

**国泰沪深 300 指数证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 8 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 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.....	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
6 中期财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
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股指期货交易情况说明	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	56
9 开放式基金份额变动	56
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	57
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	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	国泰沪深 300 指数	
基金主代码	020011	
交易代码	020011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 11 月 11 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,744,677,146.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	020011	005867
报告期末下属分级基金的份额总额	1,742,514,180.94 份	2,162,965.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法, 通过严格的投资约束和数量化风险控制手段, 力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%, 实现对沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为以完全复制为目标的指数基金, 按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 基金管理人会对投资组合进行适当调整, 以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	90% ×沪深 300 指数收益率+10% ×银行同业存款收益率。
风险收益特征	本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华
	联系电话	021-31081600 转
	电子邮箱	xinxiplu@gtfund.com
客户服务电话	(021) 31089000, 400-888-8688	95566
传真	021-31081800	010-66594942

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	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200082	100818
法定代表人	陈勇胜	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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 16 层-19 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册 中心	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
本期已实现收益	181,993,844.98	177,915.18
本期利润	68,123,238.25	107,352.19
加权平均基金份额本期利润	0.0301	0.0594
本期加权平均净值利润率	3.41%	6.77%
本期基金份额净值增长率	2.75%	2.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
期末可供分配利润	414,984,946.95	505,508.66
期末可供分配基金份额利润	0.2382	0.2337
期末基金资产净值	1,632,138,242.79	2,017,563.63
期末基金份额净值	0.9367	0.9328
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C

基金份额累计净值增长率	-6.23%	13.99%
-------------	--------	--------

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）自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.01%	0.85%	6.90%	0.81%	1.11%	0.04%
过去三个月	13.53%	0.85%	11.63%	0.81%	1.90%	0.04%
过去六个月	2.75%	1.44%	1.63%	1.37%	1.12%	0.07%
过去一年	11.19%	1.15%	8.17%	1.10%	3.02%	0.05%
过去三年	19.19%	1.19%	12.95%	1.13%	6.24%	0.06%
自基金合同生效起至今	-6.23%	1.58%	-11.49%	1.53%	5.26%	0.05%

国泰沪深 300 指数 C

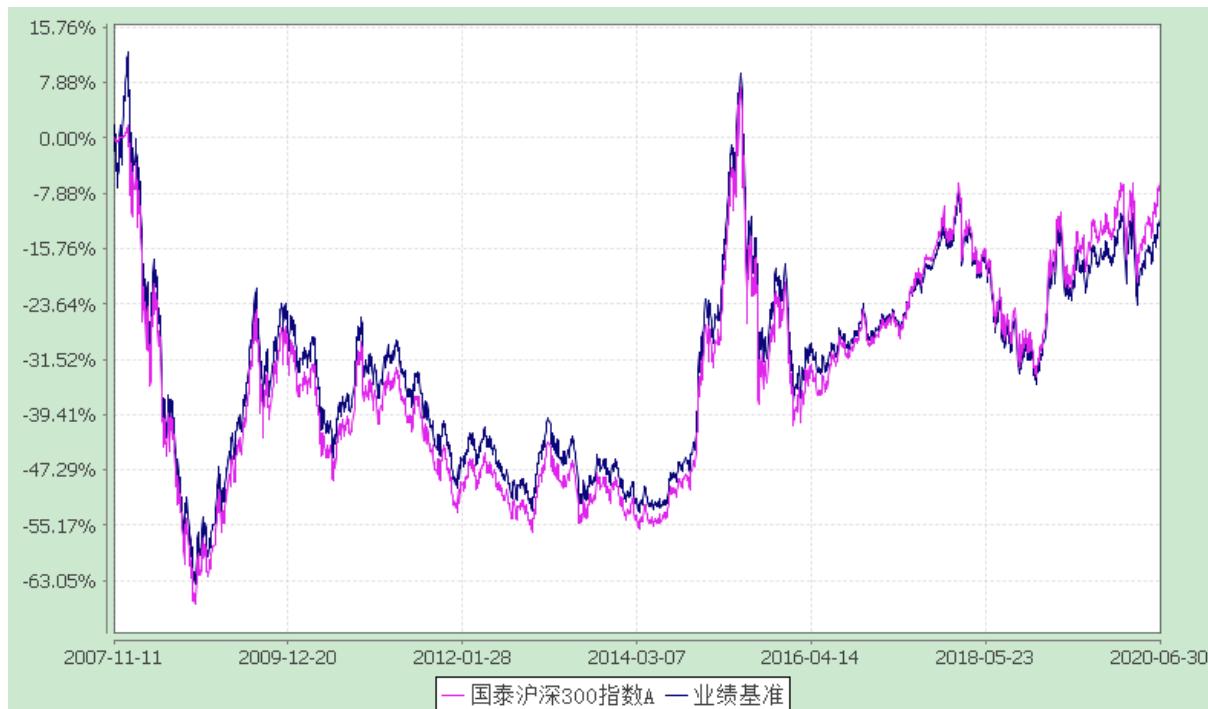
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.96%	0.85%	6.90%	0.81%	1.06%	0.04%
过去三个月	13.37%	0.85%	11.63%	0.81%	1.74%	0.04%
过去六个月	2.48%	1.44%	1.63%	1.37%	0.85%	0.07%
过去一年	10.65%	1.15%	8.17%	1.10%	2.48%	0.05%
自新增 C 类份额至今	13.99%	1.29%	9.01%	1.23%	4.98%	0.06%

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

国泰沪深 300 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
(2007 年 11 月 11 日至 2020 年 6 月 30 日)

国泰沪深 300 指数 A



国泰沪深 300 指数 C



注：1)本基金的合同生效日为 2007 年 11 月 11 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2)自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 141 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指

数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金

(由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来)、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金(由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来)、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来)、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来)、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金。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		
艾小军	本基金的基金经理、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰深证 TMT50 指数分级、上证 10 年期国债 ETF、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合、国泰黄金 ETF 联接、芯片 ETF、国泰量化成长优选混合、上证 5 年期国债 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰	2015-04-10	-	19 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金

中证全指通信设备 ETF 联接的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监			<p>(LOF) 的基金经理, 2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)的基金经理, 2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金(由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理, 2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 (由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来)的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金 (由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来) 的基金经理, 2019 年 7 月起兼任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开</p>
--------------------------------------	--	--	--

