

# 国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

## 2022 年第 3 季度报告

### 2022 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                    |
|------------|----------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰标普 500ETF                                        |
| 场内简称       | 标普 500ETF                                          |
| 基金主代码      | 159612                                             |
| 交易代码       | 159612                                             |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                             |
| 基金合同生效日    | 2022 年 5 月 9 日                                     |
| 报告期末基金份额总额 | 56,898,651.00 份                                    |
| 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、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、境外市场基金投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 标普 500 指数收益率（经估值汇率调整）                              |

|             |                                                                                                                                                                                         |
|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 风险收益特征      | 本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |
| 基金管理人       | 国泰基金管理有限公司                                                                                                                                                                              |
| 基金托管人       | 招商银行股份有限公司                                                                                                                                                                              |
| 境外资产托管人中文名称 | 香港上海汇丰银行有限公司                                                                                                                                                                            |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 本期金额<br>(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日) |
|-----------------|------------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,444,186.44                             |
| 2. 本期利润         | 2,489,216.63                             |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0368                                   |
| 4. 期末基金资产净值     | 54,599,792.78                            |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9596                                   |

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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

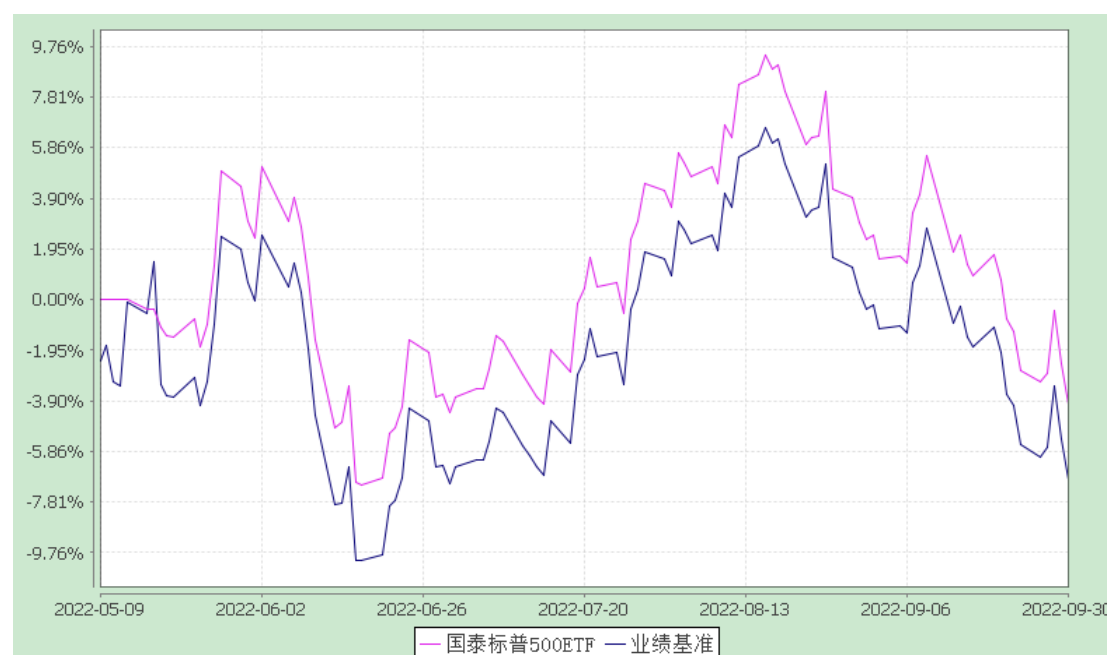
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.31%  | 1.31%     | 0.20%      | 1.33%         | 0.11% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.04% | 1.40%     | -6.92%     | 1.57%         | 2.88% | -0.17% |

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022 年 5 月 9 日至 2022 年 9 月 30 日）



注：（1）本基金的合同生效日为2022年5月9日，截止至2022年9月30日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

（3）同期业绩比较基准以人民币计价。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                                                     | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----|------------------------------------------------------------------------|-------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                        | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 徐成城 | 国泰纳斯达克100（QDI I-ETF）、国泰中证煤炭ETF、国泰中证钢铁ETF、国泰中证全指家用电器ETF、国泰中证新能源汽车ETF、国泰 | 2022-05-09  | -    | 16 年   | 硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金，历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月至 2021 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 2 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 2021 年 7 月任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和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，2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 10 月 |

