

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
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	12
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	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
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	36
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.11 投资组合报告附注	51
8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
9 开放式基金份额变动	53
10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 国泰
基金主代码	561350
交易代码	561350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	64,700,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	张立学
	联系电话	021-31081600转	010-68858126
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95580
传真		021-31081800	010-86353609
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200082	100808
法定代表人		周向勇	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	19,776,081.08
本期利润	21,219,878.97
加权平均基金份额本期利润	0.2610
本期加权平均净值利润率	20.04%
本期基金份额净值增长率	21.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	27,893,133.74
期末可供分配基金份额利润	0.4311
期末基金资产净值	92,593,133.74
期末基金份额净值	1.4311
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	43.11%

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

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

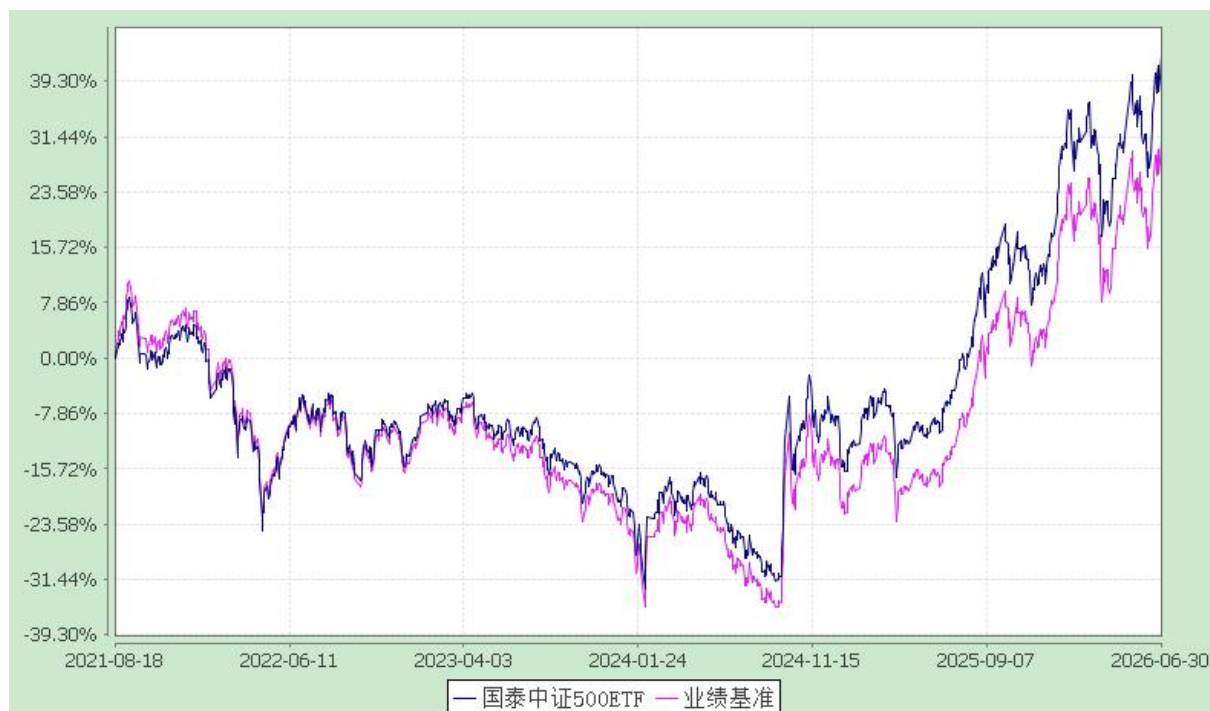
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.17%	1.63%	18.56%	1.65%	0.61%	-0.02%
过去六个月	21.48%	1.64%	20.97%	1.66%	0.51%	-0.02%
过去一年	52.90%	1.40%	52.68%	1.42%	0.22%	-0.02%
过去三年	60.19%	1.46%	50.55%	1.49%	9.64%	-0.03%
自基金合同生效起至今	43.11%	1.34%	31.00%	1.37%	12.11%	-0.03%

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

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 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
 （2021 年 8 月 18 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为 2021 年 8 月 18 日，本基金的建仓期为六个月，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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。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、国泰恒生生物科技 ETF 的基金经理	2021-08-18	-	11 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， 2026 年 1 月起兼任国泰恒生生物 科技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遵规守信情况的说明

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。

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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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

一季度市场大幅波动，1 月上旬商业航天相关板块大幅上涨，带动市场投资热情升温，A 股成交量逼近 4 万亿元，随后随着相关方面不断降温，市场进入震荡格局。贵金属、化工等周期方向 1 月下旬连续大涨后快速回落，引发了市场的剧烈波动。随后随着美国、以色列、伊朗地缘风险升温，霍尔木兹海峡通行几近停滞。3 月中旬全球避险情绪迅速升温，A 股出现大幅调整。整个一季度呈现冲高回落走势。

二季度随着伊朗地缘风险缓和，市场触底回升。经济数据方面，出口延续高增，而消费、地产等方向承压。A 股 5-6 月波动大幅增大，科技和非科技方向走势严重分化，由于目前宽基指数内部科技权重相对较大，上证指数、中证 A500 等指数表现尚可，但全 A 中位数二季度跌幅明显，市场二八分化显著。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 21.48%，同期业绩比较基准收益率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

准确和完整。

6 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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,112,701.42	961,376.34
结算备付金		336,984.91	165,487.75
存出保证金		152,623.62	128,440.30
交易性金融资产	6.4.7.2	91,570,168.29	110,964,613.05
其中：股票投资		91,554,168.08	110,964,613.05
基金投资		-	-
债券投资		16,000.21	-
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		-	296,010.14
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		93,172,478.24	112,515,927.58
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		40,970.90	18,118.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,095.28	46,453.40
应付托管费		7,419.07	9,290.70

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	493,859.25	880,302.47
负债合计		579,344.50	954,164.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	64,700,000.00	94,700,000.00
未分配利润	6.4.7.8	27,893,133.74	16,861,762.63
净资产合计		92,593,133.74	111,561,762.63
负债和净资产总计		93,172,478.24	112,515,927.58