					放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程总监。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 $T=3$ 和 $T=5$ 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 3 次。本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度受新冠肺炎疫情自国内至欧美持续蔓延的冲击，全球金融市场各类资产大幅波动，A 股市场大幅震荡。年初，受全面决胜小康收官之年的各项利好政策预期，市场延续去年四季度的良好走势，尤其是以 5G 大规模建设、国产替代等为核心的包括半导体、通信、计算机，以及受特斯拉强劲表现带动的新能源汽车等板块表现持续走强；1 月下旬受武汉出现新冠肺炎传闻影响，市场开始震荡走弱，尤其是春节后第一天受国内疫情的持续大幅冲击，沪深两市个股大面积跌停，在国内果断采取严格的防控措施，疫情逐步得到控制的情况下，受新基金发行持续火爆影响，科技股引领 A 股走出了一波快速上涨的行情；随着疫情在境外的逐步蔓延扩大，以及境外防控措施的乏力，全球金融市场经受大幅冲击，各类资产均大幅下挫，欧美股市一周之内屡屡熔断，A 股市场也不能独善其身，北向资金短期内持续大幅净流出，上证指数最低下探到 2646 点，前期涨幅过快的半导体、通信、计算机、新能源汽车等强势板块大幅回调。

二季度受创业板改革并试点注册制、新冠肺炎疫情在境外持续蔓延影响，A 股市场结构性行情纷呈。受创业板改革并试点注册制影响，创业板指数持续走强，二季度涨幅超过 30%；受益新冠肺炎疫苗研发进展，包括原料药、疫苗类上市公司大幅走强，医药生物行业季度涨幅接近 30%，中证生物医药指数季度涨幅超过 40%。科技方面，受苹果新机型预计推出的预期，以及包括中芯国际即将科创板上市带动，中华半导体芯片指数季度涨幅亦超过 30%。海南自贸港一系列改革措施的推进落地带动免税相关概念大幅走强。临近季末，上证指数编制方案修改、科创板 50 指数即将推出，带动市场风险偏好逐步提升。

上半年上证指数下跌 2.15%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 3.95%，沪深 300 指数上涨 1.64%，成长性中小盘股表征指数如中证 500 上涨 11.33%，板块上科技股占比较多的中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.6%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的医药生物、休闲服务、电子，涨幅分别为 40.28%、30.07%、24.49%，表现落后的为采掘、银行、非银金融，分别下跌了 18.62%、13.97%、11.7%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰沪深 300 指数 A 在 2020 年上半年净值增长率为 2.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.63%
。

国泰沪深 300 指数 C 在 2020 年上半年净值增长率为 2.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.63%
。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年随着上证指数采用新修订的编制方案，上证指数有望更加全面客观的反映 A 股市场的投资机会，作为最有影响力的 A 股指数，新修订后的指数有望稳步上行，有助于提升投资者的风险偏好，在当前市场资金利率持续下行的环境下，包括银行理财资金在内的各类资产有望持续配置 A 股；受新冠疫情影响，得益于国内严格的防控措施，国内经济在全球经济体的吸引力更加凸显，有望带动外资加大 A 股资产的配置力度；受科创板 50 指数的推出以及相关 ETF 的发行上市所带动，包括半导体芯片、计算机、通信等行业有望持续受到资金的青睐。在国内疫情受控的情况下，中央层面达到全面实现小康的总体目标仍然不变，预计国内稳增长政策力度将持续加码，以 5G、工业互联网、大数据等为主的新基建将是政策的主要着力点，也是政策弹性更大的方向。行业表现上在疫情后周期稳增长政策的刺激下，预计表现相对均衡。

在中美科技竞争长期化的背景下，包括自主可控、国产替代有望带来包括半导体芯片、通信、计算机等行业的营收持续改善，相关领域公司的竞争力有望大幅提升。中长期我们仍然看好受益于中国经济结构转型的消费龙头，受益医疗支出加大所带动的生物医药医疗，5G 等新基建领域的半导体、通信、计算机以及军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工。

沪深 300 这一中国经济最具代表性的指数的长期增长空间不言而喻。基于长期投资、价值投资的理念，投资者或可利用沪深 300 指数基金这一资产配置工具，把握中国经济长期投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰沪深 300 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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	90,851,325.74	147,260,964.26
结算备付金		-	78,023.48
存出保证金		198,518.70	164,928.63
交易性金融资产	6.4.7.2	1,518,729,058.11	2,095,631,869.24
其中：股票投资		1,518,729,058.11	2,095,631,869.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,693,976.88	-
应收利息	6.4.7.5	8,400.50	26,359.74
应收股利		-	-
应收申购款		1,791,912.08	670,852.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,644,273,192.01	2,243,832,997.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	808.60
应付赎回款		8,586,320.32	29,583,989.55
应付管理人报酬		709,556.25	929,417.16
应付托管费		141,911.24	185,883.42
应付销售服务费		814.66	397.08
应付交易费用	6.4.7.7	464,789.70	239,438.62
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	213,993.42	368,014.04
负债合计		10,117,385.59	31,307,948.47
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,218,665,350.81	1,695,345,660.95
未分配利润	6.4.7.10	415,490,455.61	517,179,388.47
所有者权益合计		1,634,155,806.42	2,212,525,049.42
负债和所有者权益总计		1,644,273,192.01	2,243,832,997.89

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，国泰沪深 300 指数 A 类基金的份额净值 0.9367 元，国泰沪深 300 指数 C 类基金的份额净值 0.9328 元。国泰沪深 300 指数证券投资基金份额总额 1,744,677,146.87 份，其中国泰沪深 300 指数 A 类基金的份额总额 1,742,514,180.94 份，国泰沪深 300 指数 C 类基金的份额总额 2,162,965.93 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		76,511,289.55	523,464,821.24
1.利息收入		387,332.60	545,560.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	386,889.59	544,859.47
债券利息收入		443.01	701.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		189,268,795.52	103,089,157.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	171,393,591.06	78,779,324.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	723,650.22
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	17,875,204.46	23,586,182.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-113,941,169.72	418,714,558.42

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	796,331.15	1,115,544.40
减：二、费用		8,280,699.11	9,460,526.61
1. 管理人报酬		4,961,296.20	5,705,020.55
2. 托管费		992,259.19	1,141,004.05
3. 销售服务费		3,866.77	7,844.81
4. 交易费用	6.4.7.18	2,004,738.72	2,214,498.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	0.10
7. 其他费用	6.4.7.19	318,538.23	392,158.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,230,590.44	514,004,294.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,230,590.44	514,004,294.63

