

国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 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	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	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
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真实、准确和完整发表意见	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
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	41
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48

8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
9 开放式基金份额变动	51
10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录	53
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰上证综合 ETF
场内简称	上证 ETF
基金主代码	510760
交易代码	510760
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 21 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	266,503,665.00 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	2020 年 9 月 9 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；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，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	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	周直毅
	联系电话	021-31081600转	021-68475608
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95594
传真		021-31081800	021-68476936
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	中国（上海）自由贸易试验区

	浦东大道1200号2层225室	银城中路168号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路168号42层
邮政编码	200082	200120
法定代表人	邱军	金煜

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	38,750,275.82
本期利润	26,671,561.10
加权平均基金份额本期利润	0.0699
本期加权平均净值利润率	6.89%
本期基金份额净值增长率	4.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	12,740,854.51
期末可供分配基金份额利润	0.0478
期末基金资产净值	279,244,519.51
期末基金份额净值	1.0478
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.78%

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）本基金合同生效日为 2020 年 8 月 21 日，截止至 2021 年 6 月 30 日不满一年。

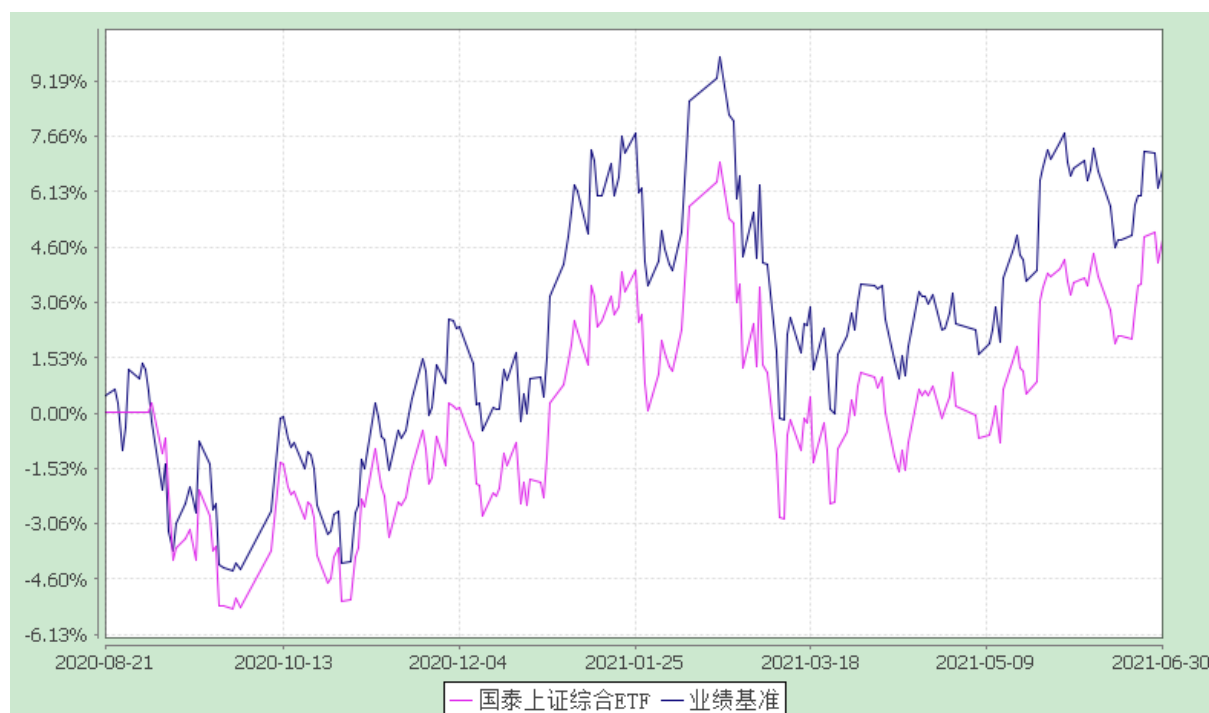
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.74%	0.58%	-0.67%	0.59%	1.41%	-0.01%
过去三个月	4.86%	0.67%	4.34%	0.69%	0.52%	-0.02%
过去六个月	4.50%	0.94%	3.40%	0.94%	1.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.78%	0.90%	6.76%	0.93%	-1.98%	-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

国泰上证综合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
 (2020 年 8 月 21 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金的合同生效日为 2020 年 8 月 21 日，截止至 2021 年 6 月 30 日不满一年。

（2）本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 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、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、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证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、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