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4311 元，基金份额总额 64,700,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		21,589,667.46	7,989,846.90
1.利息收入		4,723.81	7,486.02
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,723.81	7,486.02
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）		19,935,305.10	3,150,789.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	19,352,926.35	2,121,021.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.21	-
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	582,378.54	1,029,767.97
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,443,797.89	4,634,862.19
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	205,840.66	196,709.09

减：二、营业总支出		369,788.49	431,735.89
1. 管理人报酬		263,503.01	298,585.83
2. 托管费		52,700.59	59,717.19
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	53,584.89	73,432.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,219,878.97	7,558,111.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,219,878.97	7,558,111.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,219,878.97	7,558,111.01

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	94,700,000.00	16,861,762.63	111,561,762.63
二、本期期初净资产	94,700,000.00	16,861,762.63	111,561,762.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-30,000,000.00	11,031,371.11	-18,968,628.89
（一）、综合收益总额	-	21,219,878.97	21,219,878.97
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-30,000,000.00	-10,188,507.86	-40,188,507.86
其中：1.基金申购款	147,000,000.00	44,254,331.00	191,254,331.00

2.基金赎回款	-177,000,000.00	-54,442,838.86	-231,442,838.86
（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	64,700,000.00	27,893,133.74	92,593,133.74
项目	上年度可比期间 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	142,700,000.00	-15,534,463.54	127,165,536.46
二、本期期初净资产	142,700,000.00	-15,534,463.54	127,165,536.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,000,000.00	8,517,639.33	-24,482,360.67
（一）、综合收益总额	-	7,558,111.01	7,558,111.01
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-33,000,000.00	959,528.32	-32,040,471.68
其中：1.基金申购款	288,000,000.00	-31,085,767.25	256,914,232.75
2.基金赎回款	-321,000,000.00	32,045,295.57	-288,954,704.43
（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	109,700,000.00	-7,016,824.21	102,683,175.79

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：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1958 号《关于准予国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 727,700,000.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0821 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 727,700,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]366 号文核准,本基金于 2021 年 9 月 1 日在上交所挂牌交易。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 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》、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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,112,701.42
等于：本金	1,112,571.68
加：应计利息	129.74
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	1,112,701.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	81,887,701.57	-	91,554,168.08	9,666,466.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	16,000.00	0.21	16,000.21	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,000.00	0.21	16,000.21	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		81,903,701.57	0.21	91,570,168.29	9,666,466.51

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

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	21,047.11
其中：交易所市场	21,047.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	53,556.09

可退替代款	21,789.50
应付替代款	397,466.55
合计	493,859.25

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,700,000.00	94,700,000.00
本期申购	147,000,000.00	147,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-177,000,000.00	-177,000,000.00
本期末	64,700,000.00	64,700,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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	18,916,529.62	-2,054,766.99	16,861,762.63
本期期初	18,916,529.62	-2,054,766.99	16,861,762.63
本期利润	19,776,081.08	1,443,797.89	21,219,878.97
本期基金份额交易产生的变动数	-10,335,493.92	146,986.06	-10,188,507.86
其中：基金申购款	46,233,840.55	-1,979,509.55	44,254,331.00
基金赎回款	-56,569,334.47	2,126,495.61	-54,442,838.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,357,116.78	-463,983.04	27,893,133.74

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,943.11
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	531.72
其他	248.98
合计	4,723.81

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,820,570.73
股票投资收益——赎回差价收入	6,532,355.62
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	19,352,926.35

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	138,077,530.24
减：卖出股票成本总额	125,131,902.92
减：交易费用	125,056.59
买卖股票差价收入	12,820,570.73

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	231,442,838.86
减：现金支付赎回款总额	120,745,506.86
减：赎回股票成本总额	104,164,976.38
减：交易费用	-
赎回差价收入	6,532,355.62

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.21

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	582,378.54
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	582,378.54

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,443,797.89
——股票投资	1,443,797.89
——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	1,443,797.89

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 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	205,840.66
合计	205,840.66

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	13,884.51
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
存托服务费	28.80
合计	53,584.89

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、关联关系

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 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	263,503.01	298,585.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,608.82	26,278.57
应支付基金管理人的净管理费	243,894.19	272,307.26

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 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	52,700.59	59,717.19

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间内均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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
邮储银行	1,112,701.42	3,943.11	1,290,815.25	6,094.64

注：本基金的活期银行存款由基金托管人邮储银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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（2026 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
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	22.68	42.16	883.00	20,026.44	37,227.28	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	69.66	160.06	92.00	6,408.72	14,725.52	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-25	1 个月内	配债未上	100.00	100.00	160.00	16,000.00	16,000.21	-

			(含)	市						
--	--	--	-----	---	--	--	--	--	--	--

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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是通过紧密跟踪标的指数，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邮储银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.02%(2025 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 2026 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，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、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	1,112,701.42	-	-	-	1,112,701.42
结算备付金	336,984.91	-	-	-	336,984.91
存出保证金	152,623.62	-	-	-	152,623.62
交易性金融资产	-	-	16,000.21	91,554,168.08	91,570,168.29
资产总计	1,602,309.95	-	16,000.21	91,554,168.08	93,172,478.24
负债					
应付清算款	-	-	-	40,970.90	40,970.90
应付管理人报酬	-	-	-	37,095.28	37,095.28
应付托管费	-	-	-	7,419.07	7,419.07
其他负债	-	-	-	493,859.25	493,859.25
负债总计	-	-	-	579,344.50	579,344.50
利率敏感度缺口	1,602,309.95	-	16,000.21	90,974,823.58	92,593,133.74
上年度末 2025 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	961,376.34	-	-	-	961,376.34
结算备付金	165,487.75	-	-	-	165,487.75
存出保证金	128,440.30	-	-	-	128,440.30
交易性金融资产	-	-	-	110,964,613.05	110,964,613.05
应收清算款	-	-	-	296,010.14	296,010.14
资产总计	1,255,304.39	-	-	111,260,623.19	112,515,927.58
负债					
应付清算款	-	-	-	18,118.38	18,118.38
应付管理人报酬	-	-	-	46,453.40	46,453.40
应付托管费	-	-	-	9,290.70	9,290.70
其他负债	-	-	-	880,302.47	880,302.47
负债总计	-	-	-	954,164.95	954,164.95
利率敏感度缺口	1,255,304.39	-	-	110,306,458.24	111,561,762.63

