

# 国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

## 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：海通证券股份有限公司

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。

基金托管人海通证券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 2 月 9 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	错误! 未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误! 未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误! 未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误! 未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误! 未定义书签。
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误! 未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误! 未定义书签。
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误! 未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误! 未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误! 未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误! 未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
<b>6 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	错误! 未定义书签。
6.2 利润表.....	错误! 未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误! 未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误! 未定义书签。
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误! 未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
7.4 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.....	错误! 未定义书签。
7.5 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.....	错误! 未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误! 未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误! 未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误! 未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误! 未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误! 未定义书签。
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	错误! 未定义书签。
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	错误! 未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	错误! 未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	错误! 未定义书签。
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	错误! 未定义书签。
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 .....	错误! 未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	错误! 未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变 .....	错误! 未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	错误! 未定义书签。
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 .....	错误! 未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	错误! 未定义书签。
10.8 其他重大事件 .....	错误! 未定义书签。
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	错误! 未定义书签。
12.2 存放地点 .....	错误! 未定义书签。
12.3 查阅方式 .....	错误! 未定义书签。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 1000 增强策略 ETF
场内简称	中证 1000 增强 ETF
基金主代码	159679
交易代码	159679
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 2 月 9 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,228,489,156.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股及优化组合管理，在注重风险控制的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。在复制标的指数的基础上，综合运用超额收益模型、风险模型、成本模型选择具有较高投资价值的股票构建投资组合。本基金个股选择范围包括标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与标的指数成份股相关度高的股票等。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会，力求在有效跟踪标的指数的基础上获取超越标的指数的投资回报。</p> <p>（1）超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值，定价过高的资产应当考虑回避。</p> <p>其中，多因子量化系统基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、成长性因子、技术因子、流动性因子、分析师因子等多类对股票超额收益具有较强解释能力的因子进行构建。</p> <p>（2）风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括行业偏离度、风格偏离度、波动率等，力求将主动风险以及跟踪误差控制在目</p>

	<p>标范围内。</p> <p>在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.50%。</p> <p>（3）成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等预测本基金的交易成本，以减少交易对业绩造成的负影响。本基金运作过程中，当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基金份额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 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	邓来承
	联系电话	021-31081600转	021-23185481
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	dlc11913@haitong.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95553
传真		021-31081800	021-23187700
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	上海市黄浦区广东路689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	上海市黄浦区中山南路888号 海通外滩金融广场
邮政编码		200082	200011
法定代表人		邱军	周杰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-16,326,887.51
本期利润	-15,559,976.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0229
本期加权平均净值利润率	-2.36%
本期基金份额净值增长率	-3.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-47,285,923.90
期末可供分配基金份额利润	-0.0385
期末基金资产净值	1,181,203,232.10
期末基金份额净值	0.9615
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.85%

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)本基金合同生效日为 2023 年 2 月 9 日，截止至 2023 年 6 月 30 日不满一年。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.29%	0.98%	0.62%	1.05%	1.67%	-0.07%
过去三个月	-1.53%	0.86%	-3.98%	0.92%	2.45%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-3.85%	0.79%	-4.01%	0.90%	0.16%	-0.11%

##### 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 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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  
(2023 年 2 月 9 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金的合同生效日为 2023 年 2 月 9 日，截止至 2023 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期结束时，确保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 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	2023-02-09	-	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 2 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

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

本基金本报告期内的净值增长率为-3.85%，同期业绩比较基准收益率为-4.01%。

#### 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，本基金托管人在国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的管理人——国泰基金管理有限公司在国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

#### 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

本托管人依法对国泰基金管理有限公司编制和披露的国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	66,896,163.20
结算备付金		2,191,884.30
存出保证金		1,964,960.51

交易性金融资产	6.4.7.2	1,145,381,814.52
其中：股票投资		1,145,381,814.52
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		13,650,820.77
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,230,085,643.30
<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>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		-
应付管理人报酬		395,719.20
应付托管费		39,571.92
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	48,447,120.08
负债合计		48,882,411.20
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	1,228,489,156.00
未分配利润	6.4.7.8	-47,285,923.90
净资产合计		1,181,203,232.10
负债和净资产总计		1,230,085,643.30