食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、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、国泰聚瑞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、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题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、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。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		
梁杏	国泰中证生物 医药 ETF 联 接、国泰国 证医药卫生行业 指数、国泰国 证食品饮料行业 指数、国泰 量化收益灵活 配置混合、国 泰中证生物医 药 ETF、国泰 CES 半导体芯 片行业 ETF 联 接、国泰上 证综合 ETF、国 泰中证医疗 ETF、国泰上 证综合 ETF 联 接、国泰中 证全指软件 ETF、国泰中 证畜牧养殖 ETF、国泰中 证医疗 ETF 联 接、国泰中 证全指软件 ETF 联接、国泰中 证畜牧养殖 ETF 联接的基 金经理、量化 投资（事业） 部总监	2020-08-2 1	-	14 年	学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月 在华安基金管理有限公司担任高 级区域经理。2011 年 7 月加入国 泰基金管理有限公司, 历任产品品 牌经理、研究员、基金经理助理。 2016 年 6 月至 2020 年 12 月任国 泰国证医药卫生行业指数分级证 券投资基金和国泰国证食品饮料 行业指数分级证券投资基金的基 金经理, 2018 年 1 月至 2019 年 4 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 7 月起兼任国泰量化收益 灵活配置混合型证券投资基金的 基金经理, 2019 年 4 月起兼任国 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, 2019 年 11 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）的基金经理, 2020 年 1 月至 2021 年 1 月任国泰中证煤炭 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 泰中证钢铁交易型开放式指数证 券投资基金的基金经理, 2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开 放式指数证券投资基金的基金经 理, 2020 年 12 月起兼任国泰中 证医疗交易型开放式指数证券投资 基金的基金经理, 2021 年 1 月起 兼任国泰国证医药卫生行业指数 证券投资基金(由国泰国证医药卫 生行业指数分级证券投资基金终 止分级运作变更而来)、国泰国证

					食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）和国泰上证综合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 2 月起兼任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月起兼任国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件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 7 月起兼任国泰中证畜牧养殖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。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资（事业）部副总监，2018 年 7 月起任量化投资（事业）部总监。
谢东旭	国泰沪深 300 指数增强、国泰中证 500 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰上证综合 ETF 联接、国泰创业板指数（LOF）、国泰中证煤炭 ETF 联接、国泰中证钢铁 ETF 联接、国泰中证新能源汽车 ETF 联接、国泰中证全指家	2020-08-21	-	10 年	硕士研究生。曾任职于中信证券、华安基金管理有限公司、创金合信基金管理有限公司。2018 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，任基金经理助理。2019 年 11 月至 2020 年 12 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）和国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰沪深 300 指数证券投资基金和国泰上证综合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 7 月起兼任国泰创业板指数证

	用电器 ETF 联接、国泰国证房地产行业指数的基金经理				券投资基金（LOF）、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、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和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的基金经理。
--	-----------------------------	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年是十四五的开局之年，疫苗已陆续获批，全球来看新冠疫情仍存在较大的不确定性，疫苗已陆续获批，随着新冠疫苗接种在主要经济体的逐步推广，市场对全球经济复苏的前景较为乐观；国内来看受去年低基数的影响，预计今年整体经济增长较好，从财政和货币政策的执行来看，去年对冲疫情对经济冲击的临时性政策正逐步有序退出，宏观流动性呈现边际收紧态势，A 股市场上前期受资金追捧的核心资产以及绝对估值水平较高、弹性较大的行业如军工、证券、新能源汽车、电子半导体等调整幅度较大，绝对估值水平较低、分红率较高的低估值板块如钢铁、银行表现不俗。

一季度来看，上证指数微跌 0.9%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 2.78%，沪深 300 指数下跌 3.13%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 1.78%，板块上科技股占比较多的创业板指下跌 7%，科创板 50 下跌 10.39%。

二季度在迎接中国共产党成立 100 周年的氛围下，政策总体偏暖，市场流动性边际趋松，在基数效应逐步减弱的情况下，上市公司经营业绩更能较客观的得到反映。随着季末的临近，科创板推出 2 周年临近，科创板上市公司的科创成色逐步显现，业绩预期普遍表现出色，高景气度行业上市公司业绩预增提振了市场做多热情，市场风格相较一季度发生了较大的变化，包括半导体芯片、新能源汽车、医疗等表现出色，中证新能源汽车指数、中华半导体芯片指数季度涨幅分别达到 45.74%、41.04%，一季度表现较好的银行等低市盈率板块表现相对逊色。