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 2026 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 0.02%(2025 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（2025 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

项目	本期末		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 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	91,554,168.08	98.88	110,964,613.05	99.46
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	91,554,168.08	98.88	110,964,613.05	99.46
----	---------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 4,560,550.16	增加约 5,437,347.52
	业绩比较基准下降 5%	减少约 4,560,550.16	减少约 5,437,347.52

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	91,502,215.28	110,964,613.05
第二层次	16,000.21	-
第三层次	51,952.80	-
合计	91,570,168.29	110,964,613.05

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 2026 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(2025 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 191,254,331.00 元，其中包括以股票支付的申购款 83,496,168.70 元和以现金支付的申购款 107,758,162.30 元。(于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 256,914,232.75 元，其中包括以股票支付的申购款 127,359,733.95 元和以现金支付的申购款 129,554,498.80 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	91,554,168.08	98.26
	其中：股票	91,554,168.08	98.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,000.21	0.02
	其中：债券	16,000.21	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,449,686.33	1.56
8	其他各项资产	152,623.62	0.16
9	合计	93,172,478.24	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	298,776.00	0.32
B	采矿业	2,818,139.28	3.04
C	制造业	68,705,403.15	74.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,228,107.69	2.41
E	建筑业	539,319.25	0.58
F	批发和零售业	1,760,796.78	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,107,929.60	1.20
H	住宿和餐饮业	64,764.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,020,123.50	6.50
J	金融业	5,019,643.59	5.42
K	房地产业	367,998.08	0.40
L	租赁和商务服务业	934,060.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	675,418.26	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	315,771.78	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	214,630.32	0.23
R	文化、体育和娱乐业	429,218.00	0.46
S	综合	-	-

	合计	91,500,099.28	98.82
--	----	---------------	-------

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	51,952.80	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	51,952.80	0.06

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	688498	源杰科技	900	1,697,400.00	1.83
2	300604	长川科技	3,500	1,194,970.00	1.29
3	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	1.22
4	688347	华虹宏力	3,174	1,067,416.20	1.15
5	688120	华海清科	3,127	1,007,456.86	1.09
6	002008	大族激光	6,700	1,005,737.00	1.09
7	002281	光迅科技	3,900	1,002,066.00	1.08
8	300857	协创数据	2,820	958,518.00	1.04
9	300136	信维通信	7,800	930,150.00	1.00
10	300475	香农芯创	2,700	810,000.00	0.87
11	300223	北京君正	3,200	796,480.00	0.86
12	688361	中科飞测	1,800	774,000.00	0.84
13	002436	兴森科技	13,900	708,205.00	0.76
14	300285	国瓷材料	6,500	670,670.00	0.72
15	300054	鼎龙股份	6,200	657,014.00	0.71
16	600105	永鼎股份	9,600	647,808.00	0.70
17	688200	华峰测控	1,200	630,120.00	0.68
18	300666	江丰电子	1,700	626,620.00	0.68
19	688037	芯源微	1,400	614,670.00	0.66
20	688777	中控技术	5,200	611,000.00	0.66
21	000021	深科技	9,000	578,430.00	0.62
22	688019	安集科技	1,650	560,109.00	0.60
23	002851	麦格米特	3,200	534,976.00	0.58
24	300548	长芯博创	1,900	528,200.00	0.57
25	002409	雅克科技	2,300	516,350.00	0.56
26	300346	南大光电	5,500	509,575.00	0.55
27	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.53
28	601869	长飞光纤	900	491,310.00	0.53
29	600498	烽火通信	6,600	485,760.00	0.52
30	002138	顺络电子	6,600	482,460.00	0.52
31	002407	多氟多	9,600	482,208.00	0.52
32	002185	华天科技	21,600	481,896.00	0.52
33	300567	精测电子	1,500	476,400.00	0.51
34	688017	绿的谐波	1,100	459,646.00	0.50
35	600879	航天电子	21,400	455,606.00	0.49
36	300390	天华新能	4,770	446,042.70	0.48
37	688002	睿创微纳	2,877	445,043.13	0.48
38	688313	仕佳光子	2,400	443,160.00	0.48
39	300395	菲利华	3,300	441,309.00	0.48
40	688469	芯联集成	40,683	431,646.63	0.47
41	301526	国际复材	9,200	429,364.00	0.46

42	688702	盛科通信	1,100	428,989.00	0.46
43	300373	扬杰科技	2,700	424,521.00	0.46
44	300620	光库科技	1,100	416,020.00	0.45
45	002273	水晶光电	11,300	400,924.00	0.43
46	300037	新宙邦	4,300	399,255.00	0.43
47	300058	蓝色光标	29,000	399,040.00	0.43
48	688172	燕东微	4,652	389,186.32	0.42
49	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.42
50	603256	宏和科技	1,400	371,462.00	0.40
51	300751	迈为股份	1,300	367,198.00	0.40
52	605358	立昂微	4,700	364,720.00	0.39
53	600988	赤峰黄金	13,534	356,214.88	0.38
54	688099	晶晨股份	3,345	344,200.50	0.37
55	002126	银轮股份	6,900	343,620.00	0.37
56	605589	圣泉集团	5,400	343,278.00	0.37
57	002738	中矿资源	5,800	342,142.00	0.37
58	600392	盛和资源	11,477	341,670.29	0.37
59	000960	锡业股份	8,000	341,520.00	0.37
60	600601	方正科技	24,300	336,312.00	0.36
61	000831	中国稀土	6,000	332,940.00	0.36
62	600885	宏发股份	9,468	326,551.32	0.35
63	600141	兴发集团	6,900	324,093.00	0.35
64	002812	恩捷股份	4,800	321,168.00	0.35
65	301358	湖南裕能	4,100	311,067.00	0.34
66	601179	中国西电	20,700	308,844.00	0.33
67	001389	广合科技	1,300	308,425.00	0.33
68	600378	昊华科技	4,000	301,520.00	0.33
69	002195	岩山科技	46,000	300,840.00	0.32
70	688629	华丰科技	1,600	300,016.00	0.32
71	600497	驰宏锌锗	24,676	298,826.36	0.32
72	300570	太辰光	1,200	296,052.00	0.32
73	688411	海博思创	1,000	291,200.00	0.31
74	301200	大族数控	800	288,520.00	0.31
75	688052	纳芯微	1,000	288,310.00	0.31
76	002261	拓维信息	10,200	285,702.00	0.31
77	600157	永泰能源	176,700	284,487.00	0.31
78	002850	科达利	1,500	283,950.00	0.31
79	002340	格林美	41,500	274,315.00	0.30
80	600711	盛屯矿业	25,000	274,250.00	0.30
81	600909	华安证券	24,500	272,195.00	0.29
82	600143	金发科技	17,400	268,830.00	0.29
83	300017	网宿科技	20,400	265,404.00	0.29
84	000783	长江证券	26,900	262,275.00	0.28
85	002131	利欧股份	54,800	260,300.00	0.28

