

国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告
2025 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：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	12
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
5 托管人报告	12
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
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
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	39
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
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	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.11 投资组合报告附注	54
8 基金份额持有人信息	55

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
9	开放式基金份额变动	57
10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	59
11	备查文件目录	59
11.1	备查文件目录	59
11.2	存放地点	59
11.3	查阅方式	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF
基金主代码	159338
交易代码	159338
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,016,086,664.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照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。 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、金融衍生品投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 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。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其

	风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
--	-------------------------------

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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李昇	李双均
	联系电话	021-31081600转	025-83387812
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95597
传真		021-31081800	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路228号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		200082	210009
法定代表人		周向勇	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

2.5 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-68,439.95
本期利润	461,867,963.38
加权平均基金份额本期利润	0.0183
本期加权平均净值利润率	1.94%
本期基金份额净值增长率	1.66%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-577,986,341.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0304
期末基金资产净值	18,438,100,322.33
期末基金份额净值	0.9696
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.04%

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 2024 年 9 月 26 日，截至 2025 年 6 月 30 日本基金成立尚未满一年。

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	3.56%	0.59%	2.82%	0.60%	0.74%	-0.01%
过去三个月	1.91%	1.19%	0.84%	1.20%	1.07%	-0.01%
过去六个月	1.66%	1.10%	0.47%	1.10%	1.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	-3.04%	1.26%	17.60%	1.58%	-20.64%	-0.32%

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 A500 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
 （2024 年 9 月 26 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：(1)本基金合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，截至 2025 年 6 月 30 日本基金成立尚未满一年。

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 280 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		
黄岳	国泰中证生物医药 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF、国泰中证科创创业 50ETF、国泰中证 500ETF、国泰中证消费电子主题 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证光伏产业 ETF、国泰策略价值灵活配置混合、国泰中证 A500ETF 的基金经理	2024-09-26	-	10 年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 2 月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月至 2023 年 9 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 4 月任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月至 2024 年 10 月任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月至 2025 年 2 月任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 11 月任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 4 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数

					证券投资基金和国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月至 2024 年 6 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金和国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理

的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场宽幅震荡。一季度 A 股下跌后出现反弹。元旦后市场持续回落，1 月中旬上证指数下跌至 3140 点，随后开始反弹。春节期间，DeepSeek、机器人、哪吒等话题充斥了朋友圈，引发了广泛关注，大大提升了投资者信心。

春节后，科技成长板块引领市场大幅反弹，民营企业座谈会、互联网巨头对今年资本开支的积极展望进一步增强了投资者信心，科技成长板块行情持续至 2 月下旬。

3 月伴随着两会前后一系列刺激内需政策的出台，消费板块接棒科技板块带动市场反弹。3 月下旬市场进入调整，避险情绪有所升温，红利板块重新获得资金关注。

二季度 A 股探底回升。4 月初，美国对全球主要国家大幅加征关税，风险资产大幅下跌，4 月 7 日上证指数单日跌幅超过 7%，下探至 3040 点。此后，随着国家一系列强有力稳定市场措施的实施，市场快速探底回升。

随着中美经贸团队先后于日内瓦、伦敦进行经贸磋商，双方暂缓执行了大部分加征的关税。二季度出口虽然受到关税冲击，但表现出了较强的韧性。依靠消费品以旧换新补贴，二季度社零增速较强，与出口共同支撑，二季度仍然维持了较强的经济增长。

权益市场方面，二季度以银行为代表的红利方向与微盘股方向整体表现较好，成长方向上创新药与通信设备表现较强。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 1.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 A500ETF 跟踪中证 A500 指数，覆盖了 A 股 500 家龙头上市公司。相比现有跟踪大盘股的宽基指数，中证 A500 指数的编制规则更加合理，行业分布更加均衡，能够更好的表征 A 股核心资产的整体表现，具备较好的长期配置价值。

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人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2025 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	77,483,867.56	83,733,883.37
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	18,424,032,539.49	28,132,259,481.80
其中：股票投资		18,424,032,539.49	28,132,259,481.80
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		2,206,754.13	425,796.06
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		18,503,723,161.18	28,216,419,161.23
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,414,178.21	3,582,825.17
应付托管费		804,726.08	1,194,275.07
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	62,403,934.56	59,633,569.28
负债合计		65,622,838.85	64,410,669.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	19,016,086,664.00	29,516,086,664.00
未分配利润	6.4.7.8	-577,986,341.67	-1,364,078,172.29
净资产合计		18,438,100,322.33	28,152,008,491.71
负债和净资产总计		18,503,723,161.18	28,216,419,161.23

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9696 元，基金份额总额 19,016,086,664.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		485,766,238.40
1.利息收入		55,329.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	55,329.45
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,479,879.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-267,846,105.43
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	258,366,226.08
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.14	461,936,403.33

填列)		
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	33,254,384.97
减：二、营业总支出		23,898,275.02
1. 管理人报酬		17,850,066.00
2. 托管费		5,950,021.95
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		-
8. 其他费用	6.4.7.16	98,187.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		461,867,963.38
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		461,867,963.38
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		461,867,963.38

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，因此无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	29,516,086,664.00	-1,364,078,172.29	28,152,008,491.71
二、本期期初净资产	29,516,086,664.00	-1,364,078,172.29	28,152,008,491.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,500,000,000.00	786,091,830.62	-9,713,908,169.38
（一）、综合收益总额	-	461,867,963.38	461,867,963.38
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-10,500,000,000.00	324,223,867.24	-10,175,776,132.76

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	9,567,000,000.00	-697,358,300.95	8,869,641,699.05
2.基金赎回款	-20,067,000,000.00	1,021,582,168.19	-19,045,417,831.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	19,016,086,664.00	-577,986,341.67	18,438,100,322.33

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 26 日，因此无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰中证 A500 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[2024]1270 号《关于准予国泰中证 A500 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 A500 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 2,000,000,515.00 元，基金合同于 2024 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,086,664.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,149.00 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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2024]第 831 号文审核同意，本基金 2,000,086,664.00 份基金份额于 2024 年 10 月 15 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 A500 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、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 A500 指数收益率。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“国泰中证 A500ETF 发起联接”)。国泰中证 A500ETF 发起联接为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2025 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对证券投资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，股权的股息、

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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,173,791.35
等于：本金	1,173,333.25
加：应计利息	458.10
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	76,310,076.21
等于：本金	76,308,703.35
加：应计利息	1,372.86
合计	77,483,867.56

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		18,367,568,730.76	-	18,424,032,539.49	56,463,808.73
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		18,367,568,730.76	-	18,424,032,539.49	56,463,808.73

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

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,187.07
其他应付款	512,532.44
应付替代款	61,793,215.05
合计	62,403,934.56