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9615 元，基金份额总额 1,228,489,156.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-12,728,121.37
1.利息收入		852,573.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	852,573.64
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）		-15,578,158.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-20,173,112.34
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	361,766.64
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	-
股利收益	6.4.7.13	4,233,186.76
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	766,910.86
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	1,230,553.07
<b>减：二、营业总支出</b>		2,831,855.28
1. 管理人报酬		2,491,256.81
2. 托管费		249,125.64
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		0.69
8. 其他费用	6.4.7.16	91,472.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-15,559,976.65</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-15,559,976.65</b>

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-15,559,976.65

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 9 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）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）	1,458,089,156.00	-	1,458,089,156.00
二、本期期初净资产（基金净值）	1,458,089,156.00	-	1,458,089,156.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-229,600,000.00	-47,285,923.90	-276,885,923.90
（一）、综合收益总额	-	-15,559,976.65	-15,559,976.65
（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）	-229,600,000.00	-31,725,947.25	-261,325,947.25
其中：1.基金申购款	817,600,000.00	-41,296,325.03	776,303,674.97
2.基金赎回款	-1,047,200,000.00	9,570,377.78	-1,037,629,622.22
（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）	1,228,489,156.00	-47,285,923.90	1,181,203,232.10

注：本基金合同生效日为 2023 年 2 月 9 日，无上年度可比期间数据。

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 1000 增强策略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[2022]2602 号《关于准予国泰中证 1000 增强策略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 1000 增强策略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 1,458,066,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0069 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,458,089,156.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 23,156.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)自律监管决定书深证上[2023]89 号文核准，本基金于 2023 年 2 月 22 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 1000 增强策略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(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。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的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，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 1000 指数收益率。

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 1000 增强策略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 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 02 月 09 日(基金合同生效日)至 2023 年 06 月 30 日止期间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 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 02 月 09 日(基金合同生效日)至 2023 年 06 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

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 09 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

### (2) 金融负债

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

### (3) 衍生金融工具

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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》及中基协字[2022]566号《关于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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 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	66,896,163.20
等于：本金	66,887,287.69
加：应计利息	8,875.51
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	66,896,163.20

#### 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	1,144,614,903.66	-	1,145,381,814.52	766,910.86
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	1,144,614,903.66	-	1,145,381,814.52	766,910.86

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 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	1,083,468.47
其中：交易所市场	1,083,468.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,472.14
可退替代款	2,181,413.56
应付替代款	45,090,765.91
合计	48,447,120.08

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。

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,458,089,156.00	1,458,089,156.00
本期申购	817,600,000.00	817,600,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,047,200,000.00	-1,047,200,000.00
本期末	1,228,489,156.00	1,228,489,156.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-16,326,887.51	766,910.86	-15,559,976.65
本期基金份额交易产生的变动数	-19,484,476.39	-12,241,470.86	-31,725,947.25
其中：基金申购款	-22,681,888.34	-18,614,436.69	-41,296,325.03
基金赎回款	3,197,411.95	6,372,965.83	9,570,377.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,811,363.90	-11,474,560.00	-47,285,923.90

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	811,453.92
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	29,690.95
其他	11,428.77
合计	852,573.64

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,033,161.50
股票投资收益——赎回差价收入	-4,139,950.84
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	-20,173,112.34

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,317,792,203.89
减：卖出股票成本总额	1,330,042,120.35
减：交易费用	3,783,245.04
买卖股票差价收入	-16,033,161.50

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,037,629,622.22
减：现金支付赎回款总额	518,175,510.22
减：赎回股票成本总额	523,594,062.84
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,139,950.84

#### 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 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	203.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	361,563.30
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	361,766.64

##### 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 2 月 9 日（基金合同生效日）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	1,426,329.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,064,500.00
减：应计利息总额	209.12
减：交易费用	57.05
买卖债券差价收入	361,563.30

#### 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2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,233,186.76
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	4,233,186.76

#### 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2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	766,910.86
——股票投资	766,910.86
——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	766,910.86

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	1,225,357.79
其他	5,195.28
合计	1,230,553.07

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实

际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	43,558.50
信息披露费	47,913.64
证券出借违约金	-
合计	91,472.14