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,695,345,660.95	517,179,388.47	2,212,525,049.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68,230,590.44	68,230,590.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-476,680,310.14	-169,919,523.30	-646,599,833.44
其中：1.基金申购款	338,637,161.04	69,894,741.36	408,531,902.40
2.基金赎回款	-815,317,471.18	-239,814,264.66	-1,055,131,735.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,218,665,350.81	415,490,455.61	1,634,155,806.42
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	2,140,249,354.74	-92,271,134.29	2,047,978,220.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	514,004,294.63	514,004,294.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-198,700,812.83	-21,771,762.24	-220,472,575.07
其中：1.基金申购款	643,507,046.51	100,417,240.34	743,924,286.85
2.基金赎回款	-842,207,859.34	-122,189,002.58	-964,396,861.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,941,548,541.91	399,961,398.10	2,341,509,940.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪蓥，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

国泰沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据原国泰金象保本增值混合证券投资基金管理份额持有人大会审议通过的《关于修改〈国泰金象保本增值混合证券投资基金管理合同〉中中国泰金象保本基金相关转型条款的议案》，并经中国证监会证监基金字[2007]第 307 号《关于核准国泰金象保本增值证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原国泰金象保本增值混合证券投资基金管理在保本期满后转型而来。自 2007 年 11 月 11 日起，《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》正式生效。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《国泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》和《关于原国泰金象保本增值混合证券投资基金管理份额拆分比例的公告》，本基金于 2007 年 12 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 1.431547301，并于 2007 年 12 月 19 日进行了份额变更登记。

本基金于合同生效后自 2007 年 11 月 16 日至 2007 年 12 月 14 日止期间进行集中申购，共募集净有效集中申购资金 5,938,412,579.14 元。根据《国泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金集中申购期内募集的净有效集中申购资金连同申购资金产生的利息收入 3,606,042.98 元

在本基金集中申购期结束后于 2007 年 12 月 19 日按上述拆分后的基金份额净值 1.000 元折算为基金份额，划入基金份额持有者账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%，其中备选成份股投资比例不高于 15%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：90% X 沪深 300 指数收益率+10% X 银行同业存款收益率。

自 2018 年 4 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并对本基金的基金合同作相应修改。本基金两类基金份额分别设置对应的基金代码，投资人申购时可以自主选择 A 类基金份额或 C 类基金份额对应的基金代码进行申购。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。2018 年 4 月 16 日前已持有本基金基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金基金份额余额为 A 类基金份额。具体内容请阅 2018 年 4 月 12 日披露的《关于国泰沪深 300 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》。

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 2020 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰沪深 300 指数证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳

税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2020 年 6 月 30 日	
活期存款		90,851,325.74
定期存款		-
其他存款		-
合计		90,851,325.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,194,507,014.26	1,518,729,058.11	324,222,043.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,194,507,014.26	1,518,729,058.11	324,222,043.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,316.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3.30
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	80.46
合计	8,400.50

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	464,789.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	464,789.70

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,931.67
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	109,398.38
应付指数使用费	92,663.37
合计	213,993.42

6.4.7.9 实收基金

国泰沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,426,100,148.39	1,694,639,089.05
本期申购	480,922,397.28	335,928,997.57
本期赎回（以“-”号填列）	-1,164,508,364.73	-813,414,790.78
本期末	1,742,514,180.94	1,217,153,295.84

国泰沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,010,682.82	706,571.90
本期申购	3,873,864.94	2,708,163.47
本期赎回（以“-”号填列）	-2,721,581.83	-1,902,680.40
本期末	2,162,965.93	1,512,054.97

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

国泰沪深 300 指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,140,633,367.44	-623,667,306.76	516,966,060.68
本期利润	181,993,844.98	-113,870,606.73	68,123,238.25
本期基金份额交易产生的变动数	-346,004,388.92	175,900,036.94	-170,104,351.98
其中：基金申购款	233,297,656.85	-164,067,849.16	69,229,807.69
基金赎回款	-579,302,045.77	339,967,886.10	-239,334,159.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	976,622,823.50	-561,637,876.55	414,984,946.95

国泰沪深 300 指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	473,657.54	-260,329.75	213,327.79
本期利润	177,915.18	-70,562.99	107,352.19
本期基金份额交易产生的变动数	551,902.91	-367,074.23	184,828.68
其中：基金申购款	1,887,541.34	-1,222,607.67	664,933.67
基金赎回款	-1,335,638.43	855,533.44	-480,104.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,203,475.63	-697,966.97	505,508.66

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		378,303.60
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		3,056.87
其他		5,529.12
合计		386,889.59

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		911,570,427.09
减：卖出股票成本总额		740,176,836.03
买卖股票差价收入		171,393,591.06

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,023,100.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000,000.00
减：应收利息总额	23,100.00
买卖债券差价收入	-

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,875,204.46
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	17,875,204.46

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-113,941,169.72
——股票投资	-113,941,169.72
——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	-113,941,169.72
----	-----------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	780,442.22
转换费收入	15,888.93
合计	796,331.15

- 注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
 2.本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,004,738.72
银行间市场交易费用	-
合计	2,004,738.72

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,688.08
指数使用费	198,451.77
债券账户服务费	9,000.00
合计	318,538.23

- 注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司（“申万宏源”）	基金销售机构、受基金管理人的控股股东（中国建投）控制的公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
申万宏源	47,358,324.62	4.05%	7,987,754.84	0.55%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源	1,022,656.99	100.00%	760,510.20	10.63%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方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 2020年1月1日至2020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
申万宏源	44,104.17	4.73%	1,555.83	0.33%
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日				
关联方名称	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
	7,438.49	0.59%	7,438.49	1.87%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,961,296.20	5,705,020.55
其中：支付销售机构的客户维护费	996,879.99	1,045,852.48

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%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 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	992,259.19	1,141,004.05

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C	合计
国泰基金管理有限公 司	-	1,399.52	1,399.52
合计	-	1,399.52	1,399.52
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰沪深300指数A	国泰沪深300指数C	合计
国泰基金管理有限公 司	-	7,636.40	7,636.40
合计	-	7,636.40	7,636.40

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

国泰沪深 300 指数 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
国泰元鑫资产管理有限公司	1,368,632.83	0.08%	1,368,632.83	0.06%