注：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。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,516,086,664.00	29,516,086,664.00
本期申购	9,567,000,000.00	9,567,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-20,067,000,000.00	-20,067,000,000.00
本期末	19,016,086,664.00	19,016,086,664.00

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	407,822,665.00	-1,771,900,837.29	-1,364,078,172.29
本期期初	407,822,665.00	-1,771,900,837.29	-1,364,078,172.29

本期利润	-68,439.95	461,936,403.33	461,867,963.38
本期基金份额交易产生的变动数	-121,683,603.06	445,907,470.30	324,223,867.24
其中：基金申购款	127,822,987.36	-825,181,288.31	-697,358,300.95
基金赎回款	-249,506,590.42	1,271,088,758.61	1,021,582,168.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	286,070,621.99	-864,056,963.66	-577,986,341.67

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,053.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	46,276.30
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	55,329.45

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-167,914,068.61
股票投资收益——赎回差价收入	-99,932,036.82
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	-267,846,105.43

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,221,587,632.89
减：卖出股票成本总额	12,378,646,242.34
减：交易费用	10,855,459.16
买卖股票差价收入	-167,914,068.61

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	19,045,417,831.81
减：现金支付赎回款总额	10,965,501,271.81
减：赎回股票成本总额	8,179,848,596.82
减：交易费用	-
赎回差价收入	-99,932,036.82

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	258,366,226.08
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	258,366,226.08

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	461,936,403.33
——股票投资	461,936,403.33
——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	461,936,403.33

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	33,254,384.97
合计	33,254,384.97

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	38,679.70
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	98,187.07

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
国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰中证 A500ETF 发起联接 ”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	18,976,317,275.99	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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			
	2025年1月1日至2025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
华泰证券	3,527,852.20	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费等手续费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,850,066.00

其中：应支付销售机构的客户维护费	2,826,309.68
应支付基金管理人的净管理费	15,023,756.32

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,950,021.95

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰中证 A500ETF 发起联接	1,189,938,800.00	6.26%	1,743,000,000.00	5.91%
华泰证券股份有限公司	521,727,637.00	2.74%	710,490,394.00	2.41%

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券	1,173,791.35	9,053.15

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰证券保管，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

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月以上	新股锁定流通受限	47.27	124.16	573.00	27,085.71	71,143.68	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月以上	新股锁定流通受限	46.50	42.85	724.00	33,666.00	31,023.40	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月以上	新股锁定	27.50	56.19	397.00	10,917.50	22,307.43	-

				流通受限						
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	93.50	90.66	166.00	15,521.00	15,049.56	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内(含)	网下中签流通受限	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.60	82.50	143.00	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.80	33.85	342.00	4,035.60	11,576.70	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.92	45.22	241.00	9,620.72	10,898.02	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月以上	新股锁定流通	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-

				受限						
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	41.90	77.87	130.00	5,447.00	10,123.10	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	7.40	20.21	366.00	2,708.40	7,396.86	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6 个月 (含)	送股	-	45.22	108.00	-	4,883.76	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
60327	永杰	2025-0	6 个月	新股	20.60	35.08	126.00	2,595.	4,420.	-

1	新材	3-04	以上	锁定 流通 受限				60	08	
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6 个月 (含)	送股	-	77.87	52.00	-	4,049.24	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月以上	新股 锁定 流通	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-

				受限						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。此外，证券投资基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

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

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华泰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 2025 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2025 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%。

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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	77,483,867.56	-	-	-	77,483,867.56
交易性金融资产	-	-	-	18,424,032,539.49	18,424,032,539.49
应收清算款	-	-	-	2,206,754.13	2,206,754.13
资产总计	77,483,867.56	-	-	18,426,239,293.62	18,503,723,161.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,414,178.21	2,414,178.21
应付托管费	-	-	-	804,726.08	804,726.08
其他负债	-	-	-	62,403,934.56	62,403,934.56
负债总计	-	-	-	65,622,838.85	65,622,838.85
利率敏感度缺口	77,483,867.56	-	-	18,360,616,454.77	18,438,100,322.33
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	83,733,883.37	-	-	-	83,733,883.37
交易性金融资产	-	-	-	28,132,259,481.80	28,132,259,481.80
应收清算款	-	-	-	425,796.06	425,796.06
资产总计	83,733,883.37	-	-	28,132,685,277.86	28,216,419,161.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,582,825.17	3,582,825.17
应付托管费	-	-	-	1,194,275.07	1,194,275.07
其他负债	-	-	-	59,633,569.28	59,633,569.28
负债总计	-	-	-	64,410,669.52	64,410,669.52
利率敏感度缺口	83,733,883.37	-	-	28,068,274,608.34	28,152,008,491.71

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 2025 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%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2024 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，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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	18,424,032,539.49	99.92	28,132,259,481.80	99.93
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	-	-	-	-

合计	18,424,032,539.49	99.92	28,132,259,481.80	99.93
----	-------------------	-------	-------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	18,423,603,067.31	28,090,723,868.50
第二层次	15,385.54	41,503,748.50
第三层次	414,086.64	31,864.80
合计	18,424,032,539.49	28,132,259,481.80

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 2025 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(2024 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 8,869,641,699.05 元，其中包括以股票支付的申购款 3,631,645,996.84 元和以现金支付的申购款 5,237,995,702.21 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	18,424,032,539.49	99.57
	其中：股票	18,424,032,539.49	99.57
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	77,483,867.56	0.42
8	其他各项资产	2,206,754.13	0.01
9	合计	18,503,723,161.18	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	101,139,270.75	0.55
B	采矿业	928,404,956.27	5.04
C	制造业	10,705,076,105.82	58.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	566,693,432.00	3.07
E	建筑业	348,950,401.40	1.89
F	批发和零售业	129,579,848.71	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	641,645,235.77	3.48
H	住宿和餐饮业	15,485,271.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,230,815,051.80	6.68
J	金融业	2,975,476,111.27	16.14
K	房地产业	192,021,691.94	1.04
L	租赁和商务服务业	205,413,078.60	1.11
M	科学研究和技术服务业	203,921,020.10	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	39,958,315.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,116,988.00	0.07
Q	卫生和社会工作	69,082,374.32	0.37
R	文化、体育和娱乐业	57,747,495.50	0.31
S	综合	-	-
	合计	18,423,526,648.25	99.92

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	456,936.59	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	237.06	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	31,974.23	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	14,499.36	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	505,891.24	0.00