#### 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
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
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
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
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金托管人、申购赎回代理券商
国泰基金管理有限公司	基金管理人

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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	4,000,784,055.23	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	1,426,329.47	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	2,150,520.75	100.00%	1,083,468.47	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,491,256.81

其中：支付销售机构的客户维护费	102,618.71
-----------------	------------

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
	2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	249,125.64

注：支付基金托管人海通证券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：

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023年2月9日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
海通证券	66,896,163.20	811,453.92

注：本基金的银行活期存款由基金托管人海通证券保管，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

本基金在本报告期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	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
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	网下中签流通受限	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	网下中签流通受限	25.82	25.82	2,754.00	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	网下中签流通受限	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.10	17.04	2,171.00	24,098.10	36,993.84	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.60	64.67	505.00	11,918.00	32,658.35	-
30129	三博	2023-0	6 个月	新股	29.60	71.42	333.00	9,856.	23,782	-



3	脑科	4-25	以上	锁定 流通 受限				80	.86	
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	75.00	90.76	194.00	14,550.00	17,607.44	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	21.17	23.50	731.00	15,475.27	17,178.50	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	43.67	53.05	311.00	13,581.37	16,498.55	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	14.81	13.73	1,064.00	15,757.84	14,608.72	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	125.80	118.03	121.00	15,221.80	14,281.63	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	30.26	25.33	558.00	16,885.08	14,134.14	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月以上	新股 锁定	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-

				流通受限						
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月以上	新股锁定流通受限	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的风险控制目标是在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股及优化组合管理，在注重风险控制的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。

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海通证券开立于具有基金托管资格的银行的托管账户，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%。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于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 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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%。

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、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	66,896,163.20	-	-	-	66,896,163.20
结算备付金	2,191,884.30	-	-	-	2,191,884.30
存出保证金	1,964,960.51	-	-	-	1,964,960.51
交易性金融资产	-	-	-	1,145,381,814.52	1,145,381,814.52
应收清算款	-	-	-	13,650,820.77	13,650,820.77
资产总计	71,053,008.01	-	-	1,159,032,635.29	1,230,085,643.30
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	395,719.20	395,719.20
应付托管费	-	-	-	39,571.92	39,571.92
其他负债	-	-	-	48,447,120.08	48,447,120.08

负债总计	-	-	-	48,882,411.20	48,882,411.20
利率敏感度缺口	71,053,008.01	-	-	1,110,150,224.09	1,181,203,232.10

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%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,145,381,814.52	96.97

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	-	-
<b>合计</b>	<b>1,145,381,814.52</b>	<b>96.97</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 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。

#### 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
第一层次	1,144,811,305.25
第二层次	255,956.94
第三层次	314,552.33
<b>合计</b>	<b>1,145,381,814.52</b>

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2023 上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 776,303,674.97 元，其中包括以股票支付的申购款 312,600,740.48 元和以现金支付的申购款 463,702,934.49 元。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,145,381,814.52	93.11
	其中：股票	1,145,381,814.52	93.11
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	69,088,047.50	5.62
8	其他各项资产	15,615,781.28	1.27
9	合计	1,230,085,643.30	100.00



注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 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	-	-
B	采矿业	16,514,742.00	1.40
C	制造业	754,092,034.50	63.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,309,199.00	2.40
E	建筑业	6,575,044.00	0.56
F	批发和零售业	22,513,056.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	13,134,602.00	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	109,452,485.35	9.27
J	金融业	49,819,801.07	4.22
K	房地产业	11,228,033.00	0.95
L	租赁和商务服务业	5,224,350.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	18,558,609.00	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	5,675,409.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,336,012.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	4,948,400.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	1,049,381,776.92	88.84

### 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	-	-
C	制造业	88,197,294.24	7.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,781,935.00	0.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,649.02	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,617,054.00	0.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	95,678,109.60	8.10

### 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	688598	金博股份	67,500	11,576,250.00	0.98
2	688333	铂力特	76,700	8,110,258.00	0.69
3	002472	双环传动	217,400	7,891,620.00	0.67
4	603118	共进股份	539,030	7,163,708.70	0.61