二季度，上证指数上涨 4.34%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 下跌 1.15%，沪深 300 指数上涨 3.48%，成长性中盘股表征指数如中证 500 上涨 8.86%，板块上科技股占比较多的创业板指上涨 26.05%，科创板 50 上涨 27.23%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2021 年上半年的净值增长率为 4.50%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着新冠疫苗在主要经济体的逐步接种并普及，全球经济有望从新冠疫情的阴霾中逐步恢复，不过经济总体上仍然比较脆弱，尤其是在中国经济体量逐步赶超主要发达国家的过程中，全球位居前列的经济体的博弈和竞争料将带来更多的不确定性，我们预计政策料将保持温和，兼具行业高景气度和未来经济社会发展方向的新能源领域以及包括半导体芯片为代表的科技领域投资价值逐步凸显，兼具高景气度以及为我国经济体量相匹配的军工行业是我们中长期坚定看好的方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,998,666.12	6,047,110.28
结算备付金		1,238,355.45	4,903,996.13
存出保证金		25,521.03	737,731.46
交易性金融资产	6.4.7.2	272,078,623.29	821,601,374.70
其中：股票投资		271,729,623.29	821,301,494.70
基金投资		-	-
债券投资		349,000.00	299,880.00
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		221,514.27	307,276.70
应收利息	6.4.7.5	3,048.86	3,830.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		279,565,729.02	833,601,319.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		122,514.16	376,068.24
应付托管费		24,502.84	75,213.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	35,550.10	159,664.46
应交税费		-	2.72
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	138,642.41	226,694.42
负债合计		321,209.51	837,643.50
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	266,503,665.00	830,503,665.00
未分配利润	6.4.7.10	12,740,854.51	2,260,010.95
所有者权益合计		279,244,519.51	832,763,675.95
负债和所有者权益总计		279,565,729.02	833,601,319.45

注：（1）报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0478 元，基金份额总额 266,503,665.00 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2021 年上半年和 2020 年 8 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		28,466,525.92
1.利息收入		37,344.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,228.61
债券利息收入		115.41
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）		40,564,551.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	37,247,798.64
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	152,869.84
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	3,163,883.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-12,078,714.72
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	-56,654.92
减：二、费用		1,794,964.82
1. 管理人报酬		967,684.24
2. 托管费		193,536.85
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	460,031.22
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	173,712.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,671,561.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,671,561.10

注：本基金成立于 2020 年 8 月 21 日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	830,503,665.00	2,260,010.95	832,763,675.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,671,561.10	26,671,561.10
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）	-564,000,000.00	-16,190,717.54	-580,190,717.54
其中：1.基金申购款	546,000,000.00	3,816,283.38	549,816,283.38
2.基金赎回款	-1,110,000,000.00	-20,007,000.92	-1,130,007,000.92
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）	266,503,665.00	12,740,854.51	279,244,519.51

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 21 日，因此无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰上证综合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[2020]1555 号《关于准予国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，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《国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,313,503,665.00 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(2020)第 0708 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,313,503,665.00 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，基金托管人为中上海银行股

份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字自律监管决定书[2020]第 297 号文审核同意,本基金于 2020 年 9 月 9 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《国泰上证综合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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即上证综合指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,998,666.12
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,998,666.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		263,583,539.01	271,729,623.29	8,146,084.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	349,000.00	349,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	349,000.00	349,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		263,932,539.01	272,078,623.29	8,146,084.28

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,454.95
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	557.30
应收债券利息	25.11
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	11.50
合计	3,048.86

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	35,550.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	35,550.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提费用	103,642.41
应付指数使用费	35,000.00
合计	138,642.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	830,503,665.00	830,503,665.00
本期申购	546,000,000.00	546,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,110,000,000.00	-1,110,000,000.00
本期末	266,503,665.00	266,503,665.00

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。

6.4.7.10 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	-13,444,642.19	15,704,653.14	2,260,010.95
本期利润	38,750,275.82	-12,078,714.72	26,671,561.10
本期基金份额交易产生的变动数	-4,238,631.30	-11,952,086.24	-16,190,717.54
其中：基金申购款	24,272,863.24	-20,456,579.86	3,816,283.38
基金赎回款	-28,511,494.54	8,504,493.62	-20,007,000.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,067,002.33	-8,326,147.82	12,740,854.51

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,671.51
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	4,827.84
其他	3,729.26
合计	37,228.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,164,173.49
股票投资收益——赎回差价收入	31,083,625.15
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	37,247,798.64

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	297,438,071.25
减：卖出股票成本总额	291,273,897.76
买卖股票差价收入	6,164,173.49

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,130,007,000.92
减：现金支付赎回款总额	867,269.92
减：赎回股票成本总额	1,098,056,105.85
赎回差价收入	31,083,625.15

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,047,988.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	895,000.00
减：应收利息总额	119.07

买卖债券差价收入	152,869.84
----------	------------

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,163,883.06
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	3,163,883.06

