

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告
2025 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
8 基金份额持有人信息	54

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末上市基金前十名持有人	55
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
9	开放式基金份额变动	55
10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
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	58
11	备查文件目录	58
11.1	备查文件目录	58
11.2	存放地点	58
11.3	查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 500ETF
场内简称	国泰中证 500ETF
基金主代码	561350
交易代码	561350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,700,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李昇	张立学
	联系电话	021-31081600转	010-68858113
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95580
传真		021-31081800	010-86353609
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200082	100808
法定代表人		周向勇	郑国雨

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,923,248.82
本期利润	7,558,111.01
加权平均基金份额本期利润	0.0567
本期加权平均净值利润率	6.30%
本期基金份额净值增长率	5.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-7,016,824.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0640
期末基金资产净值	102,683,175.79
期末基金份额净值	0.9360
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-6.40%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.93%	0.77%	4.31%	0.79%	0.62%	-0.02%
过去三个月	2.18%	1.46%	0.98%	1.50%	1.20%	-0.04%
过去六个月	5.04%	1.32%	3.31%	1.36%	1.73%	-0.04%
过去一年	24.06%	1.69%	19.68%	1.72%	4.38%	-0.03%
过去三年	-0.16%	1.33%	-8.35%	1.35%	8.19%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-6.40%	1.33%	-14.20%	1.36%	7.80%	-0.03%

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

国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2021 年 8 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2021 年 8 月 18 日，本基金的建仓期为六个月，在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 280 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄岳	国泰中证生物医药 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF、国泰中证科创创业 50ETF、国泰中证 500ETF、国泰中证消费电子主题 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证光伏产业 ETF、国泰策略价值灵活配置混合、国泰中证 A500ETF 的基金经理	2021-08-18	-	10 年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 2 月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月至 2023 年 9 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 4 月任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月至 2024 年 10 月任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月至 2025 年 2 月任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 11 月任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 4 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数

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

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

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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 5 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

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

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

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

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

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 5.04%，同期业绩比较基准收益率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,290,815.25	899,579.32
结算备付金		223,237.28	928,781.51
存出保证金		217,308.88	324,768.50
交易性金融资产	6.4.7.2	101,844,150.98	125,222,112.43
其中：股票投资		101,844,150.98	125,222,112.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		259,962.66	338,555.49
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		103,835,475.05	127,713,797.25
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,152.31
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		43,482.00	57,838.51
应付托管费		8,696.39	11,567.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,100,120.87	474,702.24
负债合计		1,152,299.26	548,260.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	109,700,000.00	142,700,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-7,016,824.21	-15,534,463.54
净资产合计		102,683,175.79	127,165,536.46
负债和净资产总计		103,835,475.05	127,713,797.25

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9360 元，基金份额总额 109,700,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,989,846.90	-9,414,235.55
1.利息收入		7,486.02	25,604.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,486.02	15,464.70
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	10,139.61
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,150,789.60	-14,213,122.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,121,021.63	-16,279,027.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,029,767.97	2,065,904.40
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	4,634,862.19	4,207,812.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	196,709.09	565,470.76
减：二、营业总支出		431,735.89	660,150.56
1. 管理人报酬		298,585.83	481,663.51
2. 托管费		59,717.19	96,332.69
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	37.91
8. 其他费用	6.4.7.16	73,432.87	82,116.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,558,111.01	-10,074,386.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,558,111.01	-10,074,386.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,558,111.01	-10,074,386.11

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	142,700,000.00	-15,534,463.54	127,165,536.46
二、本期期初净资产	142,700,000.00	-15,534,463.54	127,165,536.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,000,000.00	8,517,639.33	-24,482,360.67
（一）、综合收益总额	-	7,558,111.01	7,558,111.01

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-33,000,000.00	959,528.32	-32,040,471.68
其中: 1.基金申购款	288,000,000.00	-31,085,767.25	256,914,232.75
2.基金赎回款	-321,000,000.00	32,045,295.57	-288,954,704.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	109,700,000.00	-7,016,824.21	102,683,175.79
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	271,700,000.00	-50,303,113.67	221,396,886.33
二、本期期初净资产	271,700,000.00	-50,303,113.67	221,396,886.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-48,000,000.00	-4,626,011.07	-52,626,011.07
(一)、综合收益总额	-	-10,074,386.11	-10,074,386.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-48,000,000.00	5,448,375.04	-42,551,624.96
其中: 1.基金申购款	426,000,000.00	-99,478,336.31	326,521,663.69
2.基金赎回款	-474,000,000.00	104,926,711.35	-369,073,288.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-

四、本期期末净资产	223,700,000.00	-54,929,124.74	168,770,875.26
-----------	----------------	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问

题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入

应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,290,815.25
等于：本金	1,290,594.73
加：应计利息	220.52
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,290,815.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	99,354,260.24	-	101,844,150.98	2,489,890.74

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		99,354,260.24	-	101,844,150.98	2,489,890.74

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,513.80
其中：交易所市场	17,513.80

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88
应付替代款	1,009,215.19
合计	1,100,120.87