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	
	2020年1月1日至2020年6月30日	期末余额	2019年1月1日至2019年6月30日	期末余额
中国银行	90,851,325.74	378,303.60	135,240,330.84	531,129.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 2,100,263 股，估值总额为人民币 7,308,915.24 元，占基金资产净值的比例为 0.45%。持有申万宏源集团股份有限公司(受基金管理人控股股东中国建投控制的公司)的 A 股普通股 895,755 股，估值总额为人民币 4,523,562.75 元，占基金资产净值的比例为 0.28%。(于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 3,669,063 股，估值总额为人民币 13,722,295.62 元，占基金资产净值的比例为 0.59%。持有申万宏源集团股份有限公司(受基金管理人控股股东中国建投控制的公司)的 A 股普通股 1,562,255 股，估值总额为人民币 7,826,897.55 元，占基金资产净值的比例为 0.33%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020 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	可流通日	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
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	新股锁定	4.88	6.17	906,536.00	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688599	天合光能	2020-06-02	2020-12-10	新股锁定	8.16	13.91	102,459.00	836,065.44	1,425,204.69	-
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新股锁定	15.48	41.36	26,075.00	403,641.00	1,078,462.00	-
688208	道通科技	2020-02-06	2020-08-13	新股锁定	24.36	54.23	14,165.00	345,059.40	768,167.95	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-07-06	新股锁定	43.98	61.09	4,306.00	189,377.88	263,053.54	-
688228	开普云	2020-03-19	2020-09-28	新股锁定	59.26	73.20	2,718.00	161,068.68	198,957.60	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
688178	万德斯	2020-01-06	2020-07-14	新股锁定	25.20	39.90	3,704.00	93,340.80	147,789.60	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	网下中签	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	网下中签	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	网下中签	11.33	11.33	8,337.00	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	网下中签	15.50	15.50	5,468.00	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	网下中签	6.94	6.94	1,420.00	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	网下中签	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	网下中签	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	网下中签	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-

注：1.根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金属被动式股票指数基金，运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，实现对沪深 300 指数的有效跟踪。

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、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、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行中国银行股份有限公司，与该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 2020 年 06 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2019 年 12 月 31 日：本基金持有信用类债券 0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 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(所有者权益)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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	90,851,325.74	-	-	-	90,851,325.74
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	198,518.70	-	-	-	198,518.70
交易性金融资产	-	-	-	1,518,729,058.11	1,518,729,058.11
应收证券清算款	-	-	-	32,693,976.88	32,693,976.88
应收利息	-	-	-	8,400.50	8,400.50
应收申购款	113,879.56	-	-	1,678,032.52	1,791,912.08
资产总计	91,163,724.00	-	-	1,553,109,468.01	1,644,273,192.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,586,320.32	8,586,320.32
应付管理人报酬	-	-	-	709,556.25	709,556.25
应付托管费	-	-	-	141,911.24	141,911.24
应付销售服务费	-	-	-	814.66	814.66
应付交易费用	-	-	-	464,789.70	464,789.70
应付税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	213,993.42	213,993.42
负债总计	-	-	-	10,117,385.59	10,117,385.59
利率敏感度缺口	91,163,724.00	-	-	1,542,992,082.42	1,634,155,806.42
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日						
资产						
银行存款	147,260,964.26		-	-	-	147,260,964.26
结算备付金	78,023.48		-	-	-	78,023.48
存出保证金	164,928.63		-	-	-	164,928.63
交易性金融资产	-		-	-	2,095,631,869.24	2,095,631,869.24
应收证券清算款	-		-	-	-	-
应收利息	-		-	-	26,359.74	26,359.74
应收申购款	5,477.45		-	-	665,375.09	670,852.54
资产总计	147,509,393.82		-	-	2,096,323,604.07	2,243,832,997.89
负债						
应付销售服务费	-		-	-	397.08	397.08
应付证券清算款	-		-	-	808.60	808.60
应付赎回款	-		-	-	29,583,989.55	29,583,989.55
应付管理人报酬	-		-	-	929,417.16	929,417.16
应付托管费	-		-	-	185,883.42	185,883.42
应付交易费用	-		-	-	239,438.62	239,438.62
应付税费	-		-	-	-	-
其他负债	-		-	-	368,014.04	368,014.04
负债总计	-		-	-	31,307,948.47	31,307,948.47
利率敏感度缺口	147,509,393.82		-	-	2,065,015,655.60	2,212,525,049.42

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00%(2019 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，本基金的基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2020 年 6 月 30 日	占基金资产 公允价值 净值比例 (%)	2019 年 12 月 31 日	占基金资产 公允价值 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,518,729,05 8.11	92.94	2,095,631,869 .24	94.72
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	1,518,729,05 8.11	92.94	2,095,631,869 .24	94.72
----	----------------------	-------	----------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外的其他市场变量不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
分析		本期末	上年度末
	2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日	
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 7,713	增加约 10,391
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 7,713	减少约 10,391

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,508,624,048.54 元, 属于第二层次的余额为 10,105,009.57 元, 无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日: 第一层次 2,084,761,342.86 元, 第二层 10,870,526.38 元, 无第三层次)。于 2020 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2019 年 12 月 31 日: 同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 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。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额 无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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(2019 年 12 月 31 日同)。

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,518,729,058.11	92.36
	其中：股票	1,518,729,058.11	92.36
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	90,851,325.74	5.53
8	其他各项资产	34,692,808.16	2.11
9	合计	1,644,273,192.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	22,120,700.00	1.35
B	采矿业	36,462,064.88	2.23
C	制造业	717,875,847.12	43.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,305,049.40	1.85
E	建筑业	30,104,281.63	1.84
F	批发和零售业	15,322,076.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	48,010,946.33	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,230,262.01	3.69
J	金融业	428,091,182.16	26.20
K	房地产业	56,624,537.84	3.47
L	租赁和商务服务业	21,041,362.70	1.29
M	科学研究和技术服务业	10,869,045.60	0.67
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	1,878,675.00	0.11
Q	卫生和社会工作	17,938,014.17	1.10
R	文化、体育和娱乐业	10,641,944.84	0.65
S	综合	-	-
	合计	1,507,515,989.68	92.25

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	10,662,823.14	0.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	389,689.37	0.02
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	147,789.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,213,068.43	0.69

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	601318	中国平安	1,092,838	78,028,633.20	4.77
2	600519	贵州茅台	50,291	73,569,698.08	4.50
3	600036	招商银行	1,023,885	34,525,402.20	2.11
4	600276	恒瑞医药	368,810	34,041,163.00	2.08
5	000858	五 粮 液	192,923	33,012,983.76	2.02
6	000333	美的集团	492,318	29,435,693.22	1.80
7	000651	格力电器	493,451	27,914,523.07	1.71
8	002475	立讯精密	416,996	21,412,744.60	1.31
9	600030	中信证券	845,552	20,386,258.72	1.25
10	601166	兴业银行	1,258,012	19,851,429.36	1.21
11	600887	伊利股份	608,160	18,932,020.80	1.16