|  |                                                                                                                                            |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 中证动漫游戏 ETF、<br>国泰中证细分机械设备产业主题 ETF、<br>国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、<br>国泰中证细分机械设备产业主题 ETF 联接、<br>国泰中证有色金属 ETF、<br>国泰中证动漫游戏 ETF 联接、<br>国泰中证光伏产业 ETF、 |  |  | 任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 12 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金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，2020 年 1 月起兼任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金和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 1 月至 2021 年 7 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和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的基金经理，2020 年 2 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月任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，2021 年 |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                         |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>国泰<br/>中证<br/>800 汽<br/>车与<br/>零部<br/>件 ETF<br/>发起<br/>联接、<br/>国泰<br/>中证<br/>有色<br/>金属<br/>ETF 发<br/>起联<br/>接、国<br/>泰中<br/>证港<br/>股通<br/>50ETF<br/>、国泰<br/>富时<br/>中国<br/>国企<br/>开放<br/>共赢<br/>ETF、<br/>国泰<br/>标普<br/>500ET<br/>F 的基<br/>金经<br/>理</p> |  |  | <p>1 月至 2021 年 7 月任国<br/>泰国证房地产行业指数<br/>证券投资基金（由国泰<br/>泰国证房地产行业指数分<br/>级证券投资基金终止分<br/>级运作变更而来）的基<br/>金经理，2021 年 2 月起<br/>兼任国泰中证动漫游戏<br/>交易型开放式指数证券<br/>投资基金的基金经理，<br/>2021 年 4 月起兼任国泰<br/>中证细分机械设备产业<br/>主题交易型开放式指数<br/>证券投资基金和国泰中<br/>证 800 汽车与零部件交<br/>易型开放式指数证券投<br/>资基金的基金经理，<br/>2021 年 6 月起兼任国泰<br/>中证细分机械设备产业<br/>主题交易型开放式指数<br/>证券投资基金发起式联<br/>接基金、国泰中证有色<br/>金属交易型开放式指数<br/>证券投资基金和国泰中<br/>证动漫游戏交易型开放<br/>式指数证券投资基金发<br/>起式联接基金的基金经<br/>理，2021 年 7 月起兼任<br/>国泰中证光伏产业交易<br/>型开放式指数证券投资<br/>基金的基金经理，2021<br/>年 8 月起兼任国泰中证<br/>800 汽车与零部件交易<br/>型开放式指数证券投资<br/>基金发起式联接基金和<br/>国泰中证有色金属交易<br/>型开放式指数证券投资<br/>基金发起式联接基金的<br/>基金经理，2021 年 10<br/>月起兼任国泰中证港股<br/>通 50 交易型开放式指<br/>数证券投资基金的基金<br/>经理，2021 年 12 月起<br/>兼任国泰富时中国国企</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                        |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 5 月起兼任国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------|

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，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。

##### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2022 年三季度美股延续开年跌势，但跌幅收窄。大盘指数标普 500 下挫 5%，科技股为主的纳斯达克指数下挫 4%，其中市值排名前 100 名公司组成的纳斯达克 100 指数（本基金跟踪的指数）下挫 5%。三季度人民币兑美元贬值近 6%，对本基金人民币计价净值有一定增厚。剔除汇率因素后，本基金净值和标普 500 指数走势高度吻合。

2022 年三季度美国通胀高位盘整，CPI 同比从 6 月 9.1%小幅回落到 8 月的 8.3%。美联储持续紧缩以追赶通胀，7 月和 9 月分别加息 75bp，开年累计加息 300bp。货币政策的快速收紧对美股、尤其是对利率更敏感的科技股产生冲击。同时，利率的快速上升让美国火热的房地产市场明显降温，也对消费和投资产生了一定挤出效应，消费支出、制造业 PMI 等高频经济数据均有所走弱。所幸美国就业市场仍然稳健，9 月失业率 3.5%，续创近半世纪新低，同时居民和金融机构杠杆可控，资产负债表总体健康，在经济下行周期能提供缓冲。

聚焦到美股，二季度美股部分行业出现了一定盈利压力，主要集中在零售（如沃尔玛、塔吉特、耐克）和半导体（美光、高通）等板块，这主要和美国消费放缓、全球半导体周期性下行有关。但美股总体盈利仍然有韧性，个别板块如油气、交运甚至还有景气上行趋势。在科技板块内部，电动车及自动驾驶、人工智能、企业云化数字化、VRAR 等产业中期趋势仍然明确，苹果、微软、亚马逊、特斯拉等标杆公司在此领域均有布局。这些公司资产负债表、现金流量表稳健，未来抗风险能力较强，它们也是铸就美股牛长熊短的坚定基石。

本基金本报告期内的净值增长率为 0.31%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%（注：同期业绩比较基准以人民币计价）。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年四季度，我们认为需关注美国通胀、美股盈利、俄乌冲突等风险事项。