86	002821	凯莱英	1,600	259,200.00	0.28
87	688234	天岳先进	1,489	258,356.39	0.28
88	688235	百济神州	1,013	257,919.93	0.28
89	601555	东吴证券	32,360	256,291.20	0.28
90	003031	中瓷电子	1,420	256,026.00	0.28
91	002203	海亮股份	11,200	255,920.00	0.28
92	600352	浙江龙盛	21,100	255,521.00	0.28
93	601233	桐昆股份	11,700	253,305.00	0.27
94	002966	苏州银行	36,310	252,717.60	0.27
95	688027	国盾量子	500	252,005.00	0.27
96	603659	璞泰来	8,700	251,691.00	0.27
97	300339	润和软件	6,500	250,315.00	0.27
98	300759	康龙化成	8,400	243,012.00	0.26
99	688322	奥比中光	1,800	234,990.00	0.25
100	301611	珂玛科技	1,300	234,091.00	0.25
101	603308	应流股份	3,800	229,520.00	0.25
102	601108	财通证券	26,480	229,052.00	0.25
103	688122	西部超导	3,631	228,063.11	0.25
104	688301	奕瑞科技	1,835	227,540.00	0.25
105	688213	思特威	2,120	226,988.40	0.25
106	300207	欣旺达	11,900	225,981.00	0.24
107	002517	恺英网络	13,900	225,875.00	0.24
108	002472	双环传动	5,400	224,154.00	0.24
109	002601	龙佰集团	13,600	224,128.00	0.24
110	002797	第一创业	34,100	224,037.00	0.24
111	300001	特锐德	5,900	223,197.00	0.24
112	688220	翱捷科技	1,778	221,040.96	0.24
113	688387	信科移动	11,117	220,561.28	0.24
114	300458	全志科技	5,560	219,397.60	0.24
115	601958	金钼股份	7,800	219,258.00	0.24
116	688578	艾力斯	2,000	218,400.00	0.24
117	601198	东兴证券	15,800	214,722.00	0.23
118	601991	大唐发电	30,200	213,816.00	0.23
119	300115	长盈精密	7,600	212,344.00	0.23
120	002155	湖南黄金	8,870	211,726.90	0.23
121	688385	复旦微电	2,960	211,018.40	0.23
122	000703	恒逸石化	15,500	210,335.00	0.23
123	688331	荣昌生物	1,600	208,416.00	0.23
124	603129	春风动力	800	204,640.00	0.22
125	002465	海格通信	16,000	204,320.00	0.22
126	603179	新泉股份	4,080	202,572.00	0.22
127	300454	深信服	2,100	202,020.00	0.22
128	601665	齐鲁银行	35,000	201,950.00	0.22
129	603156	养元饮品	4,100	201,187.00	0.22

130	002056	横店东磁	6,600	201,168.00	0.22
131	600884	杉杉股份	14,500	196,475.00	0.21
132	603650	彤程新材	2,000	195,960.00	0.21
133	300024	机器人	10,120	195,619.60	0.21
134	002130	沃尔核材	10,200	193,392.00	0.21
135	601162	天风证券	57,130	192,528.10	0.21
136	300496	中科创达	3,100	191,549.00	0.21
137	002402	和而泰	7,400	191,142.00	0.21
138	600707	彩虹股份	11,300	190,857.00	0.21
139	002432	九安医疗	2,700	190,836.00	0.21
140	600563	法拉电子	1,000	190,800.00	0.21
141	000060	中金岭南	25,200	190,764.00	0.21
142	002429	兆驰股份	18,300	190,137.00	0.21
143	300012	华测检测	13,700	189,882.00	0.21
144	603379	三美股份	2,460	186,689.40	0.20
145	688266	泽璟制药	1,600	186,656.00	0.20
146	601099	太平洋	55,300	186,361.00	0.20
147	000878	云南铜业	11,700	185,796.00	0.20
148	689009	九号公司	4,869	185,752.35	0.20
149	002414	高德红外	14,000	185,640.00	0.20
150	002487	大金重工	3,200	185,504.00	0.20
151	300474	景嘉微	3,050	184,464.00	0.20
152	600109	国金证券	21,000	184,380.00	0.20
153	000893	亚钾国际	4,500	184,005.00	0.20
154	002271	东方雨虹	15,500	183,985.00	0.20
155	000034	神州数码	6,600	183,150.00	0.20
156	603979	金诚信	3,100	182,993.00	0.20
157	000733	振华科技	3,200	181,248.00	0.20
157	002756	永兴材料	3,200	181,248.00	0.20
159	600298	安琪酵母	5,000	181,000.00	0.20
160	688608	恒玄科技	1,080	180,565.20	0.20
161	002444	巨星科技	5,800	180,380.00	0.19
162	300623	捷捷微电	4,000	179,960.00	0.19
163	000661	长春高新	2,700	179,820.00	0.19
164	600256	广汇能源	36,300	179,322.00	0.19
165	002335	科华数据	4,220	179,139.00	0.19
166	600060	海信视像	6,400	178,368.00	0.19
167	688728	格科微	8,400	176,736.00	0.19
168	688676	金盘科技	2,081	176,135.84	0.19
169	603688	石英股份	2,100	173,481.00	0.19
170	600021	上海电力	11,500	173,305.00	0.19
171	601128	常熟银行	29,602	172,283.64	0.19
172	601696	中银证券	13,600	172,040.00	0.19
173	300763	锦浪科技	1,900	171,665.00	0.19