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-12,078,714.72
——股票投资	-12,018,834.72
——债券投资	-59,880.00
——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	-12,078,714.72

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

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-

ETF 替代损益	-56,654.92
合计	-56,654.92

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	460,031.22
银行间市场交易费用	-
合计	460,031.22

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	44,135.04
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	70.00
指数使用费	70,000.00
合计	173,712.41

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 0.03% 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 35,000.00 元，当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。

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
国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰上证综合 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	967,684.24
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 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 $\times$ 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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	193,536.85

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 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

本基金本报告期未发生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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行	5,998,666.12	28,671.51

注：本基金的银行活期存款由基金托管人上海银行保管，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

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股锁定	150.50	524.08	638.00	96,019.00	334,363.04	-
688690	纳微科技	2021-06-16	2021-12-23	新股锁定	8.07	79.89	3,477.00	28,059.39	277,777.53	-
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	29.53	129.46	1,687.00	49,817.11	218,399.02	-

688183	生益电子	2021-02-10	2021-08-25	新股锁定	12.42	14.19	12,589.00	156,355.38	178,637.91	-
688660	电气风电	2021-05-11	2021-01-19	新股锁定	5.44	7.26	20,222.00	110,007.68	146,811.72	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	新股锁定	19.11	32.62	2,789.00	53,297.79	90,977.18	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	网下中签	38.85	38.85	2,017.00	78,360.45	78,360.45	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-00-08	新股锁定	34.50	80.72	918.00	31,671.00	74,100.96	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-00-08	新股锁定	11.38	17.74	3,203.00	36,450.14	56,821.22	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下中签	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	网下中签	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
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	可流通日	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
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	老股配债	100.00	100.00	3,200.00	320,000.00	320,000.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	老股配债	100.00	100.00	290.00	29,000.00	29,000.00	-

注：1、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。

2、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	----------	--------	--------	----

						价				
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项	3.05	2021-07-14	3.36	196,100.00	650,951.47	598,105.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。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、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人上海银行，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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.13%(2020 年 12 月 31 日：0.04%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2021 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 2021 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	5,998,666.12	-	-	-	5,998,666.12
结算备付金	1,238,355.45	-	-	-	1,238,355.45
存出保证金	25,521.03	-	-	-	25,521.03
交易性金融资产	-	-	349,000.00	271,729,623.29	272,078,623.29
应收证券清算款	-	-	-	221,514.27	221,514.27
应收利息	-	-	-	3,048.86	3,048.86
资产总计	7,262,542.60	-	349,000.00	271,954,186.42	279,565,729.02

					2
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	122,514.16	122,514.16
应付托管费	-	-	-	24,502.84	24,502.84
应付交易费用	-	-	-	35,550.10	35,550.10
其他负债	-	-	-	138,642.41	138,642.41
负债总计	-	-	-	321,209.51	321,209.51
利率敏感度缺口	7,262,542.60	-	349,000.00	271,632,976.91	279,244,519.51
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,047,110.28	-	-	-	6,047,110.28
结算备付金	4,903,996.13	-	-	-	4,903,996.13
存出保证金	737,731.46	-	-	-	737,731.46
交易性金融资产	-	-	299,880.00	821,301,494.70	821,601,374.70
应收证券清算款	-	-	-	307,276.70	307,276.70
应收利息	-	-	-	3,830.18	3,830.18
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	11,688,837.87	-	299,880.00	821,612,601.58	833,601,319.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	376,068.24	376,068.24
应付托管费	-	-	-	75,213.66	75,213.66
应付交易费用	-	-	-	159,664.46	159,664.46
应交税费	-	-	-	2.72	2.72
其他负债	-	-	-	226,694.42	226,694.42
负债总计	-	-	-	837,643.50	837,643.50
利率敏感度缺口	11,688,837.87	-	299,880.00	820,774,958.08	832,763,675.95

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 2021 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资产净值的比例为 0.12%(2020 年 12 月 31 日:0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 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币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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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)。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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	
	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金资产

		产净值比 例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	271,729,623.29	97.31	821,301,494.7 0	98.62
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	271,729,623.29	97.31	821,301,494.7 0	98.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 269,584,388.13 元，第二层次的余额为 2,494,235.16 元，无属于第三层次的余额。(2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 819,932,142.37 元，第二层次的余额为 1,669,232.33 元，无属于第三层次的余额)。

(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,本基金分别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不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或第三层次。

(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 2021 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(2020 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)基金申购款

于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间,本基金申购基金份额的对价总额为 549,816,283.38 元,其中包括以股票支付的申购款 517,745,669.07 元和以现金支付的申购款 32,070,614.31 元。