美国通胀数据将直接决定美联储货币政策的走向，进而影响美股的估值水平。我们认为四季度美联储仍会加快紧缩以追赶通胀，这对美股特别是部分高估

值科技股而言是个风险因素，但难以抑制的通胀也对能源行业较为有利。若四季度通胀数据在基数效应下回落，美联储的紧缩力度也会边际趋缓，或为科技股提供较好的布局窗口。

其次，美股不同科技板块的景气度也在分化。譬如智能驾驶、VRAR 仍在景气上行周期，但半导体、消费电子等板块已经出现了结构分化。未来我们仍需要关注美股科技股盈利的变化，这将是驱动市场走势的最关键因素。

最后，俄乌冲突长期化以及伴生的政治制裁可能引发市场避险交易升温，对美股形成阶段性压力，但这种压力更多体现在情绪层面，对美股基本面的影响要远小于对俄能源和贸易依赖度更高的欧洲市场。

接下来我们仍将继续利用国泰标普 500 ETF 指数基金，为投资者跟踪美股表现创造便利。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 49,901,549.79 | 91.19        |
|    | 其中：普通股 | 48,637,296.15 | 88.88        |
|    | 存托凭证   | —             | —            |
|    | 优先股    | —             | —            |
|    | 房地产信托  | 1,264,253.64  | 2.31         |
| 2  | 基金投资   | 1,635,341.52  | 2.99         |
| 3  | 固定收益投资 | —             | —            |
|    | 其中：债券  | —             | —            |
|    | 资产支持证券 | —             | —            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 4 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
|   | 其中：远期             | -             | -      |
|   | 期货                | -             | -      |
|   | 期权                | -             | -      |
|   | 权证                | -             | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 6 | 货币市场工具            | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 3,149,457.19  | 5.76   |
| 8 | 其他各项资产            | 33,476.03     | 0.06   |
| 9 | 合计                | 54,719,824.53 | 100.00 |

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 美国     | 49,901,549.79 | 91.40        |
| 合计     | 49,901,549.79 | 91.40        |

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

### 5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 信息技术   | 13,129,104.03 | 24.05        |
| 通信服务   | 4,017,543.04  | 7.36         |
| 非必需消费品 | 5,955,586.20  | 10.91        |
| 保健     | 7,602,398.32  | 13.92        |
| 必需消费品  | 3,308,461.07  | 6.06         |
| 工业     | 3,963,825.00  | 7.26         |
| 公用事业   | 1,495,652.46  | 2.74         |
| 金融     | 5,530,084.09  | 10.13        |

|     |               |       |
|-----|---------------|-------|
| 能源  | 2,286,394.53  | 4.19  |
| 材料  | 1,264,439.80  | 2.32  |
| 房地产 | 1,270,429.40  | 2.33  |
| 合计  | 49,823,917.94 | 91.25 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------|--------------|
| 信息技术   | 30,514.23  | 0.06         |
| 通信服务   | -          | -            |
| 非必需消费品 | 17,345.32  | 0.03         |
| 保健     | -          | -            |
| 必需消费品  | -          | -            |
| 工业     | -          | -            |
| 公用事业   | -          | -            |
| 金融     | -          | -            |
| 能源     | -          | -            |
| 材料     | -          | -            |
| 房地产    | 29,772.30  | 0.05         |
| 合计     | 77,631.85  | 0.14         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票及存托凭证投资明细

#### 5.4.1 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前十名股票及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文)  | 公司名称(中文) | 证券代码    | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股)    | 公允价值(人民币元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------|---------|--------|----------|----------|--------------|--------------|
| 1  | APPLE INC | 苹果公司     | AAPL US | 纳斯达克   | 美国       | 3,559.00 | 3,492,063.61 | 6.40         |