12	000002	万科 A	676,067	17,672,391.38	1.08
13	601398	工商银行	3,477,887	17,319,877.26	1.06
14	600900	长江电力	875,848	16,588,561.12	1.02
15	601888	中国中免	96,960	14,934,748.80	0.91
16	601328	交通银行	2,725,700	13,982,841.00	0.86
17	600585	海螺水泥	253,302	13,402,208.82	0.82
18	300059	东方财富	640,426	12,936,605.20	0.79
19	000001	平安银行	991,175	12,687,040.00	0.78
20	000725	京东方 A	2,688,546	12,555,509.82	0.77
21	002714	牧原股份	152,034	12,466,788.00	0.76
22	600000	浦发银行	1,165,146	12,327,244.68	0.75
23	000661	长春高新	28,316	12,325,954.80	0.75
24	600016	民生银行	2,140,529	12,136,799.43	0.74
25	603288	海天味业	96,567	12,012,934.80	0.74
26	002415	海康威视	371,554	11,276,663.90	0.69
27	600031	三一重工	586,268	10,998,387.68	0.67
28	601688	华泰证券	584,440	10,987,472.00	0.67
29	603259	药明康德	112,516	10,869,045.60	0.67
30	000063	中兴通讯	267,971	10,753,676.23	0.66
31	601012	隆基股份	261,967	10,669,915.91	0.65
32	600048	保利地产	718,125	10,613,887.50	0.65
33	601668	中国建筑	2,199,818	10,493,131.86	0.64
34	600837	海通证券	803,421	10,107,036.18	0.62
35	601288	农业银行	2,926,537	9,891,695.06	0.61
36	000100	TCL 科技	1,581,810	9,807,222.00	0.60
37	300498	温氏股份	442,840	9,653,912.00	0.59
38	600570	恒生电子	83,127	8,952,777.90	0.55
39	600309	万华化学	178,611	8,928,763.89	0.55
40	601601	中国太保	322,300	8,782,675.00	0.54
41	300015	爱尔眼科	200,053	8,692,302.85	0.53
42	601229	上海银行	988,036	8,200,698.80	0.50
43	300142	沃森生物	152,746	7,997,780.56	0.49
44	002142	宁波银行	298,432	7,839,808.64	0.48
45	603986	兆易创新	32,921	7,766,393.11	0.48
46	601211	国泰君安	447,854	7,729,960.04	0.47
47	000338	潍柴动力	548,918	7,531,154.96	0.46
48	601169	北京银行	1,528,929	7,491,752.10	0.46
49	601816	京沪高铁	1,198,136	7,409,995.12	0.45
50	601988	中国银行	2,100,263	7,308,915.24	0.45
51	002352	顺丰控股	131,608	7,198,957.60	0.44
52	600588	用友网络	161,526	7,123,296.60	0.44
53	000568	泸州老窖	78,041	7,111,095.92	0.44
54	600009	上海机场	95,786	6,903,297.02	0.42
55	600690	海尔智家	386,407	6,839,403.90	0.42

56	002304	洋河股份	65,005	6,834,625.70	0.42
57	601766	中国中车	1,207,819	6,727,551.83	0.41
58	002241	歌尔股份	227,368	6,675,524.48	0.41
59	002594	比亚迪	90,102	6,469,323.60	0.40
60	300122	智飞生物	63,600	6,369,540.00	0.39
61	002007	华兰生物	125,768	6,302,234.48	0.39
62	601009	南京银行	855,760	6,272,720.80	0.38
63	002410	广联达	89,763	6,256,481.10	0.38
64	000876	新希望	209,537	6,244,202.60	0.38
65	600999	招商证券	284,285	6,240,055.75	0.38
66	601818	光大银行	1,713,095	6,132,880.10	0.38
67	600104	上汽集团	358,215	6,086,072.85	0.37
68	600703	三安光电	243,093	6,077,325.00	0.37
69	601899	紫金矿业	1,362,981	5,997,116.40	0.37
70	600919	江苏银行	1,039,027	5,891,283.09	0.36
71	002555	三七互娱	125,805	5,887,674.00	0.36
72	002230	科大讯飞	152,801	5,719,341.43	0.35
73	002027	分众传媒	1,020,670	5,685,131.90	0.35
74	000895	双汇发展	122,903	5,664,599.27	0.35
75	600745	闻泰科技	44,800	5,642,560.00	0.35
76	300601	康泰生物	33,600	5,448,576.00	0.33
77	300347	泰格医药	52,300	5,328,324.00	0.33
78	600028	中国石化	1,328,921	5,196,081.11	0.32
79	001979	招商蛇口	314,475	5,169,969.00	0.32
80	600436	片仔癀	30,198	5,141,209.50	0.31
81	000776	广发证券	349,271	4,931,706.52	0.30
82	601628	中国人寿	178,167	4,847,924.07	0.30
83	601088	中国神华	336,877	4,837,553.72	0.30
84	000538	云南白药	51,095	4,793,221.95	0.29
85	600547	山东黄金	129,258	4,733,427.96	0.29
86	600406	国电南瑞	229,273	4,642,778.25	0.28
87	601006	大秦铁路	657,496	4,628,771.84	0.28
88	300413	芒果超媒	70,860	4,620,072.00	0.28
89	000166	申万宏源	895,755	4,523,562.75	0.28
90	300003	乐普医疗	123,860	4,523,367.20	0.28
91	600050	中国联通	924,675	4,475,427.00	0.27
92	600438	通威股份	255,611	4,442,519.18	0.27
93	002271	东方雨虹	109,000	4,428,670.00	0.27
94	300014	亿纬锂能	91,278	4,367,652.30	0.27
95	000938	紫光股份	101,454	4,360,492.92	0.27
96	002129	中环股份	194,000	4,357,240.00	0.27
97	002371	北方华创	24,700	4,221,477.00	0.26
98	601939	建设银行	666,554	4,205,955.74	0.26
99	600019	宝钢股份	908,027	4,140,603.12	0.25