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	600519	贵州茅台	496,857	700,329,878.64	3.80
2	300750	宁德时代	2,117,725	534,132,599.50	2.90
3	601318	中国平安	8,585,547	476,326,147.56	2.58
4	600036	招商银行	9,879,300	453,953,835.00	2.46
5	601166	兴业银行	13,299,436	310,408,836.24	1.68
6	600900	长江电力	9,796,600	295,269,524.00	1.60
7	000333	美的集团	3,946,298	284,922,715.60	1.55

8	601899	紫金矿业	13,163,400	256,686,300.00	1.39
9	002594	比亚迪	732,600	243,157,266.00	1.32
10	300059	东方财富	10,111,141	233,870,691.33	1.27
11	600030	中信证券	7,825,805	216,148,734.10	1.17
12	601398	工商银行	28,047,200	212,878,248.00	1.15
13	000858	五 粮 液	1,582,700	188,183,030.00	1.02
14	600276	恒瑞医药	3,557,700	184,644,630.00	1.00
15	601328	交通银行	21,297,240	170,377,920.00	0.92
16	000651	格力电器	3,570,812	160,400,875.04	0.87
17	601288	农业银行	25,550,500	150,236,940.00	0.81
18	002475	立讯精密	4,081,250	141,578,562.50	0.77
19	600887	伊利股份	5,058,800	141,039,344.00	0.76
20	600919	江苏银行	11,716,700	139,897,398.00	0.76
21	603259	药明康德	2,009,510	139,761,420.50	0.76
22	688981	中芯国际	1,576,800	139,026,456.00	0.75
23	601816	京沪高铁	23,481,600	135,019,200.00	0.73
24	600000	浦发银行	9,381,366	130,213,360.08	0.71
25	000725	京东方 A	29,381,200	117,230,988.00	0.64
26	300760	迈瑞医疗	478,800	107,610,300.00	0.58
27	601088	中国神华	2,647,600	107,333,704.00	0.58
28	002371	北方华创	242,466	107,220,889.86	0.58
29	300308	中际旭创	718,000	104,727,480.00	0.57
30	688256	寒武纪	172,601	103,819,501.50	0.56
31	601601	中国太保	2,756,100	103,381,311.00	0.56
32	300502	新易盛	808,280	102,667,725.60	0.56
33	688041	海光信息	723,791	102,264,430.39	0.55
34	300124	汇川技术	1,527,794	98,649,658.58	0.54
35	601728	中国电信	12,396,400	96,072,100.00	0.52
36	601668	中国建筑	16,527,600	95,364,252.00	0.52
37	002352	顺丰控股	1,929,400	94,077,544.00	0.51
38	000001	平安银行	7,775,700	93,852,699.00	0.51
39	002714	牧原股份	2,210,575	92,866,255.75	0.50
40	002230	科大讯飞	1,847,800	88,472,664.00	0.48
41	601127	赛力斯	655,000	87,979,600.00	0.48
42	603501	豪威集团	685,724	87,532,668.60	0.47
43	600031	三一重工	4,726,000	84,831,700.00	0.46
44	000063	中兴通讯	2,581,500	83,872,935.00	0.45
45	600309	万华化学	1,528,600	82,941,836.00	0.45
46	600941	中国移动	730,100	82,172,755.00	0.45
47	603019	中科曙光	1,165,000	82,016,000.00	0.44
48	002415	海康威视	2,941,750	81,574,727.50	0.44
49	300274	阳光电源	1,155,120	78,282,482.40	0.42
50	601857	中国石油	9,084,300	77,670,765.00	0.42
51	601919	中远海控	5,041,000	75,816,640.00	0.41

52	600690	海尔智家	2,990,900	74,114,502.00	0.40
53	688008	澜起科技	901,600	73,931,200.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	1,283,100	73,149,531.00	0.40
55	601012	隆基绿能	4,833,500	72,599,170.00	0.39
56	600406	国电南瑞	3,216,481	72,081,339.21	0.39
57	601766	中国中车	9,747,100	68,619,584.00	0.37
58	600050	中国联通	12,489,100	66,691,794.00	0.36
59	603986	兆易创新	526,600	66,630,698.00	0.36
60	000338	潍柴动力	4,324,800	66,515,424.00	0.36
61	000568	泸州老窖	586,100	66,463,740.00	0.36
62	688012	中微公司	361,790	65,954,317.00	0.36
63	600028	中国石化	11,686,840	65,913,777.60	0.36
64	000100	TCL 科技	15,004,746	64,970,550.18	0.35
65	601988	中国银行	11,434,500	64,261,890.00	0.35
66	300476	胜宏科技	476,800	64,072,384.00	0.35
67	601006	大秦铁路	9,691,000	63,960,600.00	0.35
68	601985	中国核电	6,603,100	61,540,892.00	0.33
69	601225	陕西煤业	3,096,100	59,568,964.00	0.32
70	600104	上汽集团	3,694,800	59,301,540.00	0.32
71	002027	分众传媒	8,073,100	58,933,630.00	0.32
72	600150	中国船舶	1,781,800	57,979,772.00	0.31
73	605499	东鹏饮料	181,460	56,987,513.00	0.31
74	688111	金山办公	202,031	56,578,781.55	0.31
75	600418	江淮汽车	1,406,100	56,370,549.00	0.31
76	601628	中国人寿	1,338,500	55,132,815.00	0.30
77	688271	联影医疗	431,296	55,093,751.04	0.30
78	600760	中航沈飞	904,160	53,001,859.20	0.29
79	600436	片仔癀	263,100	52,622,631.00	0.29
80	603288	海天味业	1,340,500	52,158,855.00	0.28
81	000425	徐工机械	6,600,200	51,283,554.00	0.28
82	300033	同花顺	187,600	51,216,676.00	0.28
83	000625	长安汽车	3,985,549	50,855,605.24	0.28
84	600111	北方稀土	2,035,300	50,678,970.00	0.27
85	000792	盐湖股份	2,950,734	50,398,536.72	0.27
86	600938	中国海油	1,914,500	49,987,595.00	0.27
87	600905	三峡能源	11,449,800	48,776,148.00	0.26
88	601658	邮储银行	8,882,000	48,584,540.00	0.26
89	600089	特变电工	4,063,500	48,477,555.00	0.26
90	601888	中国中免	794,200	48,422,374.00	0.26
91	002625	光启技术	1,202,200	48,063,956.00	0.26
92	603993	洛阳钼业	5,612,900	47,260,618.00	0.26
93	002050	三花智控	1,784,400	47,072,472.00	0.26
94	600547	山东黄金	1,461,700	46,672,081.00	0.25
95	600048	保利发展	5,749,000	46,566,900.00	0.25