5	600835	上海机电	401,700	6,901,206.00	0.58
6	002906	华阳集团	200,900	6,868,771.00	0.58
7	688556	高测股份	128,817	6,845,335.38	0.58
8	002126	银轮股份	377,200	6,676,440.00	0.57
9	601137	博威合金	425,500	6,620,780.00	0.56
10	601886	江河集团	739,600	6,575,044.00	0.56
11	688568	中科星图	81,520	6,568,881.60	0.56
12	603308	应流股份	355,000	6,496,500.00	0.55
13	600675	中华企业	2,178,200	6,425,690.00	0.54
14	603212	赛伍技术	302,500	6,295,025.00	0.53
15	600562	国睿科技	386,100	6,254,820.00	0.53
16	600872	中炬高新	169,815	6,247,493.85	0.53
17	600184	光电股份	474,800	6,234,124.00	0.53
18	000951	中国重汽	367,400	6,190,690.00	0.52
19	600330	天通股份	517,540	6,169,076.80	0.52
20	603305	旭升集团	219,500	6,117,465.00	0.52
21	600578	京能电力	1,561,100	6,103,901.00	0.52
22	002484	江海股份	285,800	6,084,682.00	0.52
23	601222	林洋能源	742,100	6,077,799.00	0.51
24	603693	江苏新能	432,700	6,057,800.00	0.51
25	688408	中信博	71,735	6,049,412.55	0.51
26	002158	汉钟精机	241,837	6,036,251.52	0.51
27	300036	超图软件	253,200	6,003,372.00	0.51
28	600210	紫江企业	1,126,100	5,990,852.00	0.51
29	601126	四方股份	393,300	5,974,227.00	0.51
30	600869	远东股份	1,080,200	5,962,704.00	0.50
31	300502	新易盛	87,084	5,919,099.48	0.50
32	600456	宝钛股份	174,900	5,918,616.00	0.50
33	601369	陕鼓动力	649,500	5,916,945.00	0.50
34	603328	依顿电子	710,700	5,884,596.00	0.50
35	600645	中源协和	347,400	5,871,060.00	0.50
36	601099	太平洋	2,260,900	5,833,122.00	0.49
37	688366	昊海生科	69,100	5,819,602.00	0.49
38	600688	上海石化	1,868,700	5,811,657.00	0.49
39	601375	中原证券	1,564,000	5,802,440.00	0.49
40	600458	时代新材	483,200	5,793,568.00	0.49
41	002832	比音勒芬	163,556	5,791,517.96	0.49
42	600557	康缘药业	210,900	5,791,314.00	0.49
43	002085	万丰奥威	834,600	5,783,778.00	0.49
44	601311	骆驼股份	621,500	5,767,520.00	0.49
45	600908	无锡银行	1,075,200	5,763,072.00	0.49
46	600572	康恩贝	837,800	5,738,930.00	0.49
47	300803	指南针	117,900	5,728,761.00	0.48
48	600305	恒顺醋业	526,600	5,718,876.00	0.48