(3)除公允价值和基金申购款外,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	271,729,623.29	97.20
	其中:股票	271,729,623.29	97.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	349,000.00	0.12
	其中:债券	349,000.00	0.12
	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	7,237,021.57	2.59
8	其他各项资产	250,084.16	0.09
9	合计	279,565,729.02	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	1,367,344.00	0.49
B	采矿业	21,639,260.08	7.75
C	制造业	127,207,428.16	45.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,556,664.00	3.06
E	建筑业	3,355,893.00	1.20
F	批发和零售业	7,333,919.50	2.63
G	交通运输、仓储和邮政业	13,056,188.15	4.68
H	住宿和餐饮业	937,698.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,850,469.00	3.17
J	金融业	66,326,689.44	23.75
K	房地产业	3,886,182.40	1.39
L	租赁和商务服务业	3,601,200.00	1.29
M	科学研究和技术服务业	550,458.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	2,511,193.00	0.90
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	985,014.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	270,165,600.73	96.75

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	1,136,573.07	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
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	403,414.66	0.14
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	1,564,022.56	0.56

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	8,510	17,502,517.00	6.27
2	600036	招商银行	153,100	8,296,489.00	2.97
3	601398	工商银行	1,308,400	6,764,428.00	2.42
4	601857	中国石油	1,220,540	6,456,656.60	2.31
5	601628	中国人寿	163,580	5,543,726.20	1.99
6	601318	中国平安	85,302	5,483,212.56	1.96
7	600900	长江电力	210,500	4,344,720.00	1.56
8	601166	兴业银行	188,700	3,877,785.00	1.39
9	600276	恒瑞医药	54,960	3,735,631.20	1.34
10	601888	中国中免	12,000	3,601,200.00	1.29
11	603288	海天味业	25,190	3,248,250.50	1.16
12	601012	隆基股份	35,520	3,155,596.80	1.13
13	600000	浦发银行	314,407	3,144,070.00	1.13
14	600028	中国石化	704,800	3,072,928.00	1.10
15	600104	上汽集团	137,600	3,023,072.00	1.08
16	600887	伊利股份	72,800	2,681,224.00	0.96
17	601919	中远海控	85,500	2,611,170.00	0.94
18	600031	三一重工	82,100	2,386,647.00	0.85
19	601998	中信银行	460,400	2,348,040.00	0.84
20	601899	紫金矿业	231,700	2,245,173.00	0.80
21	600600	青岛啤酒	19,000	2,197,350.00	0.79
22	600660	福耀玻璃	39,100	2,183,735.00	0.78
23	601211	国泰君安	126,600	2,169,924.00	0.78
24	600050	中国联通	501,600	2,166,912.00	0.78
25	600016	民生银行	489,600	2,159,136.00	0.77
26	601319	中国人保	363,100	2,153,183.00	0.77
27	600196	复星医药	29,600	2,135,048.00	0.76
28	601633	长城汽车	48,900	2,131,551.00	0.76
29	600019	宝钢股份	266,800	2,038,352.00	0.73
30	603260	合盛硅业	25,900	1,991,969.00	0.71
31	600919	江苏银行	276,940	1,966,274.00	0.70
32	601169	北京银行	398,000	1,938,260.00	0.69
33	603283	赛腾股份	64,900	1,909,358.00	0.68
34	601877	正泰电器	56,400	1,882,632.00	0.67
35	601006	大秦铁路	283,200	1,863,456.00	0.67