96	300015	爱尔眼科	3,723,211	46,465,673.28	0.25
97	600019	宝钢股份	7,013,600	46,219,624.00	0.25
98	601390	中国中铁	8,210,200	46,059,222.00	0.25
99	600415	小商品城	2,219,600	45,901,328.00	0.25
100	002241	歌尔股份	1,959,900	45,704,868.00	0.25
101	002463	沪电股份	1,068,400	45,492,472.00	0.25
102	601600	中国铝业	6,341,300	44,642,752.00	0.24
103	300014	亿纬锂能	970,000	44,435,700.00	0.24
104	000977	浪潮信息	841,556	42,818,369.28	0.23
105	601989	中国重工	9,138,900	42,404,496.00	0.23
106	600585	海螺水泥	1,921,300	41,250,311.00	0.22
107	002384	东山精密	1,083,600	40,927,572.00	0.22
108	600893	航发动力	1,057,100	40,740,634.00	0.22
109	002179	中航光电	1,005,993	40,601,877.48	0.22
110	600570	恒生电子	1,206,500	40,466,010.00	0.22
111	000538	云南白药	720,984	40,223,697.36	0.22
112	603799	华友钴业	1,080,700	40,007,514.00	0.22
113	000988	华工科技	819,702	38,534,191.02	0.21
114	600584	长电科技	1,138,800	38,366,172.00	0.21
115	000938	紫光股份	1,588,097	38,098,447.03	0.21
116	601727	上海电气	5,067,500	37,448,825.00	0.20
117	600438	通威股份	2,184,200	36,585,350.00	0.20
118	002028	思源电气	492,300	35,893,593.00	0.19
119	300408	三环集团	1,064,400	35,550,960.00	0.19
120	002049	紫光国微	539,500	35,531,470.00	0.19
121	300433	蓝思科技	1,580,700	35,249,610.00	0.19
122	000002	万 科 A	5,426,707	34,839,458.94	0.19
123	600795	国电电力	7,148,200	34,597,288.00	0.19
124	600489	中金黄金	2,315,124	33,870,264.12	0.18
125	601669	中国电建	6,882,400	33,517,288.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	1,336,700	33,257,096.00	0.18
127	601689	拓普集团	700,600	33,103,350.00	0.18
128	002422	科伦药业	915,100	32,870,392.00	0.18
129	300339	润和软件	637,400	32,399,042.00	0.18
130	600010	包钢股份	18,089,600	32,380,384.00	0.18
131	688036	传音控股	397,832	31,707,210.40	0.17
132	002456	欧菲光	2,675,200	31,701,120.00	0.17
133	002460	赣锋锂业	927,960	31,337,209.20	0.17
134	600009	上海机场	983,900	31,258,503.00	0.17
135	600160	巨化股份	1,071,300	30,724,884.00	0.17
136	601100	恒立液压	420,950	30,308,400.00	0.16
137	000768	中航西飞	1,104,924	30,208,622.16	0.16
138	601186	中国铁建	3,670,200	29,398,302.00	0.16
139	002252	上海莱士	4,234,840	29,093,350.80	0.16

140	300394	天孚通信	363,136	28,992,778.24	0.16
141	600183	生益科技	959,400	28,925,910.00	0.16
142	000157	中联重科	3,988,800	28,839,024.00	0.16
143	601360	三六零	2,823,500	28,799,700.00	0.16
144	002074	国轩高科	886,800	28,785,528.00	0.16
145	600839	四川长虹	2,941,500	28,591,380.00	0.16
146	000963	华东医药	707,700	28,562,772.00	0.15
147	600886	国投电力	1,922,700	28,340,598.00	0.15
148	600989	宝丰能源	1,751,800	28,274,052.00	0.15
149	688169	石头科技	180,594	28,271,990.70	0.15
150	601058	赛轮轮胎	2,122,500	27,847,200.00	0.15
151	600115	中国东航	6,833,700	27,539,811.00	0.15
152	300442	润泽科技	546,900	27,087,957.00	0.15
153	002466	天齐锂业	844,600	27,060,984.00	0.15
154	000408	藏格矿业	627,514	26,776,022.38	0.15
155	002517	恺英网络	1,376,200	26,574,422.00	0.14
156	000807	云铝股份	1,653,257	26,419,046.86	0.14
157	600066	宇通客车	1,053,500	26,190,010.00	0.14
158	002340	格林美	4,113,000	26,117,550.00	0.14
159	002001	新 和 成	1,225,828	26,073,361.56	0.14
160	600426	华鲁恒升	1,184,030	25,657,930.10	0.14
161	002195	岩山科技	4,554,595	25,642,369.85	0.14
162	688608	恒玄科技	73,300	25,506,934.00	0.14
163	600674	川投能源	1,586,100	25,441,044.00	0.14
164	601800	中国交建	2,859,900	25,424,511.00	0.14
165	600029	南方航空	4,301,000	25,375,900.00	0.14
166	000975	山金国际	1,338,600	25,353,084.00	0.14
167	002558	巨人网络	1,075,100	25,318,605.00	0.14
168	001979	招商蛇口	2,884,700	25,298,819.00	0.14
169	600196	复星医药	1,006,100	25,243,049.00	0.14
170	688213	思特威-W	245,400	25,084,788.00	0.14
171	002916	深南电路	232,610	25,077,684.10	0.14
172	600011	华能国际	3,502,900	25,010,706.00	0.14
173	002236	大华股份	1,569,430	24,922,548.40	0.14
174	688126	沪硅产业	1,323,118	24,768,768.96	0.13
175	301236	软通动力	450,300	24,604,392.00	0.13
176	002156	通富微电	958,939	24,568,017.18	0.13
177	000661	长春高新	247,300	24,527,214.00	0.13
178	300661	圣邦股份	335,089	24,384,426.53	0.13
179	688120	华海清科	144,501	24,377,318.70	0.13
180	600487	亨通光电	1,593,200	24,375,960.00	0.13
181	600346	恒力石化	1,678,800	23,939,688.00	0.13
182	300418	昆仑万维	709,167	23,849,286.21	0.13
183	600460	士兰微	958,769	23,796,646.58	0.13