49	600120	浙江东方	1,491,000	5,710,530.00	0.48
50	603027	千禾味业	270,320	5,709,158.40	0.48
51	300393	中来股份	406,100	5,701,644.00	0.48
52	600916	中国黄金	482,700	5,700,687.00	0.48
53	600360	华微电子	827,400	5,692,512.00	0.48
54	688066	航天宏图	93,333	5,683,979.70	0.48
55	603588	高能环境	605,700	5,675,409.00	0.48
56	000682	东方电子	583,300	5,669,676.00	0.48
57	002859	洁美科技	204,300	5,659,110.00	0.48
58	600583	海油工程	964,600	5,642,910.00	0.48
59	000528	柳工	713,100	5,633,490.00	0.48
60	603979	金诚信	180,000	5,598,000.00	0.47
61	600285	羚锐制药	345,700	5,551,942.00	0.47
62	600552	凯盛科技	468,900	5,551,776.00	0.47
63	002283	天润工业	864,600	5,550,732.00	0.47
64	600531	豫光金铅	880,800	5,549,040.00	0.47
65	600662	外服控股	969,300	5,544,396.00	0.47
66	603396	金辰股份	84,500	5,543,200.00	0.47
67	002402	和而泰	326,300	5,540,574.00	0.47
68	002389	航天彩虹	249,300	5,536,953.00	0.47
69	000657	中钨高新	569,700	5,520,393.00	0.47
70	601678	滨化股份	1,188,100	5,512,784.00	0.47
71	603733	仙鹤股份	264,000	5,504,400.00	0.47
72	002929	润建股份	126,400	5,487,024.00	0.46
73	603279	景津装备	173,300	5,434,688.00	0.46
74	600098	广州发展	879,300	5,434,074.00	0.46
75	300319	麦捷科技	632,400	5,413,344.00	0.46
76	600559	老白干酒	220,200	5,397,102.00	0.46
77	300034	钢研高纳	136,762	5,387,055.18	0.46
78	601929	吉视传媒	2,905,500	5,346,120.00	0.45
79	002139	拓邦股份	407,800	5,321,790.00	0.45
80	600850	电科数字	224,500	5,295,955.00	0.45
81	000426	兴业银锡	593,900	5,273,832.00	0.45
82	000488	晨鸣纸业	1,086,200	5,268,070.00	0.45
83	301071	力量钻石	119,700	5,266,800.00	0.45
84	603919	金徽酒	223,700	5,252,476.00	0.44
85	000555	神州信息	426,600	5,247,180.00	0.44
86	601860	紫金银行	2,087,445	5,239,486.95	0.44
87	002405	四维图新	451,300	5,226,054.00	0.44
88	600057	厦门象屿	600,500	5,224,350.00	0.44
89	300596	利安隆	128,100	5,209,827.00	0.44
90	002036	联创电子	535,900	5,203,589.00	0.44
91	300109	新开源	209,000	5,197,830.00	0.44
92	600761	安徽合力	260,200	5,185,786.00	0.44

93	002262	恩华药业	168,000	5,179,440.00	0.44
94	300894	火星人	202,000	5,159,080.00	0.44
95	300525	博思软件	335,900	5,152,706.00	0.44
96	002063	远光软件	591,600	5,135,088.00	0.43
97	603236	移远通信	88,880	5,129,264.80	0.43
98	000627	天茂集团	1,693,300	5,079,900.00	0.43
99	600933	爱柯迪	217,700	5,070,233.00	0.43
100	002782	可立克	331,500	5,068,635.00	0.43
101	002675	东诚药业	344,200	5,063,182.00	0.43
102	603306	华懋科技	174,200	5,055,284.00	0.43
103	688526	科前生物	211,856	5,040,054.24	0.43
104	002390	信邦制药	1,135,700	5,031,151.00	0.43
105	300737	科顺股份	546,400	5,005,024.00	0.42
106	002541	鸿路钢构	172,500	4,969,725.00	0.42
107	605123	派克新材	45,600	4,954,440.00	0.42
108	300294	博雅生物	136,500	4,952,220.00	0.42
109	603466	风语筑	356,000	4,948,400.00	0.42
110	688800	瑞可达	78,730	4,893,069.50	0.41
111	002332	仙琚制药	367,100	4,864,075.00	0.41
112	000718	苏宁环球	1,759,100	4,802,343.00	0.41
113	688131	皓元医药	84,000	4,786,320.00	0.41
114	300352	北信源	944,600	4,760,784.00	0.40
115	002335	科华数据	131,700	4,734,615.00	0.40
116	300170	汉得信息	409,100	4,721,014.00	0.40
117	600459	贵研铂业	306,540	4,690,062.00	0.40
118	002421	达实智能	1,325,200	4,664,704.00	0.39
119	603678	火炬电子	135,300	4,662,438.00	0.39
120	002558	巨人网络	259,900	4,660,007.00	0.39
121	002697	红旗连锁	797,900	4,659,736.00	0.39
122	000915	华特达因	130,500	4,605,345.00	0.39
123	603113	金能科技	566,300	4,581,367.00	0.39
124	002727	一心堂	172,700	4,559,280.00	0.39
125	688007	光峰科技	213,000	4,441,050.00	0.38
126	601567	三星医疗	351,200	4,435,656.00	0.38
127	603323	苏农银行	1,049,772	4,419,540.12	0.37
128	603197	保隆科技	81,200	4,405,100.00	0.37
129	600729	重庆百货	139,100	4,373,304.00	0.37
130	688711	宏微科技	74,834	4,365,815.56	0.37
131	600966	博汇纸业	737,300	4,364,816.00	0.37
132	300377	赢时胜	530,800	4,299,480.00	0.36
133	300855	图南股份	121,666	4,297,243.12	0.36
134	688148	芳源股份	351,900	4,293,180.00	0.36
135	688033	天宜上佳	224,300	4,288,616.00	0.36
136	600075	新疆天业	907,300	4,273,383.00	0.36