36	600741	华域汽车	69,400	1,823,138.00	0.65
37	600663	陆家嘴	136,600	1,819,512.00	0.65
38	601100	恒立液压	21,111	1,813,857.12	0.65
39	601336	新华保险	39,500	1,813,445.00	0.65
40	600885	宏发股份	28,900	1,812,030.00	0.65
41	601881	中国银河	164,306	1,771,218.68	0.63
42	600332	白云山	51,300	1,736,505.00	0.62
43	601818	光大银行	458,700	1,733,886.00	0.62
44	601088	中国神华	88,624	1,729,940.48	0.62
45	601111	中国国航	219,300	1,706,154.00	0.61
46	600926	杭州银行	114,800	1,693,300.00	0.61
47	600426	华鲁恒升	54,300	1,680,585.00	0.60
48	603816	顾家家居	21,700	1,676,976.00	0.60
49	601918	新集能源	339,900	1,662,111.00	0.60
50	603650	彤程新材	34,200	1,645,020.00	0.59
51	601009	南京银行	152,800	1,607,456.00	0.58
52	600584	长电科技	42,600	1,605,168.00	0.57
53	601838	成都银行	125,400	1,585,056.00	0.57
54	601328	交通银行	322,600	1,580,740.00	0.57
55	600642	申能股份	256,300	1,573,682.00	0.56
56	600570	恒生电子	16,500	1,538,625.00	0.55
57	601601	中国太保	52,400	1,518,028.00	0.54
58	600085	同仁堂	36,900	1,507,365.00	0.54
59	603858	步长制药	66,500	1,495,585.00	0.54
60	600398	海澜之家	200,900	1,454,516.00	0.52
61	600377	宁沪高速	145,400	1,419,104.00	0.51
62	601997	贵阳银行	192,700	1,379,732.00	0.49
63	600598	北大荒	91,400	1,367,344.00	0.49
64	601333	广深铁路	644,400	1,366,128.00	0.49
65	601666	平煤股份	190,400	1,353,744.00	0.48
66	600995	文山电力	189,500	1,349,240.00	0.48
67	603233	大参林	25,980	1,327,837.80	0.48
68	600566	济川药业	73,900	1,322,810.00	0.47
69	603199	九华旅游	65,300	1,317,101.00	0.47
70	600908	无锡银行	225,200	1,306,160.00	0.47
71	603026	石大胜华	8,000	1,296,400.00	0.46
72	600976	健民集团	22,000	1,276,000.00	0.46
73	603056	德邦股份	115,757	1,272,169.43	0.46
74	603877	太平鸟	23,800	1,270,444.00	0.45
75	600508	上海能源	135,800	1,269,730.00	0.45
76	600694	大商股份	60,800	1,262,208.00	0.45
77	600845	宝信软件	24,720	1,258,248.00	0.45
78	600346	恒力石化	47,600	1,249,024.00	0.45
79	600690	海尔智家	47,600	1,233,316.00	0.44

80	601577	长沙银行	135,600	1,212,264.00	0.43
81	600588	用友网络	36,400	1,210,664.00	0.43
82	603517	绝味食品	14,300	1,205,347.00	0.43
83	600323	瀚蓝环境	54,800	1,194,092.00	0.43
84	600548	深高速	136,626	1,191,378.72	0.43
85	603799	华友钴业	10,300	1,176,260.00	0.42
86	600066	宇通客车	93,600	1,169,064.00	0.42
87	603811	诚意药业	67,160	1,165,226.00	0.42
88	603730	岱美股份	63,725	1,161,069.50	0.42
89	600612	老凤祥	21,717	1,150,349.49	0.41
90	600989	宝丰能源	82,900	1,134,072.00	0.41
91	603337	杰克股份	42,400	1,133,352.00	0.41
92	603989	艾华集团	34,500	1,124,355.00	0.40
93	600848	上海临港	62,000	1,109,800.00	0.40
94	603659	璞泰来	8,100	1,106,460.00	0.40
95	600183	生益科技	46,300	1,083,883.00	0.39
96	600729	重庆百货	39,300	1,078,785.00	0.39
97	603899	晨光文具	12,500	1,057,000.00	0.38
98	603369	今世缘	19,400	1,050,704.00	0.38
99	601865	福莱特	26,200	1,035,686.00	0.37
100	603186	华正新材	28,300	1,031,818.00	0.37
101	600742	一汽富维	100,300	1,022,057.00	0.37
102	603806	福斯特	9,680	1,017,658.40	0.36
103	600350	山东高速	161,600	993,840.00	0.36
104	600373	中文传媒	99,900	985,014.00	0.35
105	600745	闻泰科技	10,100	978,690.00	0.35
106	601916	浙商银行	245,900	976,223.00	0.35
107	603039	泛微网络	14,440	960,982.00	0.34
108	600641	万业企业	52,460	956,870.40	0.34
109	600060	海信视像	56,600	956,540.00	0.34
110	603348	文灿股份	26,900	941,500.00	0.34
111	600258	首旅酒店	39,300	937,698.00	0.34
112	600633	浙数文化	127,600	916,168.00	0.33
113	600884	杉杉股份	39,100	911,812.00	0.33
114	600985	淮北矿业	74,400	908,424.00	0.33
115	603566	普莱柯	39,100	891,480.00	0.32
116	603920	世运电路	63,466	890,427.98	0.32
117	603939	益丰药房	15,830	887,904.70	0.32
118	603818	曲美家居	99,500	883,560.00	0.32
119	603866	桃李面包	28,300	882,960.00	0.32
120	603515	欧普照明	34,300	880,481.00	0.32
121	603883	老百姓	16,600	874,488.00	0.31
122	600491	龙元建设	161,600	869,408.00	0.31
123	603993	洛阳钼业	164,800	850,368.00	0.30