184	300251	光线传媒	1,168,000	23,675,360.00	0.13
185	300207	欣旺达	1,176,100	23,592,566.00	0.13
186	601111	中国国航	2,986,900	23,566,641.00	0.13
187	601021	春秋航空	423,400	23,562,210.00	0.13
188	600745	闻泰科技	702,600	23,558,178.00	0.13
189	002648	卫星化学	1,354,497	23,473,433.01	0.13
190	688235	百济神州	100,400	23,457,456.00	0.13
191	600372	中航机载	1,938,467	23,377,912.02	0.13
192	000066	中国长城	1,573,600	23,289,280.00	0.13
193	601868	中国能建	10,394,200	23,179,066.00	0.13
194	300896	爱美客	131,974	23,070,374.94	0.13
195	003816	中国广核	6,288,900	22,891,596.00	0.12
196	302132	中航成飞	256,800	22,582,992.00	0.12
197	601117	中国化学	2,918,600	22,385,662.00	0.12
198	300450	先导智能	899,000	22,340,150.00	0.12
199	600879	航天电子	2,130,300	22,304,241.00	0.12
200	601168	西部矿业	1,340,400	22,290,852.00	0.12
201	601319	中国人保	2,557,400	22,274,954.00	0.12
202	600741	华域汽车	1,260,400	22,246,060.00	0.12
203	600096	云天化	1,010,200	22,194,094.00	0.12
204	688002	睿创微纳	318,213	22,185,810.36	0.12
205	002273	水晶光电	1,105,000	22,066,850.00	0.12
206	002465	海格通信	1,574,400	21,947,136.00	0.12
207	688617	惠泰医疗	73,851	21,933,747.00	0.12
208	600176	中国巨石	1,923,100	21,923,340.00	0.12
209	000786	北新建材	826,900	21,896,312.00	0.12
210	688396	华润微	463,168	21,843,002.88	0.12
211	600256	广汇能源	3,625,500	21,825,510.00	0.12
212	600588	用友网络	1,627,900	21,765,023.00	0.12
213	002601	龙佰集团	1,342,400	21,760,304.00	0.12
214	300347	泰格医药	404,630	21,574,871.60	0.12
215	688777	中控技术	477,858	21,460,602.78	0.12
216	600885	宏发股份	959,660	21,410,014.60	0.12
217	000831	中国稀土	591,800	21,375,816.00	0.12
218	002555	三七互娱	1,236,093	21,372,047.97	0.12
219	600482	中国动力	925,200	21,344,364.00	0.12
220	600352	浙江龙盛	2,098,300	21,318,728.00	0.12
221	600219	南山铝业	5,562,300	21,303,609.00	0.12
222	601633	长城汽车	987,038	21,201,576.24	0.11
223	002920	德赛西威	206,900	21,130,697.00	0.11
224	300866	安克创新	185,408	21,062,348.80	0.11
225	300017	网宿科技	1,961,400	21,026,208.00	0.11
226	000933	神火股份	1,258,800	20,946,432.00	0.11
227	688099	晶晨股份	293,883	20,868,631.83	0.11

228	600039	四川路桥	2,107,300	20,862,270.00	0.11
229	002185	华天科技	2,064,200	20,848,420.00	0.11
230	002294	信立泰	438,449	20,751,791.17	0.11
231	688506	百利天恒	70,000	20,728,400.00	0.11
232	688122	西部超导	396,672	20,579,343.36	0.11
233	300782	卓胜微	287,080	20,488,899.60	0.11
234	000630	铜陵有色	6,124,300	20,455,162.00	0.11
235	603129	春风动力	93,200	20,177,800.00	0.11
236	002493	荣盛石化	2,422,087	20,054,880.36	0.11
237	300474	景嘉微	273,500	19,965,500.00	0.11
238	601877	正泰电器	879,900	19,947,333.00	0.11
239	002129	TCL 中环	2,592,053	19,906,967.04	0.11
240	600362	江西铜业	847,800	19,863,954.00	0.11
241	002130	沃尔核材	825,100	19,653,882.00	0.11
242	600085	同仁堂	544,500	19,634,670.00	0.11
243	001965	招商公路	1,624,500	19,494,000.00	0.11
244	002709	天赐材料	1,063,100	19,263,372.00	0.10
245	002131	利欧股份	5,397,600	18,891,600.00	0.10
246	002085	万丰奥威	1,184,300	18,818,527.00	0.10
247	300002	神州泰岳	1,593,934	18,808,421.20	0.10
248	688072	拓荆科技	121,991	18,751,236.61	0.10
249	300058	蓝色光标	2,853,060	18,716,073.60	0.10
250	688047	龙芯中科	139,901	18,661,394.39	0.10
251	002281	光迅科技	377,800	18,633,096.00	0.10
252	002180	纳思达	811,500	18,615,810.00	0.10
253	300122	智飞生物	944,700	18,506,673.00	0.10
254	002738	中矿资源	574,080	18,462,412.80	0.10
255	002532	天山铝业	2,218,200	18,433,242.00	0.10
256	000423	东阿阿胶	350,200	18,315,460.00	0.10
257	688578	艾力斯	196,300	18,263,752.00	0.10
258	002595	豪迈科技	308,200	18,251,604.00	0.10
259	002128	电投能源	920,340	18,204,325.20	0.10
260	002138	顺络电子	646,000	18,165,520.00	0.10
261	002078	太阳纸业	1,347,900	18,142,734.00	0.10
262	002472	双环传动	538,300	18,027,667.00	0.10
263	002436	兴森科技	1,359,148	17,995,119.52	0.10
264	600161	天坛生物	936,880	17,978,727.20	0.10
265	600233	圆通速递	1,388,603	17,899,092.67	0.10
266	002410	广联达	1,326,300	17,785,683.00	0.10
267	000301	东方盛虹	2,134,726	17,782,267.58	0.10
268	300223	北京君正	256,825	17,772,290.00	0.10
269	603392	万泰生物	291,300	17,769,300.00	0.10
270	002938	鹏鼎控股	552,500	17,696,575.00	0.10
271	300136	信维通信	786,700	17,622,080.00	0.10