137	002020	京新药业	332,720	4,265,470.40	0.36
138	002928	华夏航空	499,000	4,216,550.00	0.36
139	300653	正海生物	122,500	4,212,775.00	0.36
140	605111	新洁能	93,934	4,088,007.68	0.35
141	002741	光华科技	240,900	4,066,392.00	0.34
142	300767	震安科技	159,700	4,049,992.00	0.34
143	002215	诺普信	537,800	4,038,878.00	0.34
144	300101	振芯科技	207,100	4,015,669.00	0.34
145	601777	力帆科技	1,123,800	4,011,966.00	0.34
146	601619	嘉泽新能	878,000	3,994,900.00	0.34
147	688559	海目星	84,529	3,973,708.29	0.34
148	002895	川恒股份	201,600	3,971,520.00	0.34
149	688100	威胜信息	133,100	3,967,711.00	0.34
150	601208	东材科技	311,700	3,958,590.00	0.34
151	300762	上海瀚讯	333,400	3,924,118.00	0.33
152	000860	顺鑫农业	116,200	3,914,778.00	0.33
153	600151	航天机电	437,000	3,893,670.00	0.33
154	300627	华测导航	119,400	3,876,918.00	0.33
155	300382	斯莱克	293,400	3,869,946.00	0.33
156	300725	药石科技	78,000	3,777,540.00	0.32
157	601908	京运通	614,300	3,716,515.00	0.31
158	002544	普天科技	162,200	3,714,380.00	0.31
159	603416	信捷电气	89,400	3,693,114.00	0.31
160	603896	寿仙谷	83,300	3,690,190.00	0.31
161	688518	联赢激光	132,066	3,679,358.76	0.31
162	300777	中简科技	77,400	3,657,924.00	0.31
163	601677	明泰铝业	261,700	3,632,396.00	0.31
164	002698	博实股份	207,100	3,622,179.00	0.31
165	600320	振华重工	970,200	3,618,846.00	0.31
166	600821	金开新能	520,600	3,586,934.00	0.30
167	603187	海容冷链	179,100	3,580,209.00	0.30
168	601965	中国汽研	173,300	3,578,645.00	0.30
169	002233	塔牌集团	460,700	3,556,604.00	0.30
170	603601	再升科技	827,180	3,532,058.60	0.30
171	603989	艾华集团	167,600	3,529,656.00	0.30
172	600363	联创光电	95,100	3,528,210.00	0.30
173	600984	建设机械	780,100	3,526,052.00	0.30
174	600876	洛阳玻璃	219,632	3,505,326.72	0.30
175	600197	伊力特	128,600	3,494,062.00	0.30
176	600888	新疆众和	440,099	3,485,584.08	0.30
177	600577	精达股份	825,600	3,484,032.00	0.29
178	601011	宝泰隆	970,100	3,482,659.00	0.29
179	600569	安阳钢铁	1,737,800	3,458,222.00	0.29
180	600477	杭萧钢构	837,500	3,425,375.00	0.29