注：应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,700,000.00	142,700,000.00
本期申购	288,000,000.00	288,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-321,000,000.00	-321,000,000.00
本期末	109,700,000.00	109,700,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,731,762.86	-11,802,700.68	-15,534,463.54
本期期初	-3,731,762.86	-11,802,700.68	-15,534,463.54
本期利润	2,923,248.82	4,634,862.19	7,558,111.01
本期基金份额交易产生的变动数	782,504.96	177,023.36	959,528.32
其中：基金申购款	-6,563,377.10	-24,522,390.15	-31,085,767.25
基金赎回款	7,345,882.06	24,699,413.51	32,045,295.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-26,009.08	-6,990,815.13	-7,016,824.21

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,094.64
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	853.06

其他	538.32
合计	7,486.02

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,445,763.36
股票投资收益——赎回差价收入	-324,741.73
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	2,121,021.63

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	155,747,769.70
减：卖出股票成本总额	153,158,885.31
减：交易费用	143,121.03
买卖股票差价收入	2,445,763.36

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	288,954,704.43
减：现金支付赎回款总额	140,403,305.43
减：赎回股票成本总额	148,876,140.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	-324,741.73

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,029,767.97
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	1,029,767.97

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	4,634,862.19
——股票投资	4,634,862.19
——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	4,634,862.19

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

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	196,709.09
合计	196,709.09

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	40.99
合计	73,432.87

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	298,585.83	481,663.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,278.57	312.51
应支付基金管理人的净管理费	272,307.26	481,351.00

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	59,717.19	96,332.69

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
邮储银行	1,290,815.25	6,094.64	1,865,785.56	9,560.19

注：本基金的活期银行存款由基金托管人邮储银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.38	83.49	211.00	4,089.18	17,616.39	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.40	34.11	417.00	4,336.80	14,223.87	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.70	24.80	524.00	3,510.80	12,995.20	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.08	25.94	445.00	4,040.60	11,543.30	-

				受限						
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.68	26.95	410.00	4,788.80	11,049.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.80	33.85	309.00	3,646.20	10,459.65	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	47.27	124.16	84.00	3,970.68	10,429.44	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	33.46	79.68	112.00	3,747.52	8,924.16	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	22.77	39.33	162.00	3,688.74	6,371.46	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	27.50	56.19	103.00	2,832.50	5,787.57	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	12.30	54.45	106.00	1,303.80	5,771.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	5.30	14.44	355.00	1,881.50	5,126.20	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	28.33	44.98	110.00	3,116.30	4,947.80	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	41.90	77.87	61.00	2,555.90	4,750.07	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-

001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.08	47.25	79.00	1,507.32	3,732.75	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.92	45.22	68.00	2,714.56	3,074.96	-
688583	思看科技	2025-06-19	1-6 个月(含)	送股	-	79.68	34.00	-	2,709.12	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.60	15.61	159.00	1,367.40	2,481.99	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.00	33.43	61.00	915.00	2,039.23	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.50	32.68	62.00	1,643.00	2,026.16	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6 个月(含)	送股	-	77.87	25.00	-	1,946.75	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.88	43.81	43.00	854.84	1,883.83	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.50	22.39	79.00	908.50	1,768.81	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	93.50	90.66	18.00	1,683.00	1,631.88	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	24.18	33.32	45.00	1,088.10	1,499.40	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月以上	新股锁定流通	20.52	37.47	40.00	820.80	1,498.80	-

				受限						
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6 个月 (含)	送股	-	45.22	31.00	-	1,401.82	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是通过紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对

各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人邮储银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,290,815.25	-	-	-	1,290,815.25
结算备付金	223,237.28	-	-	-	223,237.28
存出保证金	217,308.88	-	-	-	217,308.88
交易性金融资产	-	-	-	101,844,150.98	101,844,150.98
应收清算款	-	-	-	259,962.66	259,962.66
资产总计	1,731,361.41	-	-	102,104,113.64	103,835,475.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	43,482.00	43,482.00
应付托管费	-	-	-	8,696.39	8,696.39
其他负债	-	-	-	1,100,120.87	1,100,120.87
负债总计	-	-	-	1,152,299.26	1,152,299.26
利率敏感度缺口	1,731,361.41	-	-	100,951,814.38	102,683,175.79
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	899,579.32	-	-	-	899,579.32
结算备付金	928,781.51	-	-	-	928,781.51
存出保证金	324,768.50	-	-	-	324,768.50
交易性金融资产	-	-	-	125,222,112.43	125,222,112.43
应收清算款	-	-	-	338,555.49	338,555.49
资产总计	2,153,129.33	-	-	125,560,667.92	127,713,797.25
负债					
应付清算款	-	-	-	4,152.31	4,152.31
应付管理人报酬	-	-	-	57,838.51	57,838.51
应付托管费	-	-	-	11,567.73	11,567.73
其他负债	-	-	-	474,702.24	474,702.24

