442,020.00	0.81
48	600718	东软集团	41,000	437,060.00	0.80
49	000898	鞍钢股份	157,200	437,016.00	0.80
50	002563	森马服饰	70,100	436,022.00	0.80
51	603218	日月股份	22,800	432,972.00	0.80
52	000563	陕国投 A	141,700	432,185.00	0.80
53	600315	上海家化	14,500	420,645.00	0.77
54	601128	常熟银行	60,600	413,292.00	0.76
55	002250	联化科技	38,200	399,572.00	0.74
56	002966	苏州银行	60,400	395,620.00	0.73
57	603707	健友股份	28,600	386,100.00	0.71
58	600801	华新水泥	30,900	381,615.00	0.70
59	688295	中复神鹰	10,300	377,804.00	0.70
60	000739	普洛药业	20,700	367,218.00	0.68
61	688390	固德威	2,200	367,092.00	0.68
62	000423	东阿阿胶	6,600	352,770.00	0.65
63	601718	际华集团	118,600	352,242.00	0.65
64	601108	财通证券	48,400	350,416.00	0.65
65	600258	首旅酒店	17,700	335,415.00	0.62
66	300568	星源材质	18,900	324,891.00	0.60
67	601577	长沙银行	41,400	321,264.00	0.59
68	002056	横店东磁	17,000	309,570.00	0.57

69	600998	九州通	29,800	309,324.00	0.57
70	600399	抚顺特钢	30,300	309,060.00	0.57
71	002152	广电运通	26,200	307,064.00	0.57
72	600259	广晟有色	8,400	303,576.00	0.56
73	000559	万向钱潮	54,600	297,570.00	0.55
74	300308	中际旭创	2,000	294,900.00	0.54
75	600160	巨化股份	21,300	293,514.00	0.54
76	601958	金钼股份	26,300	293,245.00	0.54
77	603456	九洲药业	10,300	282,014.00	0.52
78	600820	隧道股份	46,600	280,066.00	0.52
79	002025	航天电器	4,300	274,340.00	0.51
80	002518	科士达	6,800	272,068.00	0.50
81	600369	西南证券	73,100	266,815.00	0.49
82	000998	隆平高科	17,200	264,020.00	0.49
83	600325	华发股份	25,600	252,160.00	0.46
84	002429	兆驰股份	45,800	251,900.00	0.46
85	000997	新大陆	13,100	247,590.00	0.46
86	300003	乐普医疗	10,900	246,449.00	0.45
87	603883	老百姓	7,800	232,830.00	0.43
88	600409	三友化工	41,000	223,450.00	0.41
89	300088	长信科技	35,000	211,050.00	0.39
90	002511	中顺洁柔	18,800	209,620.00	0.39
91	600521	华海药业	11,100	204,351.00	0.38
92	603737	三棵树	3,120	204,110.40	0.38
93	600871	石化油服	98,800	195,624.00	0.36
93	002739	万达电影	15,600	195,624.00	0.36
95	688777	中控技术	3,045	191,165.10	0.35
96	603127	昭衍新药	4,600	188,140.00	0.35
97	000683	远兴能源	24,100	173,279.00	0.32
98	601636	旗滨集团	19,700	169,814.00	0.31
99	600765	中航重机	6,400	169,664.00	0.31
100	002926	华西证券	20,300	168,693.00	0.31
101	600859	王府井	8,500	168,215.00	0.31
102	600398	海澜之家	23,700	163,056.00	0.30
103	002439	启明星辰	5,300	157,728.00	0.29
104	002110	三钢闽光	32,000	135,040.00	0.25
105	600901	江苏金租	29,960	123,734.80	0.23
106	002867	周大生	6,400	113,792.00	0.21
107	002081	金螳螂	25,000	112,750.00	0.21
108	600153	建发股份	9,800	106,918.00	0.20
109	002568	百润股份	2,900	105,415.00	0.19
110	603317	天味食品	7,100	103,731.00	0.19
111	688002	睿创微纳	2,300	103,040.00	0.19
112	002373	千方科技	7,300	99,572.00	0.18