|    |                                   |                    |              |                  |        |              |                  |      |
|----|-----------------------------------|--------------------|--------------|------------------|--------|--------------|------------------|------|
| 2  | MICROSOFT<br>CORP                 | 微软公<br>司           | MSFT<br>US   | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美<br>国 | 1,720.0<br>0 | 2,844,094.6<br>8 | 5.21 |
| 3  | AMAZON.COM<br>INC                 | 亚马<br>逊公<br>司      | AMZN<br>US   | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美<br>国 | 2,012.0<br>0 | 1,614,182.1<br>3 | 2.96 |
| 4  | TESLA INC                         | 特斯<br>拉公<br>司      | TSLA<br>US   | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美<br>国 | 574.00       | 1,080,969.4<br>0 | 1.98 |
| 5  | ALPHABET<br>INC-CL A              | Alphab<br>e 公<br>司 | GOOG<br>L US | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美<br>国 | 1,392.0<br>0 | 945,301.45       | 1.73 |
| 6  | ALPHABET<br>INC-CL C              | Alphab<br>e 公<br>司 | GOOG<br>US   | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美<br>国 | 1,265.0<br>0 | 863,546.90       | 1.58 |
| 7  | BERKSHIRE<br>HATHAWAY<br>INC-CL B | 伯克希<br>尔哈撒<br>韦公司  | BRK/<br>B US | 纽<br>约           | 美<br>国 | 418.00       | 792,439.63       | 1.45 |
| 8  | UNITEDHEALT<br>H GROUP INC        | 联合健<br>康集团         | UNH<br>US    | 纽<br>约           | 美<br>国 | 215.00       | 770,921.84       | 1.41 |
| 9  | JOHNSON &<br>JOHNSON              | 强生                 | JNJ<br>US    | 纽<br>约           | 美<br>国 | 603.00       | 699,373.47       | 1.28 |
| 10 | EXXON MOBIL<br>CORP               | 埃克森<br>美孚石<br>油公司  | XOM<br>US    | 纽<br>约           | 美<br>国 | 970.00       | 601,287.03       | 1.10 |

5.4.2 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前五名股票及  
存托凭证投资明细

| 序<br>号 | 公司名称 (英<br>文)       | 公<br>司<br>名<br>称<br>(中<br>文) | 证<br>券<br>代<br>码 | 所<br>在<br>证<br>券<br>市<br>场 | 所<br>属<br>国<br>家<br>(地<br>区) | 数<br>量<br>(股) | 公<br>允<br>价<br>值<br>(人<br>民<br>币<br>元) | 占<br>基<br>金<br>资<br>产<br>净<br>值<br>比<br>例<br>(%) |
|--------|---------------------|------------------------------|------------------|----------------------------|------------------------------|---------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 1      | DUKE REALTY<br>CORP | 杜克<br>房地                     | DRE<br>US        | 纽<br>约                     | 美<br>国                       | 87.00         | 29,772.30                              | 0.05                                             |

|   |                              |                              |            |                  |    |       |           |      |
|---|------------------------------|------------------------------|------------|------------------|----|-------|-----------|------|
|   |                              | 产公司                          |            |                  |    |       |           |      |
| 2 | CITRIX SYSTEMS<br>INC        | 思杰<br>系统<br>股份<br>有限<br>公司   | CTXS<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美国 | 30.00 | 22,130.08 | 0.04 |
| 3 | IPG PHOTONICS<br>CORP        | IPG 光<br>子公<br>司             | IPGP<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美国 | 14.00 | 8,384.15  | 0.02 |
| 4 | PENN<br>ENTERTAINMENT<br>INC | Penn<br>娱乐<br>股份<br>有限<br>公司 | PENN<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克 | 美国 | 38.00 | 7,421.99  | 0.01 |
| 5 | PVH CORP                     | PVH 公<br>司                   | PVH<br>US  | 纽<br>约           | 美国 | 18.00 | 5,725.28  | 0.01 |

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值<br>(人民币元) | 占基金<br>资产净 |
|----|------|------|------|-----|----------------|------------|
|----|------|------|------|-----|----------------|------------|

|   |                           |        |     |                    |              | 值比例<br>(%) |
|---|---------------------------|--------|-----|--------------------|--------------|------------|
| 1 | PROSHARES ULTRA<br>S&P500 | ETF 基金 | 开放式 | ProShares<br>Trust | 1,635,341.52 | 3.00       |

## 5.10 投资组合报告附注

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

5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | —         |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | 33,476.03 |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | —         |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 待摊费用    | —         |
| 8  | 其他      | —         |
| 9  | 合计      | 33,476.03 |

### 5.10.4 报告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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.10.5.1 报告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。

#### 5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |               |
|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 78,898,651.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 12,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 34,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | —             |
| 本报告期期末基金份额总额   | 56,898,651.00 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                         | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                    |               |           |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|---------------------------------------------------------------|----------------|------------------------------------|---------------|-----------|------|---------------|--------|
|                                                               | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间             | 期初份额          | 申购份额      | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 个人                                                            | 1              | 2022 年 07 月 01 日至 2022 年 09 月 30 日 | 19,763,605.00 | 15,400.00 | —    | 19,779,005.00 | 34.76% |
| 产品特有风险                                                        |                |                                    |               |           |      |               |        |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                                    |               |           |      |               |        |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、关于准予国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复

- 2、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同
- 3、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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

## 9.2 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。

## 9.3 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  
二〇二二年十月二十六日