181	605338	巴比食品	134,100	3,386,025.00	0.29
182	601975	招商南油	1,179,600	3,373,656.00	0.29
183	003012	东鹏控股	416,700	3,371,103.00	0.29
184	603010	万盛股份	309,500	3,364,265.00	0.28
185	600789	鲁抗医药	523,200	3,358,944.00	0.28
186	002100	天康生物	405,600	3,346,200.00	0.28
187	603718	海利生物	354,000	3,338,220.00	0.28
188	002044	美年健康	469,200	3,336,012.00	0.28
189	300687	赛意信息	119,600	3,322,488.00	0.28
190	002635	安洁科技	240,300	3,316,140.00	0.28
191	002967	广电计量	164,700	3,308,823.00	0.28
192	002839	张家港行	778,700	3,293,901.00	0.28
193	300298	三诺生物	120,700	3,263,728.00	0.28
194	002436	兴森科技	209,800	3,251,900.00	0.28
195	300068	南都电源	167,600	3,244,736.00	0.27
196	002918	蒙娜丽莎	210,100	3,243,944.00	0.27
197	000034	神州数码	121,100	3,220,049.00	0.27
198	300827	上能电气	89,251	3,217,498.55	0.27
199	002746	仙坛股份	407,200	3,208,736.00	0.27
200	300203	聚光科技	157,300	3,188,471.00	0.27
201	002517	恺英网络	202,000	3,179,480.00	0.27
202	603566	普莱柯	136,600	3,175,950.00	0.27
203	300775	三角防务	94,000	3,175,320.00	0.27
204	002135	东南网架	488,800	3,157,648.00	0.27
205	000875	吉电股份	581,000	3,131,590.00	0.27
206	600986	浙文互联	485,500	3,107,200.00	0.26
207	002088	鲁阳节能	168,300	3,103,452.00	0.26
208	002649	博彦科技	218,000	3,080,340.00	0.26
209	600211	西藏药业	51,200	3,041,280.00	0.26
210	300348	长亮科技	286,400	2,990,016.00	0.25
211	300459	汤姆猫	459,600	2,982,804.00	0.25
212	002807	江阴银行	799,200	2,949,048.00	0.25
213	300443	金雷股份	83,148	2,947,596.60	0.25
214	002545	东方铁塔	414,100	2,923,546.00	0.25
215	300679	电连技术	88,200	2,915,010.00	0.25
216	300973	立高食品	42,200	2,887,324.00	0.24
217	600129	太极集团	47,800	2,843,622.00	0.24
218	300723	一品红	90,400	2,648,720.00	0.22
219	688050	爱博医疗	11,566	2,374,846.78	0.20
220	688083	中望软件	12,735	1,845,174.15	0.16
221	688617	惠泰医疗	4,200	1,569,750.00	0.13
222	688680	海优新材	12,500	1,522,750.00	0.13
223	688023	安恒信息	7,490	1,308,577.90	0.11
224	688356	键凯科技	11,900	1,267,945.00	0.11

225	688133	泰坦科技	11,900	1,013,761.00	0.09
-----	--------	------	--------	--------------	------

### 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	688516	奥特维	69,020	13,003,368.00	1.10
2	603338	浙江鼎力	126,000	7,057,260.00	0.60
3	600481	双良节能	477,000	6,668,460.00	0.56
4	300118	东方日升	241,774	6,196,667.62	0.52
5	300438	鹏辉能源	119,600	5,745,584.00	0.49
6	002518	科士达	130,200	5,209,302.00	0.44
7	000423	东阿阿胶	93,300	4,986,885.00	0.42
8	002463	沪电股份	222,600	4,661,244.00	0.39
9	600416	湘电股份	226,801	4,329,631.09	0.37
10	688520	神州细胞	73,400	4,164,716.00	0.35
11	000823	超声电子	429,100	4,067,868.00	0.34
12	002449	国星光电	455,600	4,050,284.00	0.34
13	002437	誉衡药业	1,822,333	3,899,792.62	0.33
14	300395	菲利华	78,200	3,847,440.00	0.33
15	600995	南网储能	343,500	3,781,935.00	0.32
16	300127	银河磁体	199,700	3,620,561.00	0.31
17	601588	北辰实业	1,781,800	3,617,054.00	0.31
18	300219	鸿利智汇	447,300	3,287,655.00	0.28
19	300487	蓝晓科技	46,650	2,911,893.00	0.25
20	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
21	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
22	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
23	688472	阿特斯	2,171	36,993.84	0.00
24	688361	中科飞测	505	32,658.35	0.00
25	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
26	688458	美芯晟	194	17,607.44	0.00
27	688552	航天南湖	731	17,178.50	0.00
28	688543	国科军工	311	16,498.55	0.00
29	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
30	301332	德尔玛	1,064	14,608.72	0.00
31	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
32	688581	安杰思	121	14,281.63	0.00
33	688570	天玛智控	558	14,134.14	0.00
34	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
35	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
36	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00