272	600188	兖矿能源	1,445,475	17,591,430.75	0.10
273	300454	深信服	186,700	17,583,406.00	0.10
274	300759	康龙化成	715,500	17,558,370.00	0.10
275	600862	中航高科	671,700	17,517,936.00	0.10
276	688266	泽璟制药	161,600	17,373,616.00	0.09
277	300346	南大光电	549,040	17,371,625.60	0.09
278	603596	伯特利	328,500	17,308,665.00	0.09
279	600143	金发科技	1,676,800	17,287,808.00	0.09
280	603605	珀莱雅	207,400	17,170,646.00	0.09
281	002065	东华软件	1,788,100	17,165,760.00	0.09
282	300054	鼎龙股份	598,200	17,156,376.00	0.09
283	300832	新产业	302,297	17,146,285.84	0.09
284	601618	中国中冶	5,713,000	17,024,740.00	0.09
285	300024	机器人	990,760	17,021,256.80	0.09
286	002353	杰瑞股份	485,500	16,992,500.00	0.09
287	002223	鱼跃医疗	474,900	16,906,440.00	0.09
288	601615	明阳智能	1,470,400	16,894,896.00	0.09
289	000034	神州数码	447,998	16,862,644.72	0.09
290	002202	金风科技	1,645,000	16,861,250.00	0.09
291	002271	东方雨虹	1,552,250	16,655,642.50	0.09
292	688223	晶科能源	3,204,328	16,630,462.32	0.09
293	000999	华润三九	529,747	16,570,486.16	0.09
294	300395	菲利华	322,900	16,500,190.00	0.09
295	002008	大族激光	676,900	16,496,053.00	0.09
296	603606	东方电缆	318,700	16,479,977.00	0.09
297	600845	宝信软件	696,297	16,446,535.14	0.09
298	603659	璞泰来	874,800	16,428,744.00	0.09
299	300383	光环新网	1,144,200	16,362,060.00	0.09
300	002624	完美世界	1,078,000	16,353,260.00	0.09
301	601872	招商轮船	2,588,000	16,200,880.00	0.09
302	002405	四维图新	1,896,900	16,199,526.00	0.09
303	600515	海南机场	4,575,100	16,195,854.00	0.09
304	600549	厦门钨业	773,600	16,183,712.00	0.09
305	300496	中科创达	281,700	16,118,874.00	0.09
306	002155	湖南黄金	900,096	16,066,713.60	0.09
307	688180	君实生物	467,902	15,899,309.96	0.09
308	300459	汤姆猫	2,837,400	15,889,440.00	0.09
309	600895	张江高科	618,100	15,885,170.00	0.09
310	300012	华测检测	1,353,200	15,818,908.00	0.09
311	002459	晶澳科技	1,574,700	15,715,506.00	0.09
312	601799	星宇股份	124,600	15,575,000.00	0.08
313	000426	兴业银锡	982,800	15,528,240.00	0.08
314	002821	凯莱英	174,300	15,381,975.00	0.08
315	300604	长川科技	342,400	15,377,184.00	0.08

316	300253	卫宁健康	1,429,300	15,150,580.00	0.08
317	603087	甘李药业	275,700	15,102,846.00	0.08
318	688599	天合光能	1,036,299	15,057,424.47	0.08
319	300627	华测导航	429,860	15,045,100.00	0.08
320	601216	君正集团	2,714,800	14,985,696.00	0.08
321	000733	振华科技	298,200	14,924,910.00	0.08
322	605589	圣泉集团	537,400	14,912,850.00	0.08
323	000617	中油资本	2,033,500	14,844,550.00	0.08
324	600332	白云山	558,800	14,729,968.00	0.08
325	000519	中兵红箭	671,500	14,699,135.00	0.08
326	600392	盛和资源	1,114,600	14,679,282.00	0.08
327	000932	华菱钢铁	3,329,100	14,648,040.00	0.08
328	605117	德业股份	276,516	14,561,332.56	0.08
329	600153	建发股份	1,402,900	14,548,073.00	0.08
330	002444	巨星科技	570,143	14,544,347.93	0.08
331	300699	光威复材	458,742	14,528,359.14	0.08
332	603260	合盛硅业	306,100	14,509,140.00	0.08
333	300037	新宙邦	410,300	14,442,560.00	0.08
334	300003	乐普医疗	1,043,600	14,380,808.00	0.08
335	601233	桐昆股份	1,353,700	14,349,220.00	0.08
336	600803	新奥股份	753,100	14,233,590.00	0.08
337	000878	云南铜业	1,114,800	14,180,256.00	0.08
338	002389	航天彩虹	552,600	14,146,560.00	0.08
339	300001	特锐德	588,600	14,108,742.00	0.08
340	002414	高德红外	1,375,480	14,098,670.00	0.08
341	002007	华兰生物	899,100	14,088,897.00	0.08
342	300316	晶盛机电	518,900	14,088,135.00	0.08
343	300142	沃森生物	1,280,400	14,084,400.00	0.08
344	600699	均胜电子	799,500	13,943,280.00	0.08
345	300628	亿联网络	395,500	13,747,580.00	0.07
346	300073	当升科技	312,500	13,709,375.00	0.07
347	600521	华海药业	731,900	13,635,297.00	0.07
348	002409	雅克科技	249,100	13,623,279.00	0.07
349	300568	星源材质	1,065,500	13,510,540.00	0.07
350	600177	雅戈尔	1,844,500	13,464,850.00	0.07
351	002812	恩捷股份	458,500	13,429,465.00	0.07
352	600398	海澜之家	1,922,700	13,381,992.00	0.07
353	300315	掌趣科技	2,200,700	13,358,249.00	0.07
354	600118	中国卫星	466,400	13,325,048.00	0.07
355	603979	金诚信	286,900	13,323,636.00	0.07
356	688188	柏楚电子	100,666	13,253,685.56	0.07
357	601238	广汽集团	1,764,300	13,214,607.00	0.07
358	002152	广电运通	981,800	13,195,392.00	0.07
359	000623	吉林敖东	777,200	13,173,540.00	0.07

360	300757	罗博特科	87,800	13,167,366.00	0.07
361	600704	物产中大	2,488,300	13,113,341.00	0.07
362	000738	航发控制	631,000	13,093,250.00	0.07
363	300413	芒果超媒	596,400	13,013,448.00	0.07
364	600765	中航重机	767,200	12,950,336.00	0.07
365	000009	中国宝安	1,456,842	12,936,756.96	0.07
366	600497	驰宏锌锗	2,436,200	12,887,498.00	0.07
367	002044	美年健康	2,502,188	12,861,246.32	0.07
368	600563	法拉电子	117,800	12,850,802.00	0.07
369	300558	贝达药业	220,200	12,760,590.00	0.07
370	002318	久立特材	543,100	12,703,109.00	0.07
371	600018	上港集团	2,220,300	12,677,913.00	0.07
372	600141	兴发集团	616,300	12,652,639.00	0.07
373	601567	三星医疗	560,900	12,575,378.00	0.07
374	600316	洪都航空	333,200	12,561,640.00	0.07
375	000400	许继电气	567,235	12,348,705.95	0.07
376	600486	扬农化工	212,780	12,341,240.00	0.07
377	000960	锡业股份	804,000	12,301,200.00	0.07
378	002025	航天电器	239,100	12,292,131.00	0.07
379	600038	中直股份	316,400	12,279,484.00	0.07
380	601677	明泰铝业	983,500	12,215,070.00	0.07
381	002245	蔚蓝锂芯	947,600	12,157,708.00	0.07
382	002607	中公教育	3,959,800	12,116,988.00	0.07
383	601607	上海医药	672,600	12,026,088.00	0.07
384	300919	中伟股份	364,903	11,998,010.64	0.07
385	300088	长信科技	2,006,700	11,959,932.00	0.06
386	600637	东方明珠	1,600,600	11,956,482.00	0.06
387	600498	烽火通信	565,200	11,886,156.00	0.06
388	300182	捷成股份	2,151,600	11,855,316.00	0.06
389	000039	中集集团	1,492,192	11,728,629.12	0.06
390	603939	益丰药房	478,717	11,714,204.99	0.06
391	603486	科沃斯	200,700	11,686,761.00	0.06
392	600529	山东药玻	526,200	11,650,068.00	0.06
393	300068	南都电源	726,000	11,557,920.00	0.06
394	002739	万达电影	1,002,750	11,461,432.50	0.06
395	002407	多氟多	939,360	11,450,798.40	0.06
396	600026	中远海能	1,104,400	11,408,452.00	0.06
397	601018	宁波港	3,107,300	11,372,718.00	0.06
398	300724	捷佳伟创	207,400	11,261,820.00	0.06
399	002841	视源股份	322,800	11,168,880.00	0.06
400	000887	中鼎股份	631,700	11,111,603.00	0.06
401	300285	国瓷材料	638,400	11,076,240.00	0.06
402	603806	福斯特	852,900	11,053,584.00	0.06
403	301358	湖南裕能	353,200	11,016,308.00	0.06