负债总计	-	-	-	548,260.79	548,260.79
利率敏感度缺口	2,153,129.33	-	-	125,012,407.13	127,165,536.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2025 年 6 月 30 日		2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	101,844,150.98	99.18	125,222,112.43	98.47
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	101,844,150.98	99.18	125,222,112.43	98.47

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 5,047,182.51	增加约 6,261,482.58
	业绩比较基准下降 5%	减少约 5,047,182.51	减少约 6,261,482.58

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	101,669,198.20	124,978,600.26
第二层次	-	13,025.70
第三层次	174,952.78	230,486.47
合计	101,844,150.98	125,222,112.43

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 256,914,232.75 元，其中包括以股票支付的申购款 127,359,733.95 元和以现金支付的申购款 129,554,498.80 元。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	101,844,150.98	98.08
	其中：股票	101,844,150.98	98.08
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	1,514,052.53	1.46
8	其他各项资产	477,271.54	0.46
9	合计	103,835,475.05	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	248,408.00	0.24
B	采矿业	3,575,225.42	3.48
C	制造业	63,269,798.04	61.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,222,922.34	3.14
E	建筑业	880,651.10	0.86
F	批发和零售业	2,187,096.36	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	1,664,331.80	1.62
H	住宿和餐饮业	267,711.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,266,802.16	9.02
J	金融业	9,827,156.12	9.57
K	房地产业	1,230,276.66	1.20
L	租赁和商务服务业	861,493.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	677,202.22	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	418,443.72	0.41

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	205,326.00	0.20
Q	卫生和社会工作	459,645.92	0.45
R	文化、体育和娱乐业	1,400,881.00	1.36
S	综合	237,252.00	0.23
	合计	99,900,622.86	97.29

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,920.00	0.00
C	制造业	151,451.03	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	542,430.00	0.53
E	建筑业	771,602.00	0.75
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	139,647.34	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	312,976.00	0.30
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	23,501.75	0.02
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	1,943,528.12	1.89

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	300476	胜宏科技	8,200	1,101,916.00	1.07
2	000988	华工科技	13,600	639,336.00	0.62
3	600988	赤峰黄金	22,634	563,133.92	0.55
4	300339	润和软件	10,800	548,964.00	0.53
5	002966	苏州银行	60,710	533,033.80	0.52
6	600839	四川长虹	50,300	488,916.00	0.48
7	601555	东吴证券	54,060	473,025.00	0.46
8	601162	天风证券	93,930	463,074.90	0.45
9	689009	九号公司	7,736	457,739.12	0.45
10	002517	恺英网络	23,200	447,992.00	0.44
11	688521	芯原股份	4,631	446,891.50	0.44
12	002340	格林美	69,700	442,595.00	0.43
13	002195	岩山科技	77,200	434,636.00	0.42
14	002558	巨人网络	18,400	433,320.00	0.42
15	603893	瑞芯微	2,800	425,208.00	0.41
16	002156	通富微电	16,500	422,730.00	0.41
17	002261	拓维信息	13,600	420,920.00	0.41
18	688608	恒玄科技	1,200	417,576.00	0.41
19	600487	亨通光电	26,800	410,040.00	0.40
20	002797	第一创业	57,200	404,976.00	0.39
21	600157	永泰能源	301,900	404,546.00	0.39
22	300251	光线传媒	19,900	403,373.00	0.39
23	688120	华海清科	2,381	401,674.70	0.39
24	300207	欣旺达	20,000	401,200.00	0.39
25	300803	指南针	4,955	399,670.30	0.39
26	000066	中国长城	26,400	390,720.00	0.38
27	688777	中控技术	8,700	390,717.00	0.38
28	600536	中国软件	8,156	381,456.12	0.37
29	600096	云天化	17,300	380,081.00	0.37
30	002273	水晶光电	19,000	379,430.00	0.37
31	688213	思特威	3,697	377,907.34	0.37
32	601168	西部矿业	22,700	377,501.00	0.37
33	688235	百济神州	1,613	376,861.32	0.37
34	002465	海格通信	27,000	376,380.00	0.37
35	600879	航天电子	35,900	375,873.00	0.37