174	002078	太阳纸业	13,700	171,113.00	0.18
175	688169	石头科技	1,800	170,946.00	0.18
176	600699	均胜电子	7,900	170,719.00	0.18
177	601577	长沙银行	19,600	170,716.00	0.18
178	603087	甘李药业	3,000	170,280.00	0.18
179	601615	明阳智能	14,700	170,079.00	0.18
180	300748	金力永磁	5,500	169,675.00	0.18
181	300142	沃森生物	13,000	168,870.00	0.18
182	002157	正邦科技	60,000	168,600.00	0.18
183	300073	当升科技	3,500	168,140.00	0.18
184	002025	航天电器	2,200	167,684.00	0.18
185	301536	星宸科技	1,300	167,323.00	0.18
186	300432	富临精工	8,300	166,747.00	0.18
187	300919	中伟新材	3,800	166,250.00	0.18
188	603606	东方电缆	3,940	163,549.40	0.18
189	603920	世运电路	3,400	163,336.00	0.18
190	000423	东阿阿胶	3,600	163,296.00	0.18
191	300724	捷佳伟创	2,300	162,380.00	0.18
192	688599	天合光能	11,471	161,970.52	0.17
193	002252	上海莱士	37,300	161,882.00	0.17
194	688375	国博电子	1,537	160,309.10	0.17
195	000728	国元证券	21,200	158,788.00	0.17
196	300972	万辰集团	900	156,069.00	0.17
197	688018	乐鑫科技	1,220	156,062.40	0.17
198	688188	柏楚电子	1,459	155,675.30	0.17
199	603119	浙江荣泰	2,300	152,582.00	0.16
200	002064	华峰化学	16,000	151,840.00	0.16
201	000786	北新建材	8,300	150,147.00	0.16
202	001203	大中矿业	5,000	149,750.00	0.16
203	002831	裕同科技	4,207	149,600.92	0.16
204	300953	震裕科技	1,100	147,070.00	0.16
205	688343	云天励飞	1,800	146,988.00	0.16
206	600171	上海贝岭	4,600	146,924.00	0.16
207	300383	光环新网	11,800	146,792.00	0.16
208	688180	君实生物	4,320	146,102.40	0.16
209	300677	英科医疗	3,700	144,929.00	0.16
210	300679	电连技术	2,400	143,976.00	0.16
211	603444	吉比特	400	143,368.00	0.15
212	000519	中兵红箭	6,800	143,276.00	0.15
213	603806	福斯特	8,500	142,715.00	0.15
214	603160	汇顶科技	2,300	141,933.00	0.15
215	002673	西部证券	21,700	140,833.00	0.15
216	600177	雅戈尔	18,676	140,630.28	0.15
217	600642	申能股份	16,000	139,680.00	0.15

218	000559	万向钱潮	10,700	138,351.00	0.15
219	688617	惠泰医疗	759	137,804.04	0.15
220	603290	斯达半导	900	137,646.00	0.15
221	601699	潞安环能	9,600	137,088.00	0.15
222	300699	光威复材	4,780	136,947.00	0.15
223	002624	完美世界	11,000	136,620.00	0.15
224	000623	吉林敖东	7,700	136,521.00	0.15
225	600637	东方明珠	16,370	136,034.70	0.15
226	001696	宗申动力	6,500	135,265.00	0.15
227	600516	方大炭素	21,737	134,117.29	0.14
228	603225	新凤鸣	6,800	133,620.00	0.14
229	000983	山西焦煤	23,000	133,400.00	0.14
230	002085	万丰奥威	12,000	133,080.00	0.14
231	000750	国海证券	36,100	132,848.00	0.14
232	688568	中科星图	3,200	132,704.00	0.14
233	002739	儒意电影	13,800	132,480.00	0.14
234	688065	凯赛生物	2,765	132,305.25	0.14
235	002318	久立特材	5,500	131,450.00	0.14
236	603699	纽威股份	2,600	130,780.00	0.14
237	688187	时代电气	1,900	130,454.00	0.14
238	600369	西南证券	32,400	130,248.00	0.14
239	600100	同方股份	19,000	130,150.00	0.14
240	300558	贝达药业	2,000	130,140.00	0.14
241	002065	东华软件	18,200	129,948.00	0.14
242	600499	科达制造	9,400	129,720.00	0.14
243	603345	安井食品	1,600	128,304.00	0.14
244	600536	中国软件	4,556	128,114.72	0.14
245	002266	浙富控股	25,300	128,018.00	0.14
246	300627	华测导航	4,500	127,800.00	0.14
247	002044	美年健康	25,400	127,762.00	0.14
248	600595	中孚实业	22,700	127,574.00	0.14
249	603596	伯特利	5,131	127,454.04	0.14
250	688615	合合信息	1,120	126,672.00	0.14
251	000155	川能动力	10,500	125,790.00	0.14
252	300002	神州泰岳	16,100	125,741.00	0.14
253	002223	鱼跃医疗	4,900	125,734.00	0.14
254	000629	钒钛股份	37,500	125,250.00	0.14
255	688772	珠海冠宇	6,363	124,905.69	0.13
256	000032	深桑达 A	5,000	124,750.00	0.13
257	601016	节能风电	31,920	123,849.60	0.13
258	002430	杭氧股份	4,000	123,840.00	0.13
259	000400	许继电气	5,700	123,690.00	0.13
260	300487	蓝晓科技	2,100	123,585.00	0.13
261	300003	乐普医疗	10,400	123,240.00	0.13