404	002497	雅化集团	948,000	10,807,200.00	0.06
405	300144	宋城演艺	1,257,940	10,755,387.00	0.06
406	688009	中国通号	2,084,009	10,711,806.26	0.06
407	002312	川发龙蟒	931,454	10,693,091.92	0.06
408	600820	隧道股份	1,752,500	10,690,250.00	0.06
409	600008	首创环保	3,507,300	10,592,046.00	0.06
410	300296	利亚德	1,726,623	10,532,400.30	0.06
411	600998	九州通	2,027,200	10,419,808.00	0.06
412	002064	华峰化学	1,574,000	10,404,140.00	0.06
413	600516	方大炭素	2,240,500	10,395,920.00	0.06
414	688303	大全能源	487,115	10,385,291.80	0.06
415	300567	精测电子	170,800	10,352,188.00	0.06
416	603568	伟明环保	541,300	10,328,004.00	0.06
417	600166	福田汽车	3,799,700	10,297,187.00	0.06
418	600208	衢州发展	3,440,900	10,185,064.00	0.06
419	600170	上海建工	4,251,560	10,161,228.40	0.06
420	600312	平高电气	656,100	10,097,379.00	0.05
421	300763	锦浪科技	175,500	10,071,945.00	0.05
422	000683	博源化工	2,098,600	10,052,294.00	0.05
423	601155	新城控股	731,400	10,005,552.00	0.05
424	601179	中国西电	1,628,000	9,995,920.00	0.05
425	002176	江特电机	1,373,700	9,973,062.00	0.05
426	603816	顾家家居	385,200	9,830,304.00	0.05
427	605358	立昂微	421,600	9,823,280.00	0.05
428	600763	通策医疗	236,324	9,755,454.72	0.05
429	688005	容百科技	436,437	9,741,273.84	0.05
430	000830	鲁西化工	942,400	9,706,720.00	0.05
431	000708	中信特钢	823,200	9,680,832.00	0.05
432	002244	滨江集团	984,200	9,595,950.00	0.05
433	601000	唐山港	2,360,300	9,582,818.00	0.05
434	603885	吉祥航空	709,900	9,562,353.00	0.05
435	000629	钒钛股份	3,709,948	9,497,466.88	0.05
436	002603	以岭药业	671,300	9,465,330.00	0.05
437	603613	国联股份	394,500	9,345,705.00	0.05
438	000818	航锦科技	414,200	9,319,500.00	0.05
439	600535	天士力	595,200	9,314,880.00	0.05
440	600323	瀚蓝环境	382,000	9,301,700.00	0.05
441	600499	科达制造	946,400	9,274,720.00	0.05
442	002439	启明星辰	578,500	9,250,215.00	0.05
443	300676	华大基因	185,000	9,207,450.00	0.05
444	002432	九安医疗	251,954	9,178,684.22	0.05
445	601880	辽港股份	5,999,500	8,999,250.00	0.05
446	603833	欧派家居	159,416	8,999,033.20	0.05
447	002145	中核钛白	2,152,300	8,932,045.00	0.05

448	600655	豫园股份	1,584,900	8,796,195.00	0.05
449	000563	陕国投 A	2,460,400	8,783,628.00	0.05
450	603000	人民网	434,600	8,783,266.00	0.05
451	600004	白云机场	964,700	8,778,770.00	0.05
452	300390	天华新能	458,300	8,739,781.00	0.05
453	600859	王府井	628,900	8,735,421.00	0.05
454	603077	和邦生物	4,933,700	8,633,975.00	0.05
455	601966	玲珑轮胎	582,600	8,546,742.00	0.05
456	600325	华发股份	1,753,200	8,538,084.00	0.05
457	000547	航天发展	1,012,450	8,504,580.00	0.05
458	300751	迈为股份	121,900	8,479,364.00	0.05
459	600511	国药股份	289,400	8,438,904.00	0.05
460	600131	国网信通	474,200	8,393,340.00	0.05
461	000998	隆平高科	839,900	8,273,015.00	0.04
462	603899	晨光股份	282,100	8,178,079.00	0.04
463	300601	康泰生物	531,660	8,075,915.40	0.04
464	300529	健帆生物	373,700	8,060,709.00	0.04
465	600754	锦江酒店	355,400	7,975,176.00	0.04
466	600867	通化东宝	964,800	7,911,360.00	0.04
467	300070	碧水源	1,730,800	7,788,600.00	0.04
468	002756	永兴材料	244,950	7,777,162.50	0.04
469	601866	中远海发	3,142,400	7,761,728.00	0.04
470	300573	兴齐眼药	149,832	7,759,799.28	0.04
471	002120	韵达股份	1,153,763	7,730,212.10	0.04
472	600667	太极实业	1,174,200	7,726,236.00	0.04
473	600258	首旅酒店	531,500	7,510,095.00	0.04
474	300438	鹏辉能源	268,800	7,421,568.00	0.04
475	002544	普天科技	315,100	7,389,095.00	0.04
476	000069	华侨城 A	3,215,600	7,235,100.00	0.04
477	000032	深桑达 A	353,800	7,157,374.00	0.04
478	300118	东方日升	738,200	7,071,956.00	0.04
479	002508	老板电器	368,100	6,997,581.00	0.04
480	000967	盈峰环境	1,002,700	6,968,765.00	0.04
481	002292	奥飞娱乐	716,600	6,965,352.00	0.04
482	300457	赢合科技	299,500	6,888,500.00	0.04
483	688063	派能科技	149,806	6,753,254.48	0.04
484	603650	彤程新材	209,000	6,719,350.00	0.04
485	002831	裕同科技	285,178	6,678,868.76	0.04
486	002266	浙富控股	2,104,300	6,481,244.00	0.04
487	601636	旗滨集团	1,289,800	6,461,898.00	0.04
488	300769	德方纳米	195,560	6,457,391.20	0.04
489	688390	固德威	148,114	6,435,553.30	0.03
490	600129	太极集团	299,800	6,388,738.00	0.03
491	002572	索菲亚	455,300	6,378,753.00	0.03