36	300450	先导智能	14,900	370,265.00	0.36
37	000831	中国稀土	10,100	364,812.00	0.36
38	601099	太平洋	92,800	364,704.00	0.36
39	002294	信立泰	7,600	359,708.00	0.35
40	600352	浙江龙盛	35,400	359,664.00	0.35
41	300017	网宿科技	33,300	356,976.00	0.35
42	000933	神火股份	21,400	356,096.00	0.35
43	600885	宏发股份	15,868	354,015.08	0.34
44	002185	华天科技	34,800	351,480.00	0.34
45	601108	财通证券	44,280	350,254.80	0.34
46	688002	睿创微纳	4,846	337,863.12	0.33
47	601128	常熟银行	45,020	331,797.40	0.32
48	600079	人福医药	15,600	327,288.00	0.32
49	002130	沃尔核材	13,700	326,334.00	0.32
50	601577	长沙银行	32,800	326,032.00	0.32
51	002281	光迅科技	6,600	325,512.00	0.32
52	603129	春风动力	1,500	324,750.00	0.32
53	002085	万丰奥威	20,200	320,978.00	0.31
54	300454	深信服	3,400	320,212.00	0.31
55	688469	芯联集成	67,117	320,148.09	0.31
56	002595	豪迈科技	5,400	319,788.00	0.31
57	000423	东阿阿胶	6,100	319,030.00	0.31
58	300223	北京君正	4,600	318,320.00	0.31
59	688122	西部超导	6,130	318,024.40	0.31
60	000997	新大陆	9,800	317,324.00	0.31
61	300058	蓝色光标	48,100	315,536.00	0.31
62	002738	中矿资源	9,800	315,168.00	0.31
63	300002	神州泰岳	26,700	315,060.00	0.31
64	002532	天山铝业	37,900	314,949.00	0.31
65	688617	惠泰医疗	1,059	314,523.00	0.31
66	688099	晶晨股份	4,418	313,722.18	0.31
67	300458	全志科技	7,900	313,551.00	0.31
68	000783	长江证券	45,100	312,543.00	0.30
69	600109	国金证券	35,400	310,458.00	0.30
70	300474	景嘉微	4,250	310,250.00	0.30
71	002138	顺络电子	11,000	309,320.00	0.30
72	002472	双环传动	9,200	308,108.00	0.30
73	002078	太阳纸业	22,800	306,888.00	0.30
74	002436	兴森科技	23,000	304,520.00	0.30
75	603596	伯特利	5,740	302,440.60	0.29
76	601933	永辉超市	61,600	301,840.00	0.29
77	002410	广联达	22,500	301,725.00	0.29
78	300346	南大光电	9,400	297,416.00	0.29
79	600862	中航高科	11,400	297,312.00	0.29

80	002851	麦格米特	5,900	295,826.00	0.29
81	600143	金发科技	28,600	294,866.00	0.29
82	300765	新诺威	5,700	294,633.00	0.29
83	601198	东兴证券	26,400	294,360.00	0.29
84	002850	科达利	2,600	294,242.00	0.29
85	600580	卧龙电驱	14,880	294,177.60	0.29
86	002353	杰瑞股份	8,400	294,000.00	0.29
87	300136	信维通信	13,100	293,440.00	0.29
88	300054	鼎龙股份	10,200	292,536.00	0.28
89	300024	机器人	17,020	292,403.60	0.28
90	688072	拓荆科技	1,900	292,049.00	0.28
91	002223	鱼跃医疗	8,200	291,920.00	0.28
92	600298	安琪酵母	8,300	291,911.00	0.28
93	002065	东华软件	30,400	291,840.00	0.28
94	600363	联创光电	5,000	291,650.00	0.28
95	688525	佰维存储	4,310	290,494.00	0.28
96	000034	神州数码	7,700	289,828.00	0.28
97	600873	梅花生物	27,100	289,699.00	0.28
98	603606	东方电缆	5,600	289,576.00	0.28
99	002202	金风科技	28,200	289,050.00	0.28
100	002673	西部证券	36,500	287,620.00	0.28
101	300395	菲利华	5,600	286,160.00	0.28
102	300496	中科创达	5,000	286,100.00	0.28
103	300857	协创数据	3,300	283,998.00	0.28
104	601615	明阳智能	24,700	283,803.00	0.28
105	000728	国元证券	35,600	280,884.00	0.27
106	002624	完美世界	18,500	280,645.00	0.27
107	300383	光环新网	19,600	280,280.00	0.27
108	002008	大族激光	11,500	280,255.00	0.27
109	000021	深科技	14,900	279,226.00	0.27
110	300115	长盈精密	12,900	276,060.00	0.27
111	603659	璞泰来	14,500	272,310.00	0.27
112	600895	张江高科	10,507	270,029.90	0.26
113	603160	汇顶科技	3,800	269,914.00	0.26
114	688578	艾力斯	2,900	269,816.00	0.26
115	300604	长川科技	6,000	269,460.00	0.26
116	600549	厦门钨业	12,860	269,031.20	0.26
117	300012	华测检测	23,000	268,870.00	0.26
118	603087	甘李药业	4,900	268,422.00	0.26
119	000426	兴业银锡	16,900	267,020.00	0.26
120	002155	湖南黄金	14,870	265,429.50	0.26
121	000733	振华科技	5,300	265,265.00	0.26
122	603605	珀莱雅	3,200	264,928.00	0.26
123	600171	上海贝岭	7,700	263,725.00	0.26