262	600862	中航高科	6,800	122,604.00	0.13
263	000415	渤海租赁	30,100	122,507.00	0.13
264	601212	白银有色	24,100	122,428.00	0.13
265	601717	中创智领	8,800	122,408.00	0.13
266	600521	华海药业	8,500	122,400.00	0.13
267	600985	淮北矿业	8,700	122,235.00	0.13
268	688692	达梦数据	500	122,145.00	0.13
269	601997	贵阳银行	23,740	121,786.20	0.13
270	601216	君正集团	27,300	121,758.00	0.13
271	000039	中集集团	15,000	121,650.00	0.13
272	000683	博源化工	21,100	121,536.00	0.13
273	600863	华能蒙电	25,400	119,380.00	0.13
274	600704	物产中大	25,056	118,264.32	0.13
275	601001	晋控煤业	6,800	118,252.00	0.13
276	603766	隆鑫通用	9,900	118,107.00	0.13
277	601990	南京证券	17,900	117,603.00	0.13
278	600873	梅花生物	16,000	117,600.00	0.13
279	688582	芯动联科	1,800	117,000.00	0.13
280	600312	平高电气	6,600	116,556.00	0.13
281	000729	燕京啤酒	11,488	116,373.44	0.13
282	603077	和邦生物	50,100	116,232.00	0.13
283	688538	和辉光电	44,649	116,087.40	0.13
284	000050	深天马 A	11,700	115,947.00	0.13
285	000967	盈峰环境	10,900	114,777.00	0.12
286	000887	中鼎股份	6,400	114,496.00	0.12
287	002841	视源股份	3,300	113,949.00	0.12
288	603605	珀莱雅	1,900	113,848.00	0.12
289	600765	中航重机	8,780	113,437.60	0.12
290	000830	鲁西化工	9,400	112,800.00	0.12
291	600166	福田汽车	38,700	112,617.00	0.12
292	600332	白云山	5,600	112,224.00	0.12
293	600153	建发股份	14,100	111,813.00	0.12
294	600348	华阳股份	14,550	111,307.50	0.12
295	002410	广联达	13,400	109,344.00	0.12
296	002939	长城证券	13,100	109,254.00	0.12
297	002007	华兰生物	8,900	108,491.00	0.12
298	601611	中国核建	9,700	108,155.00	0.12
299	600901	江苏金租	18,757	107,852.75	0.12
300	600363	联创光电	3,000	107,340.00	0.12
301	688297	中无人机	2,582	107,282.10	0.12
302	600737	中粮糖业	8,678	106,999.74	0.12
303	002683	广东宏大	3,600	105,444.00	0.11
304	000062	深圳华强	3,300	105,006.00	0.11
305	002926	华西证券	12,800	104,576.00	0.11

306	600578	京能电力	16,200	104,490.00	0.11
307	688248	南网科技	1,507	104,254.26	0.11
308	603728	鸣志电器	1,700	103,564.00	0.11
309	603568	伟明环保	6,731	103,522.78	0.11
310	600398	海澜之家	19,600	102,508.00	0.11
311	000591	太阳能	22,200	102,120.00	0.11
312	002603	以岭药业	6,800	102,000.00	0.11
313	000921	海信家电	3,700	101,084.00	0.11
314	000737	北方铜业	7,600	100,472.00	0.11
315	000528	柳工	13,300	100,415.00	0.11
316	603298	杭叉集团	4,200	100,212.00	0.11
317	601799	星宇股份	1,100	99,682.00	0.11
318	601000	唐山港	24,000	99,600.00	0.11
319	600208	衢州发展	34,616	97,963.28	0.11
320	688778	厦钨新能	1,800	97,920.00	0.11
321	603341	龙旗科技	2,300	97,727.00	0.11
322	000738	航发控制	5,300	96,937.00	0.10
323	600486	扬农化工	1,911	96,887.70	0.10
324	688295	中复神鹰	1,600	96,864.00	0.10
325	600008	首创环保	35,600	96,832.00	0.10
326	600435	北方导航	8,625	96,600.00	0.10
327	600170	上海建工	43,400	96,348.00	0.10
328	000932	华菱钢铁	27,700	96,119.00	0.10
329	600998	九州通	20,461	95,962.09	0.10
330	000987	越秀资本	12,155	95,052.10	0.10
331	600316	洪都航空	3,400	94,996.00	0.10
332	600995	南网储能	7,700	94,710.00	0.10
333	002152	广电运通	10,000	93,800.00	0.10
334	002262	恩华药业	5,000	93,750.00	0.10
335	000951	中国重汽	4,800	93,648.00	0.10
336	600820	隧道股份	17,900	93,259.00	0.10
337	000997	新大陆	5,700	92,910.00	0.10
338	600483	福能股份	9,100	92,729.00	0.10
339	600282	南钢股份	20,100	92,259.00	0.10
340	601106	中国一重	27,900	92,070.00	0.10
341	688114	华大智造	1,800	91,944.00	0.10
342	000009	中国宝安	14,700	91,581.00	0.10
343	600161	天坛生物	7,900	91,482.00	0.10
344	603486	科沃斯	1,800	91,350.00	0.10
345	603885	吉祥航空	8,840	90,963.60	0.10
346	002500	山西证券	17,500	90,300.00	0.10
347	600583	海油工程	17,900	90,037.00	0.10
348	688318	财富趋势	1,260	89,850.60	0.10
349	603939	益丰药房	4,964	89,252.72	0.10