492	000035	中国天楹	1,412,300	6,058,767.00	0.03
493	600864	哈投股份	987,300	5,894,181.00	0.03
494	002091	江苏国泰	794,500	5,776,015.00	0.03
495	600315	上海家化	255,400	5,381,278.00	0.03
496	002372	伟星新材	504,100	5,222,476.00	0.03
497	001914	招商积余	328,200	4,059,834.00	0.02
498	600007	中国国贸	175,700	3,615,906.00	0.02
499	600335	国机汽车	472,200	3,045,690.00	0.02
500	301381	赛维时代	104,700	2,088,765.00	0.01

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	001391	国货航	4,751	31,974.23	0.00
4	603049	中策橡胶	740	31,741.48	0.00
5	301275	汉朔科技	463	26,166.45	0.00
6	603202	天有为	257	23,898.40	0.00
7	301662	宏工科技	229	20,898.02	0.00
8	301501	恒鑫生活	444	20,451.98	0.00
9	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
10	301602	超研股份	680	16,872.58	0.00
11	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
12	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
13	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
14	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
15	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
16	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
17	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
18	301173	毓恬冠佳	224	10,144.37	0.00
19	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
20	001382	新亚电缆	460	9,387.78	0.00
21	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
22	301636	泽润新能	173	8,605.68	0.00
23	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
24	603210	泰鸿万立	357	5,949.07	0.00
25	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
26	603120	肯特催化	144	5,656.06	0.00
27	301560	众捷汽车	194	5,355.98	0.00
28	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00

29	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
30	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
31	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
32	603290	斯达半导	40	3,250.80	0.00
33	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
34	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
35	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
36	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
37	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
38	002151	北斗星通	32	918.08	0.00
39	300999	金龙鱼	10	295.30	0.00
40	000591	太阳能	54	237.06	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	600519	贵州茅台	575,540,001.85	2.04
2	601318	中国平安	233,427,214.60	0.83
3	600036	招商银行	215,077,594.67	0.76
4	601166	兴业银行	160,943,869.99	0.57
5	600900	长江电力	149,689,029.14	0.53
6	688041	海光信息	125,198,858.26	0.44
7	601899	紫金矿业	111,044,299.54	0.39
8	600030	中信证券	104,942,829.10	0.37
9	688981	中芯国际	101,283,741.99	0.36
10	601398	工商银行	98,669,638.00	0.35
11	601328	交通银行	95,011,410.00	0.34
12	600276	恒瑞医药	94,434,387.96	0.34
13	002371	北方华创	85,106,403.04	0.30
14	600887	伊利股份	75,465,495.62	0.27
15	601816	京沪高铁	69,818,843.00	0.25
16	601288	农业银行	68,364,899.00	0.24
17	600919	江苏银行	60,640,856.00	0.22
18	688008	澜起科技	58,842,487.69	0.21
19	601988	中国银行	56,445,123.60	0.20
20	603259	药明康德	55,664,826.20	0.20

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	600519	贵州茅台	1,005,416,678.11	3.57
2	601318	中国平安	486,499,934.46	1.73
3	600036	招商银行	458,862,410.36	1.63
4	600900	长江电力	305,136,618.90	1.08
5	601166	兴业银行	265,257,505.75	0.94
6	601899	紫金矿业	242,831,897.66	0.86
7	600030	中信证券	222,069,242.56	0.79
8	601398	工商银行	208,502,196.00	0.74
9	600276	恒瑞医药	192,204,079.74	0.68
10	688041	海光信息	189,915,992.14	0.67
11	688981	中芯国际	188,829,587.06	0.67
12	600887	伊利股份	155,619,166.33	0.55
13	601328	交通银行	153,167,338.90	0.54
14	601816	京沪高铁	144,600,440.00	0.51
15	601288	农业银行	144,488,965.00	0.51
16	601988	中国银行	136,651,011.00	0.49
17	600919	江苏银行	127,637,084.39	0.45
18	603259	药明康德	124,739,187.55	0.44
19	600000	浦发银行	110,688,795.52	0.39
20	601088	中国神华	105,035,800.23	0.37

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	6,756,685,496.68
卖出股票的收入（成交）总额	12,221,587,632.89

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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。

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	2,206,754.13
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	2,206,754.13
---	----	--------------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定
3	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定
4	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	新股锁定

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		中证 A500ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
105,975	179,439.36	11,365,312,882.00	59.77%	6,460,834,982.00	33.98%	1,189,938,800.00	6.26%

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	中国人寿保险股份有限公司	1,332,665,607.00	7.01%
2	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	711,051,470.00	3.74%
3	新华人寿保险股份有限公司	574,947,210.00	3.02%
4	华泰证券股份有限公司	521,727,637.00	2.74%
5	中国人寿再保险有限责任公司	334,439,071.00	1.76%
6	方正证券股份有限公司	314,584,329.00	1.65%
7	中国东方国际资产管理有限公司－客户资产账户	303,876,701.00	1.60%
8	中信建投证券股份有限公司	251,953,593.00	1.32%
9	申万宏源证券有限公司	232,610,365.00	1.22%
10	大家人寿保险股份有限公司－万能产品	207,886,004.00	1.09%
-	国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,189,938,800.00	6.26%

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	338,860.00	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	10~50

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（2024 年 9 月 26 日）基金份额总额	2,000,086,664.00
本报告期期初基金份额总额	29,516,086,664.00
本报告期基金总申购份额	9,567,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,067,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,016,086,664.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 5 月 30 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第三十六次会议审议通过，刘国华女士离任公司督察长，公司总经理李昇代任督察长。

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毕马威华振会计师事务所（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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人

受到稽查或处罚等措施的时间	2025-05-09
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别机制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
华泰证券	6	18,976,317,275.99	100.00%	3,527,852.20	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：

- （1）实力雄厚、信誉良好；
- （2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- （3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；
- （4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

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
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于国泰中证 A500 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	《证券日报》	2025-01-09
2	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	《证券日报》	2025-01-13
3	国泰基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	《证券日报》	2025-01-27
4	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2025-05-30
5	关于国泰中证 A500 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	《证券日报》	2025-06-16

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 关于准予国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 报告期内披露的各项公告
- 法律法规要求备查的其他文件

11.2 存放地点

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

基金托管人住所。

11.3 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

二〇二五年八月三十日