113	600642	申能股份	13,800	96,462.00	0.18
114	688248	南网科技	2,500	95,975.00	0.18
115	002032	苏泊尔	1,900	95,000.00	0.17
116	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.16
117	603267	鸿远电子	1,300	84,890.00	0.16
118	002531	天顺风能	5,400	82,242.00	0.15
119	600885	宏发股份	2,300	73,255.00	0.13
120	300009	安科生物	6,700	67,000.00	0.12
121	603786	科博达	1,000	65,700.00	0.12
122	000738	航发控制	2,500	61,000.00	0.11
123	002065	东华软件	8,600	60,716.00	0.11
124	002532	天山铝业	8,100	48,519.00	0.09
125	600170	上海建工	17,400	46,806.00	0.09
126	688116	天奈科技	799	36,554.25	0.07
127	688520	神州细胞	600	34,044.00	0.06
128	001914	招商积余	1,700	25,585.00	0.05
129	300776	帝尔激光	280	18,172.00	0.03
130	603517	绝味食品	400	14,860.00	0.03
131	600563	法拉电子	100	13,730.00	0.03
132	600167	联美控股	1,800	12,546.00	0.02
133	002831	裕同科技	500	12,195.00	0.02
134	600486	扬农化工	100	8,742.00	0.02
135	603596	伯特利	100	7,926.00	0.01
136	603868	飞科电器	100	6,309.00	0.01
137	688385	复旦微电	100	5,010.00	0.01
138	603589	口子窖	100	4,935.00	0.01
139	002028	思源电气	100	4,672.00	0.01
140	300861	美畅股份	100	4,337.00	0.01
141	300373	扬杰科技	100	4,057.00	0.01
142	300418	昆仑万维	100	4,028.00	0.01
143	688690	纳微科技	100	3,885.00	0.01
144	603816	顾家家居	100	3,815.00	0.01
145	600378	昊华科技	100	3,764.00	0.01
146	601869	长飞光纤	100	3,701.00	0.01
147	688819	天能股份	100	3,684.00	0.01
148	600298	安琪酵母	100	3,621.00	0.01
149	603712	七一二	100	3,021.00	0.01
150	600566	济川药业	100	2,904.00	0.01
151	688006	杭可科技	95	2,894.65	0.01
152	600529	山东药玻	100	2,722.00	0.01
153	600079	人福医药	100	2,694.00	0.00
154	603228	景旺电子	100	2,565.00	0.00
155	603355	莱克电气	100	2,541.00	0.00
156	002353	杰瑞股份	100	2,513.00	0.00

157	600316	洪都航空	100	2,345.00	0.00
158	300682	朗新科技	100	2,328.00	0.00
159	002444	巨星科技	100	2,188.00	0.00
160	002372	伟星新材	100	2,054.00	0.00
161	600498	烽火通信	100	2,037.00	0.00
162	600131	国网信通	100	2,019.00	0.00
163	688772	珠海冠宇	100	2,015.00	0.00
164	300136	信维通信	100	2,008.00	0.00
165	300012	华测检测	100	1,950.00	0.00
166	600549	厦门钨业	100	1,903.00	0.00
167	002705	新宝股份	100	1,803.00	0.00
168	603233	大参林	60	1,680.60	0.00
169	000623	吉林敖东	100	1,604.00	0.00
170	601231	环旭电子	100	1,496.00	0.00
171	603939	益丰药房	40	1,480.00	0.00
172	002155	湖南黄金	100	1,220.00	0.00
173	002203	海亮股份	100	1,201.00	0.00
174	600195	中牧股份	100	1,168.00	0.00
175	601098	中南传媒	100	1,160.00	0.00
176	002399	海普瑞	100	1,147.00	0.00
177	000878	云南铜业	100	1,105.00	0.00
178	002468	申通快递	100	1,082.00	0.00
179	601168	西部矿业	100	1,051.00	0.00
180	688289	圣湘生物	56	943.04	0.00
181	600352	浙江龙盛	100	935.00	0.00
182	600143	金发科技	100	873.00	0.00
183	000156	华数传媒	100	870.00	0.00
184	600879	航天电子	100	849.00	0.00
185	601611	中国核建	100	845.00	0.00
186	600299	安迪苏	100	797.00	0.00
187	600637	东方明珠	100	782.00	0.00
188	600755	厦门国贸	100	774.00	0.00
189	601139	深圳燃气	100	729.00	0.00
190	601555	东吴证券	100	694.00	0.00
191	002340	格林美	100	691.00	0.00
192	600655	豫园股份	100	686.00	0.00
193	000591	太阳能	100	678.00	0.00
193	000703	恒逸石化	100	678.00	0.00
195	000783	长江证券	100	580.00	0.00
196	002500	山西证券	100	558.00	0.00
197	600500	中化国际	100	556.00	0.00
198	601997	贵阳银行	100	516.00	0.00
199	600704	物产中大	100	494.00	0.00
200	601665	齐鲁银行	100	392.00	0.00