100	300136	信维通信	77,093	4,087,470.86	0.25
101	002460	赣锋锂业	76,034	4,073,141.38	0.25
102	601336	新华保险	91,940	4,071,103.20	0.25
103	601390	中国中铁	809,733	4,064,859.66	0.25
104	600196	复星医药	120,071	4,064,403.35	0.25
105	601857	中国石油	965,047	4,043,546.93	0.25
106	603160	汇顶科技	18,101	4,034,712.90	0.25
107	600015	华夏银行	651,343	3,986,219.16	0.24
108	603019	中科曙光	103,580	3,977,472.00	0.24
109	000977	浪潮信息	100,400	3,933,672.00	0.24
110	300124	汇川技术	103,220	3,921,327.80	0.24
111	002044	美年健康	271,852	3,917,387.32	0.24
112	002050	三花智控	178,306	3,904,901.40	0.24
113	601377	兴业证券	562,738	3,854,755.30	0.24
114	601186	中国铁建	457,310	3,832,257.80	0.23
115	600809	山西汾酒	26,203	3,799,435.00	0.23
116	002602	世纪华通	247,170	3,784,172.70	0.23
117	300144	宋城演艺	216,869	3,751,833.70	0.23
118	002311	海大集团	78,749	3,747,664.91	0.23
119	002001	新和成	128,100	3,727,710.00	0.23
120	002624	完美世界	64,290	3,705,675.60	0.23
121	300433	蓝思科技	130,846	3,668,921.84	0.22
122	002456	欧菲光	199,363	3,666,285.57	0.22
123	601225	陕西煤业	507,912	3,662,045.52	0.22
124	601989	中国重工	903,917	3,615,668.00	0.22
125	601933	永辉超市	380,004	3,564,437.52	0.22
126	603501	韦尔股份	17,400	3,513,930.00	0.22
127	002236	大华股份	178,961	3,437,840.81	0.21
128	600352	浙江龙盛	265,187	3,391,741.73	0.21
129	600741	华域汽车	162,764	3,383,863.56	0.21
130	600958	东方证券	355,295	3,371,749.55	0.21
131	000157	中联重科	515,515	3,314,761.45	0.20
132	600183	生益科技	113,000	3,307,510.00	0.20
133	002024	苏宁易购	369,414	3,239,760.78	0.20
134	600340	华夏幸福	137,276	3,138,129.36	0.19
135	002008	大族激光	87,285	3,137,895.75	0.19
136	601788	光大证券	194,573	3,124,842.38	0.19
137	002202	金风科技	313,060	3,121,208.20	0.19
138	002736	国信证券	273,254	3,087,770.20	0.19
139	000783	长江证券	455,298	3,068,708.52	0.19
140	600383	金地集团	223,815	3,066,265.50	0.19
141	002463	沪电股份	120,200	3,002,596.00	0.18
142	601138	工业富联	197,494	2,992,034.10	0.18
143	000860	顺鑫农业	51,900	2,957,262.00	0.18

144	000625	长安汽车	267,990	2,947,890.00	0.18
145	600346	恒力石化	209,700	2,935,800.00	0.18
146	600660	福耀玻璃	139,430	2,909,904.10	0.18
147	601901	方正证券	408,191	2,889,992.28	0.18
148	600926	杭州银行	322,449	2,876,245.08	0.18
149	300408	三环集团	103,505	2,867,088.50	0.18
150	300033	同花顺	21,501	2,861,353.08	0.18
151	601877	正泰电器	106,791	2,813,942.85	0.17
152	002120	韵达股份	115,055	2,813,094.75	0.17
153	601155	新城控股	89,826	2,806,164.24	0.17
154	600522	中天科技	244,017	2,793,994.65	0.17
155	000425	徐工机械	465,618	2,751,802.38	0.17
156	601669	中国电建	794,045	2,747,395.70	0.17
157	600109	国金证券	240,398	2,742,941.18	0.17
158	603799	华友钴业	68,275	2,653,166.50	0.16
159	002841	视源股份	26,200	2,607,424.00	0.16
160	603993	洛阳钼业	700,485	2,570,779.95	0.16
161	601108	财通证券	250,300	2,565,575.00	0.16
162	601800	中国交建	349,227	2,563,326.18	0.16
163	600606	绿地控股	412,083	2,546,672.94	0.16
164	600705	中航资本	641,123	2,538,847.08	0.16
165	600029	南方航空	489,661	2,531,547.37	0.15
166	601985	中国核电	617,976	2,527,521.84	0.15
167	601555	东吴证券	308,486	2,517,245.76	0.15
168	600089	特变电工	368,904	2,497,480.08	0.15
169	603369	今世缘	62,500	2,486,875.00	0.15
170	000069	华侨城 A	407,802	2,471,280.12	0.15
171	600867	通化东宝	141,500	2,466,345.00	0.15
172	600010	包钢股份	2,262,671	2,443,684.68	0.15
173	000768	中航飞机	137,677	2,442,389.98	0.15
174	002916	深南电路	14,320	2,398,886.40	0.15
175	000963	华东医药	93,083	2,354,999.90	0.14
176	002493	荣盛石化	187,700	2,308,710.00	0.14
177	000066	中国长城	174,900	2,308,680.00	0.14
178	002179	中航光电	54,598	2,239,063.98	0.14
179	600487	亨通光电	136,100	2,233,401.00	0.14
180	600115	东方航空	526,058	2,219,964.76	0.14
181	600886	国投电力	277,589	2,181,849.54	0.13
182	002157	正邦科技	124,300	2,172,764.00	0.13
183	600795	国电电力	1,172,191	2,168,553.35	0.13
184	600061	国投资本	167,658	2,134,286.34	0.13
185	603658	安图生物	13,100	2,127,964.00	0.13
186	601100	恒立液压	26,500	2,125,300.00	0.13
187	601607	上海医药	115,028	2,114,214.64	0.13