37	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
38	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
39	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
40	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
41	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
42	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
43	001324	长青科技	114	2,234.40	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688516	奥特维	29,059,139.01	2.46
2	600305	恒顺醋业	22,082,332.96	1.87
3	600578	京能电力	21,980,639.00	1.86
4	603328	依顿电子	19,333,084.00	1.64
5	000426	兴业银锡	18,732,439.40	1.59
6	600285	羚锐制药	18,599,841.00	1.57
7	002815	崇达技术	17,802,997.00	1.51
8	002402	和而泰	16,971,148.52	1.44
9	688166	博瑞医药	16,670,092.21	1.41
10	688100	威胜信息	16,532,906.75	1.40
11	002597	金禾实业	16,398,475.00	1.39
12	688556	高测股份	16,276,483.51	1.38
13	002258	利尔化学	16,202,766.00	1.37
14	688106	金宏气体	16,056,486.30	1.36
15	600645	中源协和	15,838,442.38	1.34
16	600908	无锡银行	15,794,159.00	1.34
17	002545	东方铁塔	15,730,844.00	1.33
18	002158	汉钟精机	15,698,492.79	1.33
19	603236	移远通信	15,676,863.80	1.33
20	600993	马应龙	15,673,919.20	1.33

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	688106	金宏气体	17,107,480.65	1.45
2	600993	马应龙	16,789,428.57	1.42
3	688166	博瑞医药	16,481,260.67	1.40
4	600103	青山纸业	16,104,597.80	1.36
5	600305	恒顺醋业	15,739,263.00	1.33
6	688516	奥特维	15,617,108.17	1.32
7	600578	京能电力	15,520,163.15	1.31
8	603876	鼎胜新材	14,322,694.67	1.21
9	603328	依顿电子	14,156,943.86	1.20
10	600285	羚锐制药	14,089,039.00	1.19
11	605009	豪悦护理	14,033,809.28	1.19
12	600267	海正药业	13,640,121.00	1.15
13	600125	铁龙物流	13,378,777.09	1.13
14	688100	威胜信息	13,194,492.28	1.12
15	601702	华峰铝业	12,108,849.00	1.03
16	688707	振华新材	12,031,528.01	1.02
17	600797	浙大网新	12,012,784.18	1.02
18	603959	百利科技	11,664,204.92	0.99
19	603489	八方股份	11,198,512.00	0.95
20	600017	日照港	11,037,831.00	0.93

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,685,650,346.37
卖出股票的收入（成交）总额	1,317,792,203.89

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 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。

### 7.11 投资组合报告附注

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

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

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,964,960.51
2	应收清算款	13,650,820.77
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	15,615,781.28

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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

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
5,194	236,520.82	815,119,770.00	66.35%	413,369,386.00	33.65%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	250,656,685.00	20.40%
2	中信建投证券—建设银行—中信建投建信 1 号集合资产管理计划	80,000,000.00	6.51%
3	中信证券股份有限公司	75,810,863.00	6.17%
4	光大证券股份有限公司	60,463,424.00	4.92%
5	方正证券股份有限公司	54,608,571.00	4.45%
6	安信证券股份有限公司	33,454,900.00	2.72%
7	华泰证券股份有限公司	30,800,000.00	2.51%
7	广发证券股份有限公司	30,800,000.00	2.51%
9	长城证券股份有限公司	30,214,400.00	2.46%
10	兴业证券股份有限公司	20,987,203.00	1.71%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 2 月 9 日）基金份额总额	1,458,089,156.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	817,600,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,047,200,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,228,489,156.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人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	
海通证券	4	4,000,784,055.23	100.00%	2,150,520.75	100.00%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

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

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
海通证券	1,426,329.47	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》	2023-02-10
2	国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	公司官网	2023-02-17
3	国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购与赎回业务并调整最小申购赎回单位的公告	《中国证券报》	2023-02-17
4	关于国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	《中国证券报》	2023-02-22
5	国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	《中国证券报》	2023-02-22
6	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	《中国证券报》	2023-04-26

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年06月29日至2023年06月30日	-	323,268,228.00	72,611,543.00	250,656,685.00	20.40%
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、关于准予国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 1000 增强策略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

### 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