201	000785	居然之家	100	381.00	0.00
202	600782	新钢股份	100	371.00	0.00
203	600959	江苏有线	100	338.00	0.00
204	600968	海油发展	100	307.00	0.00
205	600008	首创环保	100	288.00	0.00
206	002131	利欧股份	100	230.00	0.00
207	000709	河钢股份	100	226.00	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	000725	京东方 A	98,700	403,683.00	0.74
2	600183	生益科技	25,900	367,780.00	0.68
3	603290	斯达半导	1,600	344,320.00	0.63
4	300014	亿纬锂能	5,200	314,600.00	0.58
5	688066	航天宏图	4,800	292,320.00	0.54
6	300751	迈为股份	1,600	271,008.00	0.50
7	601939	建设银行	42,200	264,172.00	0.49
8	300450	先导智能	6,500	235,105.00	0.43
9	300242	佳云科技	67,300	232,185.00	0.43
10	000776	广发证券	14,800	217,708.00	0.40
11	688239	航宇科技	3,000	209,850.00	0.39
12	600583	海油工程	34,800	203,580.00	0.37
13	601222	林洋能源	24,800	203,112.00	0.37
14	300098	高新兴	54,600	199,290.00	0.37
15	300102	乾照光电	30,100	198,058.00	0.36
16	603799	华友钴业	4,100	188,231.00	0.35
17	300416	苏试试验	8,400	181,104.00	0.33
18	688568	中科星图	2,200	177,276.00	0.33
19	603993	洛阳钼业	31,100	165,763.00	0.31
20	000551	创元科技	14,400	159,984.00	0.29
21	002402	和而泰	8,400	142,632.00	0.26
22	688030	山石网科	5,800	124,294.00	0.23
23	601618	中国中冶	29,900	118,703.00	0.22
24	002154	报喜鸟	21,300	117,576.00	0.22
25	002139	拓邦股份	8,900	116,145.00	0.21
26	300763	锦浪科技	1,100	114,510.00	0.21
27	601929	吉视传媒	61,500	113,160.00	0.21
28	600588	用友网络	5,500	112,750.00	0.21
29	688599	天合光能	2,600	110,786.00	0.20
30	300717	华信新材	6,200	105,710.00	0.19

31	600285	羚锐制药	5,900	94,754.00	0.17
32	300457	赢合科技	5,200	91,832.00	0.17
33	601377	兴业证券	14,300	87,516.00	0.16
34	300245	天玑科技	8,800	84,040.00	0.15
35	000793	华闻集团	36,700	78,905.00	0.15
36	603979	金诚信	2,500	77,750.00	0.14
37	600237	铜峰电子	7,400	60,902.00	0.11
38	002832	比音勒芬	1,700	60,197.00	0.11
39	688063	派能科技	300	59,475.00	0.11
40	002410	广联达	1,800	58,482.00	0.11
41	300207	欣旺达	3,300	53,856.00	0.10
42	603386	骏亚科技	4,600	52,210.00	0.10
43	600004	白云机场	3,500	50,190.00	0.09
44	600458	时代新材	4,100	49,159.00	0.09
45	601600	中国铝业	7,800	42,822.00	0.08
46	688561	奇安信	800	41,448.00	0.08
47	600355	精伦电子	10,400	35,984.00	0.07
48	300169	天晟新材	7,800	32,604.00	0.06
49	605117	德业股份	200	29,910.00	0.06
50	002161	远望谷	5,500	28,655.00	0.05
51	600558	大西洋	6,300	25,011.00	0.05
52	002332	仙琚制药	1,600	21,200.00	0.04
53	300909	汇创达	800	21,136.00	0.04
54	603878	武进不锈	2,500	21,125.00	0.04
55	002812	恩捷股份	200	19,270.00	0.04
56	000157	中联重科	2,800	18,900.00	0.03
57	688798	艾为电子	300	17,745.00	0.03
58	688148	芳源股份	1,200	14,640.00	0.03
59	600761	安徽合力	600	11,958.00	0.02
60	688711	宏微科技	200	11,668.00	0.02
61	002283	天润工业	1,000	6,420.00	0.01
62	601619	嘉泽新能	1,300	5,915.00	0.01
63	600009	上海机场	100	4,542.00	0.01
64	002063	远光软件	200	1,736.00	0.00
65	601111	中国国航	100	824.00	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	002078	太阳纸业	1,953,206.00	3.76
2	300866	安克创新	1,787,320.00	3.44
3	000878	云南铜业	1,470,756.00	2.83
4	603596	伯特利	1,454,203.00	2.80
5	600160	巨化股份	1,444,424.00	2.78
6	601231	环旭电子	1,375,234.00	2.64
7	300136	信维通信	1,333,895.00	2.56
8	603456	九洲药业	1,326,788.00	2.55
9	002081	金螳螂	1,312,923.40	2.52
10	002249	大洋电机	1,305,843.00	2.51
11	600563	法拉电子	1,284,804.00	2.47
12	300357	我武生物	1,282,954.26	2.47
13	600409	三友化工	1,242,881.00	2.39
14	601098	中南传媒	1,218,957.00	2.34
15	600820	隧道股份	1,147,977.00	2.21
16	600959	江苏有线	1,114,993.00	2.14
17	603127	昭衍新药	1,095,298.00	2.11
18	603605	珀莱雅	1,094,905.00	2.11
19	002465	海格通信	1,092,864.00	2.10
20	600497	驰宏锌锗	1,084,199.00	2.08
21	600201	生物股份	1,062,379.00	2.04
22	600064	南京高科	1,058,264.00	2.03
23	600968	海油发展	1,054,105.00	2.03
24	600901	江苏金租	1,053,914.00	2.03
25	600967	内蒙一机	1,042,620.00	2.00