350	603816	顾家家居	3,983	89,059.88	0.10
351	000582	北部湾港	8,200	87,986.00	0.10
352	600546	山煤国际	8,000	87,440.00	0.09
353	600763	通策医疗	2,564	86,868.32	0.09
354	600329	达仁堂	2,300	85,606.00	0.09
355	600602	云赛智联	5,300	85,224.00	0.09
356	601666	平煤股份	11,900	85,085.00	0.09
357	603338	浙江鼎力	2,000	85,000.00	0.09
358	600562	国睿科技	4,000	84,880.00	0.09
359	688336	三生国健	1,595	84,694.50	0.09
360	002312	川发龙蟒	9,200	84,364.00	0.09
361	688281	华秦科技	1,679	84,336.17	0.09
362	300676	华大基因	2,400	84,144.00	0.09
363	600685	中船防务	3,300	83,952.00	0.09
364	600380	健康元	8,900	83,838.00	0.09
365	601156	东航物流	5,200	83,824.00	0.09
366	000513	丽珠集团	2,900	83,781.00	0.09
367	601567	三星电气	5,600	83,664.00	0.09
368	000723	美锦能源	24,900	83,415.00	0.09
369	603565	中谷物流	8,500	83,385.00	0.09
370	600390	五矿资本	18,200	82,992.00	0.09
371	003022	联泓新科	3,200	82,880.00	0.09
372	600511	国药股份	3,182	82,859.28	0.09
373	600132	重庆啤酒	2,000	82,600.00	0.09
374	601880	辽港股份	59,600	82,248.00	0.09
375	600038	中直股份	3,200	80,928.00	0.09
376	601399	国机重装	23,000	80,500.00	0.09
377	000739	普洛药业	4,800	79,968.00	0.09
378	601865	福莱特	7,600	79,876.00	0.09
379	688166	博瑞医药	2,271	79,507.71	0.09
380	600535	天士力	6,000	79,380.00	0.09
381	003021	兆威机电	900	78,615.00	0.08
382	601236	红塔证券	11,500	78,430.00	0.08
383	600906	财达证券	10,500	78,330.00	0.08
384	600816	建元信托	31,900	77,836.00	0.08
385	300100	双林股份	2,800	77,784.00	0.08
386	600977	中国电影	6,000	77,520.00	0.08
387	002299	圣农发展	5,100	77,316.00	0.08
388	000598	兴蓉环境	12,000	77,040.00	0.08
389	688278	特宝生物	1,400	76,160.00	0.08
390	002244	滨江集团	10,000	76,000.00	0.08
391	601155	新城控股	7,400	75,924.00	0.08
392	600970	中材国际	10,565	75,328.45	0.08
393	600967	内蒙一机	6,900	74,865.00	0.08

394	002120	韵达股份	11,700	74,412.00	0.08
395	300144	宋城演艺	12,800	74,368.00	0.08
396	000883	湖北能源	17,200	74,304.00	0.08
397	300146	汤臣倍健	8,200	74,128.00	0.08
398	300735	光弘科技	3,200	72,768.00	0.08
399	000027	深圳能源	11,675	72,385.00	0.08
400	603737	三棵树	2,977	71,745.70	0.08
401	600131	国网信通	4,900	71,540.00	0.08
402	601608	中信重工	14,900	71,073.00	0.08
403	002568	百润股份	4,200	71,064.00	0.08
404	000800	一汽解放	11,900	70,805.00	0.08
405	600095	湘财股份	9,400	70,782.00	0.08
406	601866	中远海发	31,800	70,278.00	0.08
407	000088	盐田港	16,900	69,121.00	0.07
408	600566	济川药业	3,100	68,789.00	0.07
409	600801	华新建材	4,400	68,640.00	0.07
410	002583	海能达	8,900	68,441.00	0.07
411	601118	海南橡胶	13,900	68,388.00	0.07
412	600871	石化油服	33,100	67,193.00	0.07
413	300718	长盛轴承	1,100	67,067.00	0.07
414	600126	杭钢股份	10,939	67,056.07	0.07
415	002984	森麒麟	5,100	66,657.00	0.07
416	603000	人民网	4,500	66,555.00	0.07
417	600517	国网英大	13,900	65,052.00	0.07
418	600655	豫园股份	15,800	64,938.00	0.07
419	000709	河钢股份	33,400	64,796.00	0.07
420	600754	锦江酒店	3,600	64,764.00	0.07
421	688709	成都华微	1,700	64,753.00	0.07
422	688192	迪哲医药	1,600	63,888.00	0.07
423	002773	康弘药业	3,100	63,395.00	0.07
424	000825	太钢不锈	18,500	63,085.00	0.07
425	603858	步长制药	4,300	62,780.00	0.07
426	601598	中国外运	12,600	62,496.00	0.07
427	603899	晨光股份	3,000	61,890.00	0.07
428	600598	北大荒	5,700	61,788.00	0.07
429	002423	中粮资本	7,500	61,725.00	0.07
430	603589	口子窖	3,300	61,644.00	0.07
431	688563	航材股份	1,200	61,476.00	0.07
432	600004	白云机场	8,400	60,984.00	0.07
433	001286	陕西能源	6,000	60,840.00	0.07
434	688363	华熙生物	1,700	60,809.00	0.07
435	600663	陆家嘴	9,600	60,288.00	0.07
436	601966	玲珑轮胎	5,900	60,121.00	0.06
437	600350	山东高速	5,400	60,102.00	0.06

438	600582	天地科技	13,452	59,861.40	0.06
439	600848	上海临港	7,720	57,822.80	0.06
440	000429	粤高速 A	4,200	57,330.00	0.06
441	601098	中南传媒	5,800	57,072.00	0.06
442	688349	三一重能	3,727	56,575.86	0.06
443	688708	佳驰科技	1,100	55,880.00	0.06
444	002508	老板电器	3,800	55,556.00	0.06
445	603233	大参林	3,679	55,295.37	0.06
446	301606	绿联科技	900	54,918.00	0.06
447	600968	海油发展	16,400	54,612.00	0.06
448	601928	凤凰传媒	6,200	54,498.00	0.06
449	003035	南网能源	9,300	54,126.00	0.06
450	300957	贝泰妮	1,700	53,567.00	0.06
451	601808	中海油服	4,900	52,969.00	0.06
452	002670	国盛证券	4,800	52,800.00	0.06
453	600688	上海石化	18,000	52,740.00	0.06
454	600295	鄂尔多斯	4,900	52,528.00	0.06
455	688425	铁建重工	13,044	52,436.88	0.06
456	300888	稳健医疗	1,820	50,941.80	0.06
457	600098	广州发展	8,500	50,235.00	0.05
458	600062	华润双鹤	3,100	49,724.00	0.05
459	000539	粤电力 A	7,300	49,713.00	0.05
460	600808	马钢股份	19,500	48,750.00	0.05
461	002153	石基信息	6,730	48,657.90	0.05
462	000537	绿发电力	6,639	48,531.09	0.05
463	688561	奇安信	2,001	47,983.98	0.05
464	002032	苏泊尔	1,200	47,520.00	0.05
465	600292	电投水电	3,900	46,956.00	0.05
466	600377	宁沪高速	4,000	46,280.00	0.05
467	601298	青岛港	5,600	45,080.00	0.05
468	000959	首钢股份	12,500	43,875.00	0.05
469	002265	建设工业	2,500	43,500.00	0.05
470	301301	川宁生物	5,400	42,876.00	0.05
471	603833	欧派家居	1,400	42,154.00	0.05
472	002608	江苏国信	6,100	42,090.00	0.05
473	600339	中油工程	13,600	41,752.00	0.05
474	600032	浙江新能	5,900	41,595.00	0.04
475	600606	绿地控股	34,280	41,478.80	0.04
476	688520	神州细胞	1,200	41,052.00	0.04
477	600764	中国海防	2,330	40,611.90	0.04
478	000785	居然智家	20,200	40,400.00	0.04
479	603049	中策橡胶	900	40,329.00	0.04
480	601139	深圳燃气	7,100	40,186.00	0.04
481	603529	爱玛科技	2,050	39,995.50	0.04