188	002422	科伦药业	100,276	2,105,796.00	0.13
189	600893	航发动力	89,443	2,100,121.64	0.13
190	002146	荣盛发展	256,062	2,074,102.20	0.13
191	002466	天齐锂业	90,239	2,070,985.05	0.13
192	601997	贵阳银行	285,122	2,041,473.52	0.12
193	600498	烽火通信	69,841	2,019,103.31	0.12
194	601066	中信建投	51,100	2,012,318.00	0.12
195	600111	北方稀土	215,813	2,011,377.16	0.12
196	601162	天风证券	331,650	2,009,799.00	0.12
197	603899	晨光文具	36,800	2,009,280.00	0.12
198	601111	中国国航	303,776	2,007,959.36	0.12
199	600637	东方明珠	203,364	1,962,462.60	0.12
200	600332	白云山	59,222	1,914,647.26	0.12
201	600176	中国巨石	209,200	1,914,180.00	0.12
202	002607	中公教育	67,700	1,878,675.00	0.11
203	002601	龙蟠科技	101,094	1,870,239.00	0.11
204	601360	三六零	101,200	1,852,972.00	0.11
205	300628	亿联网络	27,057	1,846,910.82	0.11
206	600011	华能国际	436,300	1,841,186.00	0.11
207	601727	上海电气	363,744	1,833,269.76	0.11
208	600233	圆通速递	125,801	1,831,662.56	0.11
209	600118	中国卫星	58,804	1,812,927.32	0.11
210	600271	航天信息	111,407	1,809,249.68	0.11
211	000786	北新建材	84,300	1,798,119.00	0.11
212	601600	中国铝业	650,498	1,795,374.48	0.11
213	601618	中国中冶	709,272	1,780,272.72	0.11
214	000728	国元证券	210,000	1,764,000.00	0.11
215	000596	古井贡酒	11,600	1,742,784.00	0.11
216	000656	金科股份	212,600	1,734,816.00	0.11
217	003816	中国广核	584,900	1,731,304.00	0.11
218	600221	海航控股	1,143,897	1,715,845.50	0.10
219	601838	成都银行	215,100	1,712,196.00	0.10
220	002252	上海莱士	200,200	1,693,692.00	0.10
221	600489	中金黄金	185,230	1,693,002.20	0.10
222	000703	恒逸石化	183,590	1,676,176.70	0.10
223	601919	中远海控	482,052	1,672,720.44	0.10
224	600170	上海建工	536,755	1,647,837.85	0.10
225	600177	雅戈尔	275,683	1,643,070.68	0.10
226	600068	葛洲坝	275,034	1,636,452.30	0.10
227	000961	中南建设	183,582	1,633,879.80	0.10
228	600066	宇通客车	132,479	1,616,243.80	0.10
229	600390	五矿资本	223,800	1,580,028.00	0.10
230	601998	中信银行	305,606	1,573,870.90	0.10
231	600004	白云机场	102,500	1,562,100.00	0.10

232	601198	东兴证券	137,735	1,501,311.50	0.09
233	600674	川投能源	159,565	1,479,167.55	0.09
234	601881	中国银河	128,536	1,474,307.92	0.09
235	603833	欧派家居	12,710	1,473,089.00	0.09
236	600085	同仁堂	54,278	1,472,019.36	0.09
237	002508	老板电器	47,300	1,471,503.00	0.09
238	600018	上港集团	345,707	1,451,969.40	0.09
239	600219	南山铝业	713,330	1,448,059.90	0.09
240	600516	方大炭素	227,779	1,430,452.12	0.09
241	002673	西部证券	173,861	1,418,705.76	0.09
242	601231	环旭电子	64,808	1,415,406.72	0.09
243	600208	新湖中宝	469,498	1,399,104.04	0.09
244	600998	九州通	75,000	1,396,500.00	0.09
245	601018	宁波港	390,705	1,394,816.85	0.09
246	600362	江西铜业	102,772	1,383,311.12	0.08
247	600655	豫园股份	154,400	1,367,984.00	0.08
248	601319	中国人保	212,100	1,365,924.00	0.08
249	600760	中航沈飞	41,600	1,365,312.00	0.08
250	601117	中国化学	244,297	1,338,747.56	0.08
251	601878	浙商证券	132,231	1,310,409.21	0.08
252	002773	康弘药业	26,160	1,297,536.00	0.08
253	600297	广汇汽车	402,564	1,284,179.16	0.08
254	601021	春秋航空	36,424	1,283,581.76	0.08
255	600369	西南证券	278,841	1,279,880.19	0.08
256	002938	鹏鼎控股	25,467	1,274,878.02	0.08
257	600848	上海临港	59,200	1,271,024.00	0.08
258	002739	万达电影	82,900	1,265,883.00	0.08
259	002153	石基信息	31,765	1,239,787.95	0.08
260	601658	邮储银行	267,800	1,223,846.00	0.07
261	002958	青农商行	275,200	1,219,136.00	0.07
262	600038	中直股份	29,537	1,213,084.59	0.07
263	002032	苏 泊 尔	16,500	1,171,500.00	0.07
264	002939	长城证券	92,200	1,135,904.00	0.07
265	600027	华电国际	323,900	1,107,738.00	0.07
266	603156	养元饮品	50,171	1,078,676.50	0.07
267	002558	巨人网络	59,992	1,043,860.80	0.06
268	000627	天茂集团	197,420	1,028,558.20	0.06
269	000671	阳 光 城	161,964	1,026,851.76	0.06
270	600482	中国动力	64,691	1,015,648.70	0.06
271	601992	金隅集团	329,335	1,007,765.10	0.06
272	600583	海油工程	220,743	1,004,380.65	0.06
273	600977	中国电影	76,478	1,004,156.14	0.06
274	002468	申通快递	60,600	994,446.00	0.06
275	601633	长城汽车	120,810	932,653.20	0.06

276	601916	浙商银行	217,400	856,556.00	0.05
277	000709	河钢股份	419,791	856,373.64	0.05
278	601216	君正集团	336,234	854,034.36	0.05
279	601238	广汽集团	92,780	835,020.00	0.05
280	601577	长沙银行	101,200	803,528.00	0.05
281	600188	兖州煤业	90,814	795,530.64	0.05
282	600398	海澜之家	132,759	772,657.38	0.05
283	601808	中海油服	58,800	772,632.00	0.05
284	601236	红塔证券	39,500	766,300.00	0.05
285	000723	美锦能源	122,200	764,972.00	0.05
286	601698	中国卫通	40,100	722,201.00	0.04
287	600372	中航电子	53,067	706,852.44	0.04
288	600928	西安银行	132,700	698,002.00	0.04
289	601898	中煤能源	180,896	687,404.80	0.04
290	600989	宝丰能源	80,900	681,178.00	0.04
291	600025	华能水电	179,200	679,168.00	0.04
292	000708	中信特钢	35,300	603,277.00	0.04
293	601077	渝农商行	115,200	543,744.00	0.03
294	600968	海油发展	201,100	468,563.00	0.03
295	601828	美凯龙	39,800	421,482.00	0.03
296	603260	合盛硅业	14,301	390,989.34	0.02
297	601298	青岛港	68,700	390,216.00	0.02
298	601212	白银有色	149,099	380,202.45	0.02
299	002945	华林证券	27,000	372,870.00	0.02
300	600299	安迪苏	29,900	365,378.00	0.02