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	600563	法拉电子	2,158,727.00	4.15
2	601098	中南传媒	2,112,123.00	4.06
3	300866	安克创新	1,976,667.00	3.80
4	600967	内蒙一机	1,935,324.00	3.72
5	600201	生物股份	1,928,069.00	3.71
6	600141	兴发集团	1,716,999.00	3.30
7	300012	华测检测	1,584,848.98	3.05
8	600549	厦门钨业	1,513,699.00	2.91
9	300136	信维通信	1,509,590.30	2.90
10	603228	景旺电子	1,500,754.00	2.89

11	601231	环旭电子	1,486,474.00	2.86
12	603596	伯特利	1,473,510.00	2.83
13	000878	云南铜业	1,438,948.00	2.77
14	002705	新宝股份	1,420,511.00	2.73
15	601577	长沙银行	1,414,207.00	2.72
16	600380	健康元	1,392,036.00	2.68
17	600959	江苏有线	1,386,021.00	2.66
18	002078	太阳纸业	1,352,479.00	2.60
19	603456	九洲药业	1,339,085.00	2.57
20	603605	珀莱雅	1,327,351.00	2.55
21	600160	巨化股份	1,309,654.00	2.52
22	000156	华数传媒	1,295,910.00	2.49
23	600497	驰宏锌锗	1,272,719.00	2.45
24	600598	北大荒	1,264,664.00	2.43
25	600867	通化东宝	1,253,649.00	2.41
26	601298	青岛港	1,237,010.00	2.38
27	601555	东吴证券	1,235,818.92	2.38
28	002195	岩山科技	1,209,669.00	2.33
29	002081	金螳螂	1,173,022.80	2.26
30	600008	首创环保	1,164,609.00	2.24
31	002422	科伦药业	1,160,168.00	2.23
32	002242	九阳股份	1,122,729.00	2.16
33	688006	杭可科技	1,119,275.10	2.15
34	300244	迪安诊断	1,101,829.00	2.12
35	600968	海油发展	1,101,682.00	2.12
36	603868	飞科电器	1,094,559.00	2.10
37	600064	南京高科	1,073,187.00	2.06
38	002507	涪陵榨菜	1,068,025.08	2.05
39	300231	银信科技	1,053,919.00	2.03
40	002131	利欧股份	1,051,900.00	2.02
41	300308	中际旭创	1,048,855.00	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	172,151,908.18
卖出股票的收入（成交）总额	172,945,349.94

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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“宋城演艺”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。

宋城演艺公司本身因未如实披露股权转让相关“差额补足义务及超额收益安排”具体内容，信息披露不完整等原因，受到中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函、要求提交书面承诺的监督管理措施。

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

本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.12.2 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	13,302.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,411.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,713.40

### 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	
			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	865	55,380.73	43,135,642.68	90.05%	4,768,691.10	9.95%
国泰中证 500 指数增强 C	398	8,114.32	96,786.68	3.00%	3,132,713.41	97.00%
合计	1,263	40,486.01	43,232,429.36	84.55%	7,901,404.51	15.45%

### 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	149,307.83	0.31%
	国泰中证 500 指数增强 C	610.57	0.02%
	合计	149,918.40	0.29%

### 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	10~50
	国泰中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50

## 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 日）基金份额总额	503,992.20	52,535,553.55
本报告期期初基金份额总额	47,773,962.88	3,616,727.60
本报告期基金总申购份额	911,992.50	2,139,345.79
减：本报告期基金总赎回份额	781,621.60	2,526,573.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,904,333.78	3,229,500.09

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	345,097,258.12	100.00%	248,918.37	100.00%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 财力雄厚，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	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	954,581.15	100.00%	-	-	-	-

## 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	43,232,429.36	-	-	43,232,429.36	84.55%
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。

基金托管人住所或办公场所。

### 12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日