124	300627	华测导航	7,500	262,500.00	0.26
125	688220	翱捷科技	3,278	256,667.40	0.25
126	605589	圣泉集团	9,200	255,300.00	0.25
127	601216	君正集团	45,800	252,816.00	0.25
128	300699	光威复材	7,980	252,726.60	0.25
129	600392	盛和资源	19,077	251,244.09	0.24
130	000750	国海证券	60,900	250,908.00	0.24
131	601665	齐鲁银行	39,600	250,272.00	0.24
132	300037	新宙邦	7,100	249,920.00	0.24
133	000519	中兵红箭	11,400	249,546.00	0.24
134	688180	君实生物	7,320	248,733.60	0.24
135	000729	燕京啤酒	19,188	248,100.84	0.24
136	601997	贵阳银行	39,740	247,977.60	0.24
137	000932	华菱钢铁	56,300	247,720.00	0.24
138	688027	国盾量子	900	247,509.00	0.24
139	002444	巨星科技	9,700	247,447.00	0.24
140	300003	乐普医疗	17,900	246,662.00	0.24
141	600153	建发股份	23,600	244,732.00	0.24
142	601717	中创智领	14,700	244,314.00	0.24
143	688052	纳芯微	1,400	244,286.00	0.24
144	688361	中科飞测	2,900	244,151.00	0.24
145	600060	海信视像	10,600	244,012.00	0.24
146	601990	南京证券	30,100	243,208.00	0.24
147	000878	云南铜业	19,100	242,952.00	0.24
148	601233	桐昆股份	22,900	242,740.00	0.24
149	601696	中银证券	22,700	242,663.00	0.24
150	300073	当升科技	5,500	241,285.00	0.23
151	300001	特锐德	10,000	239,700.00	0.23
152	300142	沃森生物	21,700	238,700.00	0.23
153	002821	凯莱英	2,700	238,275.00	0.23
154	002414	高德红外	23,200	237,800.00	0.23
155	600673	东阳光	20,400	237,252.00	0.23
156	603979	金诚信	5,100	236,844.00	0.23
157	600369	西南证券	54,200	235,770.00	0.23
158	002837	英维克	7,900	234,709.00	0.23
159	600699	均胜电子	13,400	233,696.00	0.23
160	300373	扬杰科技	4,500	233,550.00	0.23
161	002007	华兰生物	14,900	233,483.00	0.23
162	600118	中国卫星	8,100	231,417.00	0.23
163	600521	华海药业	12,300	229,149.00	0.22
164	000893	亚钾国际	7,600	229,064.00	0.22
165	600177	雅戈尔	31,376	229,044.80	0.22
166	600398	海澜之家	32,600	226,896.00	0.22
167	688065	凯赛生物	4,801	226,127.10	0.22

168	002152	广电运通	16,800	225,792.00	0.22
169	603345	安井食品	2,800	225,176.00	0.22
170	600704	物产中大	42,456	223,743.12	0.22
171	600435	北方导航	14,325	223,326.75	0.22
172	688249	晶合集成	11,000	222,970.00	0.22
173	600909	华安证券	38,100	222,123.00	0.22
174	000738	航发控制	10,700	222,025.00	0.22
175	300748	金力永磁	9,300	221,712.00	0.22
176	603179	新泉股份	4,700	220,759.00	0.21
177	000623	吉林敖东	13,000	220,350.00	0.21
178	600497	驰宏锌锗	41,576	219,937.04	0.21
179	600316	洪都航空	5,800	218,660.00	0.21
180	002044	美年健康	42,500	218,450.00	0.21
181	000009	中国宝安	24,600	218,448.00	0.21
182	002958	青农商行	60,300	217,683.00	0.21
183	600765	中航重机	12,880	217,414.40	0.21
184	688188	柏楚电子	1,642	216,185.72	0.21
185	600141	兴发集团	10,500	215,565.00	0.21
186	002318	久立特材	9,200	215,188.00	0.21
187	600038	中直股份	5,500	213,455.00	0.21
188	603228	景旺电子	5,100	213,384.00	0.21
189	002409	雅克科技	3,900	213,291.00	0.21
190	000528	柳工	22,000	211,420.00	0.21
191	688385	复旦微电	4,286	211,171.22	0.21
192	000400	许继电气	9,700	211,169.00	0.21
193	600562	国睿科技	6,700	210,983.00	0.21
194	002683	广东宏大	6,200	210,428.00	0.20
195	300757	罗博特科	1,400	209,958.00	0.20
196	001696	宗申动力	9,300	208,785.00	0.20
197	600155	华创云信	29,935	208,347.60	0.20
198	300919	中伟股份	6,300	207,144.00	0.20
199	300724	捷佳伟创	3,800	206,340.00	0.20
200	002607	中公教育	67,100	205,326.00	0.20
201	000960	锡业股份	13,400	205,020.00	0.20
202	600637	东方明珠	27,370	204,453.90	0.20
203	300623	捷捷微电	6,800	202,640.00	0.20
204	600884	杉杉股份	21,400	202,444.00	0.20
205	603939	益丰药房	8,264	202,220.08	0.20
206	600498	烽火通信	9,600	201,888.00	0.20
207	600529	山东药玻	9,000	199,260.00	0.19
208	000415	渤海租赁	59,500	198,135.00	0.19
209	300558	贝达药业	3,400	197,030.00	0.19
210	002739	万达电影	17,200	196,596.00	0.19
211	000039	中集集团	25,000	196,500.00	0.19