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	688012	中微公司	23,850	5,230,543.50	0.32
2	688599	天合光能	102,459	1,425,204.69	0.09
3	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.07
4	688298	东方生物	5,286	810,343.80	0.05
5	688208	道通科技	14,165	768,167.95	0.05
6	688268	华特气体	5,216	482,740.80	0.03
7	688181	八亿时空	4,306	263,053.54	0.02
8	688228	开普云	2,718	198,957.60	0.01
9	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
10	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.01
11	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
12	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01

13	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
14	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
15	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
16	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
17	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
18	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
19	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
20	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
21	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
22	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
23	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
24	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	601318	中国平安	11,247,713.27	0.51
2	601816	京沪高铁	8,286,053.88	0.37
3	600519	贵州茅台	6,822,386.00	0.31
4	601398	工商银行	5,567,488.00	0.25
5	600745	闻泰科技	5,026,229.00	0.23
6	300601	康泰生物	4,806,633.76	0.22
7	600036	招商银行	4,700,207.64	0.21
8	000977	浪潮信息	4,040,038.61	0.18
9	002371	北方华创	3,938,713.00	0.18
10	002129	中环股份	3,907,947.00	0.18
11	300014	亿纬锂能	3,861,893.39	0.17
12	000651	格力电器	3,846,921.00	0.17
13	600276	恒瑞医药	3,569,213.00	0.16
14	002714	牧原股份	3,563,944.10	0.16
15	000333	美的集团	3,341,206.00	0.15
16	601166	兴业银行	3,289,443.00	0.15
17	000002	万科 A	3,092,396.00	0.14
18	000860	顺鑫农业	3,078,381.00	0.14
19	002463	沪电股份	2,996,064.69	0.14
20	000858	五粮液	2,965,881.00	0.13

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交量）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	601318	中国平安	52,769,537.76	2.39
2	600519	贵州茅台	40,536,708.47	1.83
3	600036	招商银行	22,598,182.94	1.02
4	000651	格力电器	18,888,831.14	0.85
5	601166	兴业银行	18,802,197.00	0.85
6	600276	恒瑞医药	18,521,578.97	0.84
7	000858	五 粮 液	17,717,199.67	0.80
8	000333	美的集团	17,578,454.31	0.79
9	601288	农业银行	11,564,339.00	0.52
10	600887	伊利股份	11,518,249.10	0.52
11	600016	民生银行	11,058,033.49	0.50
12	600030	中信证券	10,485,038.88	0.47
13	002475	立讯精密	10,011,665.92	0.45
14	600900	长江电力	9,659,689.23	0.44
15	002714	牧原股份	8,959,125.30	0.40
16	601328	交通银行	8,891,871.73	0.40
17	000001	平安银行	8,786,363.00	0.40
18	000002	万 科 A	8,644,198.00	0.39
19	600000	浦发银行	7,913,465.95	0.36
20	002415	海康威视	7,407,406.45	0.33

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	277,215,194.62
卖出股票的收入（成交）总额	911,570,427.09

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“兴业银行”、“招商银行”、“中信证券”公告自身或其分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

兴业银行烟台、杭州等下属分行、支行由于票据业务贸易背景审查不尽职、贷款业务检查不尽职和受托支付审核不到位，项目贷款资金被借款人股东挪用于支付地块保证金等原因分别受到当地银保监局罚款、责令改正等监管处罚。

招商银行杭州、太原等下属分行、支行由于签订关键要素空白的合同和借据、发放未办理网签合同且楼盘未封顶的个人住房按揭贷款等原因分别受到当地银保监局罚款、责令改正等监管处罚。

中信证券广州番禺万达广场证券营业部、北京紫竹院路证券营业部由于未及时披露公司重大事项，分别受到证监会广东、北京监管局责令改正等监管措施。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	198,518.70
2	应收证券清算款	32,693,976.88
3	应收股利	-
4	应收利息	8,400.50
5	应收申购款	1,791,912.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,692,808.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688599	天合光能	1,425,204.69	0.09	新股锁定
2	688106	金宏气体	1,078,462.00	0.07	新股锁定
3	688208	道通科技	768,167.95	0.05	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

份额级别	持有人	户均持有	持有人结构

	户数(户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
国泰沪深 300 指数 A	88,041	19,792.08	4,921,076.58	0.28%	1,737,593,104.36	99.72%
国泰沪深 300 指数 C	81	26,703.28	-	-	2,162,965.93	100.00%
合计	88,122	19,798.43	4,921,076.58	0.28%	1,739,756,070.29	99.72%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	国泰沪深 300 指数 A	1,107,984.96	0.06%
	国泰沪深 300 指数 C	24,614.48	1.14%
	合计	1,132,599.44	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	国泰沪深 300 指数 A	50~100
	国泰沪深 300 指数 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开 放式基金	国泰沪深 300 指数 A	0~10
	国泰沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	国泰沪深 300 指数 A	国泰沪深 300 指数 C
基金合同生效日(2007 年 11 月 11 日)基金份额总额	347,989,794.67	-
本报告期期初基金份额总额	2,426,100,148.39	1,010,682.82
本报告期基金总申购份额	480,922,397.28	3,873,864.94
减: 本报告期基金总赎回份额	1,164,508,364.73	2,721,581.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,742,514,180.94	2,162,965.93

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：

2020 年 2 月 15 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》，经本基金管理人第七届董事会第二十八次会议审议通过，李永梅女士不再担任本基金管理人副总经理。

本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

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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

本报告期内，基金管理人、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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	436,384,375.19	37.32%	319,128.37	34.24%	-
长江证券	1	268,872,240.55	23.00%	196,626.95	21.10%	-
中信证券	1	205,335,008.75	17.56%	191,228.45	20.52%	-
银河证券	1	100,009,587.27	8.55%	93,139.73	9.99%	-
申万宏源	1	47,358,324.62	4.05%	44,104.17	4.73%	-

中金证券	2	38,976,135.65	3.33%	28,503.16	3.06%	-
中信建投	3	32,552,499.31	2.78%	30,316.22	3.25%	-
东方证券	1	25,342,908.04	2.17%	18,533.09	1.99%	-
中金财富	1	8,519,241.65	0.73%	6,230.14	0.67%	-
华西证券	1	5,839,152.03	0.50%	4,153.29	0.45%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
安信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1,022,656 .99	100.00%	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金旗下基金在 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告	《中国证券报》	2020-01-29
2	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2020-02-15
3	国泰基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020-03-17
4	国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法份子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	《公司官网》	2020-04-04
5	国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	《公司官网》	2020-05-20
6	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》	2020-06-03

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于核准国泰金象保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复
- 2、国泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰沪深 300 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

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 16-19 层。

本基金托管人住所。

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

二〇二〇年八月三十一日