482	688475	萤石网络	1,400	38,290.00	0.04
483	000937	冀中能源	9,500	37,810.00	0.04
484	603658	安图生物	1,300	37,726.00	0.04
485	300140	节能环保	7,500	37,275.00	0.04
486	603786	科博达	900	36,819.00	0.04
487	301498	乖宝宠物	900	36,531.00	0.04
488	000898	鞍钢股份	19,300	36,091.00	0.04
489	603175	超颖电子	400	35,636.00	0.04
490	601228	广州港	12,000	33,840.00	0.04
491	601019	山东出版	5,200	33,280.00	0.04
492	600927	永安期货	2,400	29,880.00	0.03
493	002945	华林证券	2,200	29,546.00	0.03
494	601112	振石股份	1,500	27,345.00	0.03
495	002461	珠江啤酒	3,600	27,252.00	0.03
496	688819	天能股份	1,200	26,640.00	0.03
497	600299	安迪苏	3,200	25,120.00	0.03
498	603092	德力佳	300	16,191.00	0.02
499	001386	马可波罗	900	12,744.00	0.01
500	001221	悍高集团	300	12,066.00	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	688781	视涯科技	883	37,227.28	0.04
2	301682	宏明电子	92	14,725.52	0.02

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	301308	江波龙	1,840,976.00	1.65
2	300136	信维通信	1,656,823.00	1.49
3	300604	长川科技	1,628,668.84	1.46
4	300751	迈为股份	1,381,266.00	1.24
5	688498	源杰科技	1,325,453.28	1.19
6	002851	麦格米特	1,259,122.00	1.13
7	002008	大族激光	1,210,258.00	1.08
8	002281	光迅科技	1,204,188.00	1.08

9	300857	协创数据	1,200,913.00	1.08
10	002156	通富微电	1,173,517.00	1.05
11	002738	中矿资源	1,168,290.00	1.05
12	300395	菲利华	1,146,587.00	1.03
13	300058	蓝色光标	1,105,426.30	0.99
14	002202	金风科技	1,103,127.00	0.99
15	000426	兴业银锡	1,075,891.00	0.96
16	002353	杰瑞股份	1,035,785.00	0.93
17	001309	德明利	1,016,755.00	0.91
18	002195	岩山科技	973,714.00	0.87
19	300450	先导智能	972,139.00	0.87
20	002131	利欧股份	955,278.00	0.86

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	301308	江波龙	2,792,755.00	2.50
2	002353	杰瑞股份	2,095,515.00	1.88
3	002156	通富微电	1,984,509.00	1.78
4	300136	信维通信	1,963,481.00	1.76
5	300604	长川科技	1,919,983.00	1.72
6	002202	金风科技	1,789,135.00	1.60
7	600487	亨通光电	1,750,442.00	1.57
8	000426	兴业银锡	1,747,445.00	1.57
9	000657	中钨高新	1,578,330.00	1.41
10	002837	英维克	1,555,450.00	1.39
11	300450	先导智能	1,547,515.00	1.39
12	002008	大族激光	1,540,881.00	1.38
13	300751	迈为股份	1,533,248.00	1.37
14	002851	麦格米特	1,505,429.00	1.35
15	002281	光迅科技	1,460,220.00	1.31
16	300857	协创数据	1,450,947.00	1.30
17	000933	神火股份	1,423,479.00	1.28
18	002738	中矿资源	1,352,338.00	1.21
19	300395	菲利华	1,349,398.00	1.21
20	300058	蓝色光标	1,335,810.69	1.20

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	124,946,467.74
卖出股票的收入（成交）总额	138,077,530.24

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	16,000.21	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,000.21	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111025	圣泉转债	160	16,000.21	0.02

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未发现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约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	152,623.62
2	应收清算款	-
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	152,623.62

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处于转股期的可转换债券。

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	688781	视涯科技	37,227.28	0.04	新股锁定
2	301682	宏明电子	14,725.52	0.02	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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,525	42,426.23	37,827,838.00	58.47%	26,872,162.00	41.53%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

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（2021 年 8 月 18 日）基金份额总额	727,700,000.00
本报告期期初基金份额总额	94,700,000.00
本报告期基金总申购份额	147,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	177,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,700,000.00

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：

2026 年 5 月 9 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四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人托管业务部门未受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
东方证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	150,117,671.28	57.09%	20,402.17	52.11%	-
招商证券	4	100,590,845.70	38.25%	16,613.89	42.43%	-
长江证券	2	7,826,462.94	2.98%	1,533.20	3.92%	-
中金公司	1	4,436,995.00	1.69%	602.92	1.54%	-

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所需；

(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、本基金本报告期内中金公司增加 1 个席位。

10.7.2 基金租用或者通过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
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	16,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司关于旗下部分上交所ETF 变更扩位证券简称的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-01-30
2	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
3	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》	2026-05-09

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	2026 年 02 月 03 日至 2026 年 03 月 18 日，2026 年 05 月 14 日至 2026 年 05 月 17 日	7,322,575.00	67,976,300.00	67,005,800.00	8,293,075.00	12.82%
	2	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 01 月 13 日，2026 年 01 月 19 日至 2026 年 01 月 29 日，2026 年 02 月 25 日至 2026 年 03 月 01	29,071,349.00	168,400,100.00	194,503,400.00	2,968,049.00	4.59%

		日，2026 年 04 月 14 日至 2026 年 04 月 14 日，2026 年 04 月 24 日至 2026 年 05 月 10 日，2026 年 05 月 12 日至 2026 年 05 月 12 日					
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 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

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 15-20 层。

基金托管人住所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日