212	600563	法拉电子	1,800	196,362.00	0.19
213	688568	中科星图	5,400	194,454.00	0.19
214	002653	海思科	4,600	194,212.00	0.19
215	002841	视源股份	5,600	193,760.00	0.19
216	600486	扬农化工	3,311	192,038.00	0.19
217	002926	华西证券	21,400	191,316.00	0.19
218	600901	江苏金租	31,457	190,629.42	0.19
219	301358	湖南裕能	6,100	190,259.00	0.19
220	002025	航天电器	3,700	190,217.00	0.19
221	000887	中鼎股份	10,800	189,972.00	0.19
222	300763	锦浪科技	3,300	189,387.00	0.18
223	002385	大北农	46,800	189,072.00	0.18
224	300285	国瓷材料	10,800	187,380.00	0.18
225	688017	绿的谐波	1,500	187,335.00	0.18
226	002939	长城证券	22,000	184,360.00	0.18
227	600820	隧道股份	30,000	183,000.00	0.18
228	300144	宋城演艺	21,400	182,970.00	0.18
229	600863	内蒙华电	44,500	182,895.00	0.18
230	002568	百润股份	7,100	181,831.00	0.18
231	600132	重庆啤酒	3,300	181,830.00	0.18
232	300679	电连技术	4,000	181,520.00	0.18
233	000723	美锦能源	41,800	180,576.00	0.18
234	603486	科沃斯	3,100	180,513.00	0.18
235	600008	首创环保	59,700	180,294.00	0.18
236	000513	丽珠集团	5,000	180,200.00	0.18
237	002312	川发龙蟒	15,500	177,940.00	0.17
238	600516	方大炭素	38,337	177,883.68	0.17
239	600390	五矿资本	30,500	177,815.00	0.17
240	002064	华峰化学	26,900	177,809.00	0.17
241	002080	中材科技	9,100	177,450.00	0.17
242	603568	伟明环保	9,259	176,661.72	0.17
243	688538	和辉光电	75,381	176,391.54	0.17
244	600998	九州通	34,261	176,101.54	0.17
245	300487	蓝晓科技	3,500	176,050.00	0.17
246	600763	通策医疗	4,264	176,017.92	0.17
247	000703	恒逸石化	29,900	175,812.00	0.17
248	600166	福田汽车	64,600	175,066.00	0.17
249	688114	华大智造	2,700	175,041.00	0.17
250	688582	芯动联科	2,600	174,720.00	0.17
251	600170	上海建工	72,600	173,514.00	0.17
252	002262	恩华药业	8,300	172,474.00	0.17
253	603816	顾家家居	6,723	171,570.96	0.17
254	600208	衢州发展	57,916	171,431.36	0.17
255	600312	平高电气	11,100	170,829.00	0.17

256	601179	中国西电	27,800	170,692.00	0.17
257	002500	山西证券	29,200	170,528.00	0.17
258	603589	口子窖	4,900	170,520.00	0.17
259	605358	立昂微	7,300	170,090.00	0.17
260	601155	新城控股	12,400	169,632.00	0.17
261	300676	华大基因	3,400	169,218.00	0.16
262	000683	博源化工	35,300	169,087.00	0.16
263	600021	上海电力	19,200	168,768.00	0.16
264	002203	海亮股份	16,300	168,216.00	0.16
265	600985	淮北矿业	14,600	165,564.00	0.16
266	600126	杭钢股份	18,339	165,051.00	0.16
267	002244	滨江集团	16,900	164,775.00	0.16
268	600380	健康元	14,900	164,347.00	0.16
269	600583	海油工程	30,100	164,346.00	0.16
270	002432	九安医疗	4,500	163,935.00	0.16
271	688183	生益电子	3,200	163,840.00	0.16
272	601000	唐山港	40,300	163,618.00	0.16
273	600348	华阳股份	24,550	163,503.00	0.16
274	000591	太阳能	37,200	163,308.00	0.16
275	000060	中金岭南	35,600	163,048.00	0.16
276	000403	派林生物	8,990	162,988.70	0.16
277	603885	吉祥航空	12,040	162,178.80	0.16
278	000921	海信家电	6,300	161,910.00	0.16
279	000830	鲁西化工	15,700	161,710.00	0.16
280	688728	格科微	10,500	161,700.00	0.16
281	603379	三美股份	3,360	161,683.20	0.16
282	600872	中炬高新	8,500	161,500.00	0.16
283	000629	钒钛股份	63,000	161,280.00	0.16
284	603338	浙江鼎力	3,400	161,160.00	0.16
285	002603	以岭药业	11,400	160,740.00	0.16
286	601991	大唐发电	50,700	160,719.00	0.16
287	600535	天士力	10,200	159,630.00	0.16
288	002984	森麒麟	8,500	159,375.00	0.16
289	688278	特宝生物	2,200	158,642.00	0.15
290	300567	精测电子	2,600	157,586.00	0.15
291	600816	建元信托	53,400	157,530.00	0.15
292	002056	横店东磁	11,100	157,065.00	0.15
293	002439	启明星辰	9,800	156,702.00	0.15
294	600095	湘财股份	15,500	155,465.00	0.15
295	300146	汤臣倍健	13,800	155,112.00	0.15
296	600970	中材国际	17,965	154,139.70	0.15
297	600499	科达制造	15,700	153,860.00	0.15
298	603927	中科软	7,940	153,559.60	0.15
299	000062	深圳华强	5,700	153,102.00	0.15