124	603228	景旺电子	32,452	850,242.40	0.30
125	603217	元利科技	30,500	849,730.00	0.30
126	600391	航发科技	39,100	844,951.00	0.30
127	603678	火炬电子	12,500	843,750.00	0.30
128	603801	志邦家居	25,900	827,764.00	0.30
129	600211	西藏药业	13,100	826,348.00	0.30
130	601231	环旭电子	49,000	823,690.00	0.29
131	603666	亿嘉和	9,019	822,172.04	0.29
132	603997	继峰股份	99,500	817,890.00	0.29
133	600438	通威股份	18,900	817,803.00	0.29
134	601138	工业富联	65,700	815,337.00	0.29
135	600348	华阳股份	109,000	808,780.00	0.29
136	601128	常熟银行	129,400	802,280.00	0.29
137	603927	中科软	18,600	798,870.00	0.29
138	603416	信捷电气	12,500	793,375.00	0.28
139	600958	东方证券	75,700	756,243.00	0.27
140	600315	上海家化	12,500	751,750.00	0.27
141	601939	建设银行	112,200	746,130.00	0.27
142	601636	旗滨集团	39,100	725,696.00	0.26
143	603008	喜临门	21,900	722,919.00	0.26
144	603309	维力医疗	50,600	705,870.00	0.25
145	600535	天士力	47,600	704,956.00	0.25
146	600395	盘江股份	97,600	692,960.00	0.25
147	600597	光明乳业	47,600	685,916.00	0.25
148	600362	江西铜业	30,500	682,590.00	0.24
149	600038	中直股份	12,800	675,072.00	0.24
150	600062	华润双鹤	56,324	670,818.84	0.24
151	600011	华能国际	154,500	651,990.00	0.23
152	601669	中国电建	165,500	640,485.00	0.23
153	601991	大唐发电	241,300	637,032.00	0.23
154	600487	亨通光电	55,800	636,120.00	0.23
155	600004	白云机场	56,600	632,788.00	0.23
156	600859	王府井	21,700	626,696.00	0.22
157	600216	浙江医药	39,100	625,991.00	0.22
158	601668	中国建筑	134,000	623,100.00	0.22
159	601800	中国交建	96,100	622,728.00	0.22
160	600761	安徽合力	56,200	621,572.00	0.22
161	603728	鸣志电器	34,800	612,132.00	0.22
162	603755	日辰股份	9,800	611,716.00	0.22
163	603686	龙马环卫	39,909	607,015.89	0.22
164	603298	杭叉集团	33,400	605,876.00	0.22
165	601618	中国中冶	201,400	600,172.00	0.21
166	600811	东方集团	196,100	598,105.00	0.21
167	601898	中煤能源	82,300	588,445.00	0.21

168	600177	雅戈尔	88,100	580,579.00	0.21
169	600295	鄂尔多斯	31,400	561,746.00	0.20
170	603018	华设集团	69,240	550,458.00	0.20
171	600585	海螺水泥	12,800	525,440.00	0.19
172	601003	柳钢股份	83,900	495,010.00	0.18

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	688083	中望软件	638	334,363.04	0.12
2	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.10
3	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.08
4	688183	生益电子	12,589	178,637.91	0.06
5	688660	电气风电	20,222	146,811.72	0.05
6	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.03
7	688499	利元亨	2,017	78,360.45	0.03
8	688636	智明达	918	74,100.96	0.03
9	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
10	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
11	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
12	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
13	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
14	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
15	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600809	山西汾酒	4,944,779.00	0.59
2	603501	韦尔股份	3,986,366.00	0.48
3	601888	中国中免	3,928,844.30	0.47
4	601998	中信银行	3,791,296.00	0.46
5	601899	紫金矿业	3,491,492.98	0.42
6	601006	大秦铁路	3,151,643.00	0.38
7	600016	民生银行	3,124,109.00	0.38
8	600519	贵州茅台	3,010,204.00	0.36
9	600000	浦发银行	2,962,132.15	0.36

10	601169	北京银行	2,840,172.00	0.34
11	600346	恒力石化	2,713,427.00	0.33
12	601881	中国银河	2,610,610.00	0.31
13	601100	恒立液压	2,581,117.47	0.31
14	601111	中国国航	2,518,174.00	0.30
15	601333	广深铁路	2,495,270.00	0.30
16	600196	复星医药	2,463,495.00	0.30
17	601857	中国石油	2,458,086.00	0.30
18	601319	中国人保	2,418,757.92	0.29
19	603259	药明康德	2,414,627.00	0.29
20	601997	贵阳银行	2,250,977.00	0.27

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	601288	农业银行	6,546,023.00	0.79
2	601658	邮储银行	5,692,248.15	0.68
3	600809	山西汾酒	4,833,943.00	0.58
4	601888	中国中免	4,347,558.00	0.52
5	601012	隆基股份	4,313,217.85	0.52
6	600309	万华化学	4,227,558.00	0.51
7	601988	中国银行	4,015,786.00	0.48
8	603288	海天味业	3,936,228.00	0.47
9	600030	中信证券	3,413,319.00	0.41
10	603501	韦尔股份	3,110,543.00	0.37
11	601816	京沪高铁	2,820,250.00	0.34
12	601916	浙商银行	2,724,119.00	0.33
13	600048	保利地产	2,648,103.00	0.32
14	601138	工业富联	2,507,836.50	0.30
15	601618	中国中冶	2,470,723.00	0.30
16	600674	川投能源	2,461,284.30	0.30
17	600779	水井坊	2,343,704.00	0.28
18	600837	海通证券	2,336,700.00	0.28
19	600028	中国石化	2,089,391.00	0.25
20	601100	恒立液压	2,082,575.54	0.25

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	334,031,297.85
卖出股票的收入（成交）总额	297,438,071.25

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）	349,000.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	349,000.00	0.12

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	113050	南银转债	3,200	320,000.00	0.11
2	113049	长汽转债	290	29,000.00	0.01

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“工商银行”、“招商银行”、“兴业银行”、“中国人寿”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。

工商银行公司本身和昌图等下属分行、支行由于未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告，关键岗位未进行实质性轮岗，法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞，为同业投资业务提供隐性担保，理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益，非标准化债权资产限额测算不准确，理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例，部分重点领域业务未向监管部门真实反映，为违规的政府购买服务项目提供融资，理财资金违规用于缴纳或置换土地款，通过转让分级互投实现不良资产虚假出表，理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权，面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产，理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权，全权委托业务不规范，用其他资金支付结构性存款收益，自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职，理财资金承接本行自营贷款，封闭式理财产品相互交易调节收益，滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益，高净值客户认定不审慎，理财产品信息披露不到位，部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记，和将残损的人民币对外支付等原因分别受到银保监会和当地银保监局罚款、公开批评等监管处罚。

招商银行公司本身及北京等下属分行、支行由于为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等原因，和个人经营性贷款业务严重违反审慎经营规则，分别受到银保监会和当地银保监局罚款、责令改正等监管处罚。

兴业银行公司本身及青岛等下属分行、支行由于同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保，和同业投资业务接受第三方金融机构信用担保等原因，分别受到当地银保监局罚款等监管处罚。

中国人寿合肥、仁寿县等分、支公司由于在未经保险监督管理部门批准的情况下变更第十三营销服务部的实际营业场所，和编制虚假资料等原因分别受到当地银保监局罚款等监管处罚。

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	25,521.03
2	应收证券清算款	221,514.27
3	应收股利	-
4	应收利息	3,048.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	250,084.16

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处于转股期的可转换债券。

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	688083	中望软件	334,363.04	0.12	新股锁定
2	688690	纳微科技	277,777.53	0.10	新股锁定
3	688665	四方光电	218,399.02	0.08	新股锁定
4	688183	生益电子	178,637.91	0.06	新股锁定
5	688660	电气风电	146,811.72	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

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		国泰上证综合 ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
10,048	26,523.06	32,172,06 9.00	12.07%	221,654, 296.00	83.17%	12,677,300. 00	4.76%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	方正证券股份有限公司	8,205,057.00	3.08%
2	中信建投证券有限责任公司	7,296,494.00	2.74%
3	中国银河证券股份有限公司	6,614,043.00	2.48%
4	中信证券股份有限公司	6,420,956.00	2.41%
5	胡恒	5,000,000.00	1.88%
6	许再苏	3,000,000.00	1.13%
7	陈淑仙	2,000,000.00	0.75%

8	北京杰讯睿智科技发展有限公司	2,000,000.00	0.75%
9	赵海金	1,700,000.00	0.64%
10	唐铭倩	1,613,800.00	0.61%
-	国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	12,677,300.00	4.76%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 8 月 21 日）基金份额总额	1,313,503,665.00
本报告期期初基金份额总额	830,503,665.00
本报告期基金总申购份额	546,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,110,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	266,503,665.00

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：

2021 年 3 月 31 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任职公告》，经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过，张玮先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》，经本基金管理人股东会审议通过，对本基金管理人董事会成员进行了调整。

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，本基金根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同，涉及投资策略变更，详见基金合同。修订后的投资策略也可参阅本报告 2.2 基金产品说明。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
申万宏源	3	625,697,500.27	100.00%	82,164.72	100.00%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- （1）资质雄厚，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
申万宏源	1,047,988.91	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
2	国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
3	国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》	2021-04-01

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 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 层-19 层。

基金托管人住所。

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日