300	601880	辽港股份	102,000	153,000.00	0.15
301	601016	节能风电	52,820	152,649.80	0.15
302	300390	天华新能	7,970	151,987.90	0.15
303	002423	中粮资本	12,400	151,652.00	0.15
304	603000	人民网	7,500	151,575.00	0.15
305	000636	风华高科	11,000	151,140.00	0.15
306	600511	国药股份	5,182	151,107.12	0.15
307	601611	中国核建	16,400	150,716.00	0.15
308	000958	电投产融	22,000	150,480.00	0.15
309	603737	三棵树	4,064	149,758.40	0.15
310	688520	神州细胞	2,500	149,625.00	0.15
311	600685	中船防务	5,500	149,545.00	0.15
312	000563	陕国投 A	41,800	149,226.00	0.15
313	601666	平煤股份	20,100	148,941.00	0.15
314	603298	杭叉集团	7,100	148,745.00	0.14
315	301308	江波龙	1,700	148,733.00	0.14
316	600859	王府井	10,700	148,623.00	0.14
317	300212	易华录	6,800	147,968.00	0.14
318	002773	康弘药业	5,100	147,747.00	0.14
319	600655	豫园股份	26,600	147,630.00	0.14
320	603077	和邦生物	84,200	147,350.00	0.14
321	000155	川能动力	15,000	147,300.00	0.14
322	601456	国联民生	14,200	146,970.00	0.14
323	600483	福能股份	15,200	146,528.00	0.14
324	600004	白云机场	16,100	146,510.00	0.14
325	000598	兴蓉环境	20,300	146,363.00	0.14
326	600325	华发股份	30,000	146,100.00	0.14
327	601966	玲珑轮胎	9,900	145,233.00	0.14
328	600131	国网信通	8,200	145,140.00	0.14
329	603899	晨光股份	5,000	144,950.00	0.14
330	300677	英科医疗	6,100	144,448.00	0.14
331	603156	养元饮品	6,800	143,888.00	0.14
332	600378	昊华科技	5,300	143,471.00	0.14
333	601958	金钼股份	13,100	143,314.00	0.14
334	000050	深天马 A	16,600	141,432.00	0.14
335	688301	奕瑞科技	1,611	141,139.71	0.14
336	600282	南钢股份	33,500	140,700.00	0.14
337	000951	中国重汽	8,000	140,640.00	0.14
338	000987	越秀资本	20,455	140,321.30	0.14
339	300529	健帆生物	6,500	140,205.00	0.14
340	002507	涪陵榨菜	10,960	140,178.40	0.14
341	688234	天岳先进	2,389	139,875.95	0.14
342	002756	永兴材料	4,400	139,700.00	0.14
343	600271	航天信息	15,100	139,524.00	0.14

344	601001	晋控煤业	11,400	139,308.00	0.14
345	600754	锦江酒店	6,200	139,128.00	0.14
346	301536	星宸科技	2,300	138,690.00	0.14
347	600598	北大荒	9,600	138,432.00	0.13
348	300601	康泰生物	9,100	138,229.00	0.13
349	688297	中无人机	2,582	137,878.80	0.13
350	000559	万向钱潮	18,000	137,700.00	0.13
351	600737	中粮糖业	14,478	136,817.10	0.13
352	601918	新集能源	21,100	136,306.00	0.13
353	600663	陆家嘴	15,300	135,558.00	0.13
354	600582	天地科技	22,552	135,086.48	0.13
355	002429	兆驰股份	30,700	134,466.00	0.13
356	601333	广深铁路	46,200	133,518.00	0.13
357	688772	珠海冠宇	9,300	132,897.00	0.13
358	300070	碧水源	29,500	132,750.00	0.13
359	300751	迈为股份	1,900	132,164.00	0.13
360	002120	韵达股份	19,700	131,990.00	0.13
361	601866	中远海发	53,300	131,651.00	0.13
362	600566	济川药业	5,000	131,650.00	0.13
363	600867	通化东宝	16,000	131,200.00	0.13
364	300735	光弘科技	5,200	130,520.00	0.13
365	688778	厦钨新能	2,333	130,461.36	0.13
366	603688	石英股份	3,700	130,314.00	0.13
367	600764	中国海防	3,830	130,220.00	0.13
368	601231	环旭电子	8,900	130,207.00	0.13
369	002430	杭氧股份	6,700	130,114.00	0.13
370	600329	达仁堂	3,900	130,104.00	0.13
371	603290	斯达半导	1,600	130,032.00	0.13
372	603341	龙旗科技	3,200	130,016.00	0.13
373	600739	辽宁成大	11,800	129,800.00	0.13
374	003031	中瓷电子	2,420	128,768.20	0.13
375	600258	首旅酒店	9,100	128,583.00	0.13
376	688363	华熙生物	2,500	128,375.00	0.13
377	300888	稳健医疗	3,120	128,232.00	0.12
378	601098	中南传媒	9,700	127,264.00	0.12
379	600995	南网储能	13,000	127,140.00	0.12
380	603728	鸣志电器	2,200	126,434.00	0.12
381	688318	财富趋势	1,100	126,412.00	0.12
382	600707	彩虹股份	19,500	125,970.00	0.12
383	601212	白银有色	40,100	125,513.00	0.12
384	000032	深桑达 A	6,200	125,426.00	0.12
385	000027	深圳能源	19,475	124,250.50	0.12
386	603858	步长制药	7,600	123,424.00	0.12
387	688561	奇安信	3,600	122,328.00	0.12

388	600578	京能电力	27,200	122,128.00	0.12
389	603529	爱玛科技	3,550	122,120.00	0.12
390	002508	老板电器	6,400	121,664.00	0.12
391	002299	圣农发展	8,500	121,465.00	0.12
392	000709	河钢股份	56,200	121,392.00	0.12
393	688676	金盘科技	3,600	120,420.00	0.12
394	301498	乖宝宠物	1,100	120,307.00	0.12
395	300573	兴齐眼药	2,320	120,152.80	0.12
396	600906	财达证券	17,600	120,032.00	0.12
397	000883	湖北能源	26,600	119,966.00	0.12
398	000967	盈峰环境	17,200	119,540.00	0.12
399	002831	裕同科技	5,100	119,442.00	0.12
400	002670	国盛金控	7,900	118,895.00	0.12
401	600517	国网英大	23,300	118,830.00	0.12
402	600546	山煤国际	13,500	117,855.00	0.11
403	601399	国机重装	39,200	117,600.00	0.11
404	600959	江苏有线	34,100	117,304.00	0.11
405	600848	上海临港	12,920	117,184.40	0.11
406	601928	凤凰传媒	10,400	116,168.00	0.11
407	601156	东航物流	8,700	113,883.00	0.11
408	600968	海油发展	27,600	112,608.00	0.11
409	600808	马钢股份	32,600	112,470.00	0.11
410	600528	中铁工业	15,200	112,176.00	0.11
411	000739	普洛药业	8,000	112,000.00	0.11
412	300595	欧普康视	7,300	111,471.00	0.11
413	000825	太钢不锈	31,000	111,290.00	0.11
414	002572	索菲亚	7,900	110,679.00	0.11
415	601118	海南橡胶	23,300	109,976.00	0.11
416	601636	旗滨集团	21,900	109,719.00	0.11
417	603225	新凤鸣	10,300	109,695.00	0.11
418	301301	川宁生物	9,100	109,564.00	0.11
419	002266	浙富控股	35,400	109,032.00	0.11
420	603565	中谷物流	11,400	108,870.00	0.11
421	601608	中信重工	24,900	108,813.00	0.11
422	600977	中国电影	10,100	108,272.00	0.11
423	000543	皖能电力	15,400	107,800.00	0.10
424	600801	华新水泥	9,100	107,744.00	0.10
425	600871	石化油服	55,200	107,640.00	0.10
426	688563	航材股份	1,900	107,597.00	0.10
427	601106	中国一重	38,000	106,400.00	0.10
428	603650	彤程新材	3,300	106,095.00	0.10
429	601598	中国外运	21,400	105,502.00	0.10
430	688387	信科移动	18,617	105,186.05	0.10
431	600056	中国医药	10,120	104,640.80	0.10

432	600062	华润双鹤	5,600	104,496.00	0.10
433	000582	北部湾港	12,600	103,950.00	0.10
434	688702	盛科通信	1,700	103,836.00	0.10
435	000785	居然智家	33,800	103,090.00	0.10
436	300957	贝泰妮	2,300	101,706.00	0.10
437	603233	大参林	6,179	100,717.70	0.10
438	688281	华秦科技	1,628	98,510.28	0.10
439	600925	苏能股份	18,700	97,801.00	0.10
440	600373	中文传媒	9,400	96,538.00	0.09
441	002153	石基信息	11,130	96,385.80	0.09
442	601965	中国汽研	5,400	95,850.00	0.09
443	000429	粤高速 A	7,100	94,643.00	0.09
444	000537	中绿电	11,239	93,958.04	0.09
445	600606	绿地控股	57,580	93,855.40	0.09
446	002372	伟星新材	8,700	90,132.00	0.09
447	601568	北元集团	21,540	89,391.00	0.09
448	600361	创新新材	22,300	88,977.00	0.09
449	600098	广州发展	14,200	88,750.00	0.09
450	001286	陕西能源	10,200	88,740.00	0.09
451	688425	铁建重工	21,705	88,556.40	0.09
452	603658	安图生物	2,300	86,250.00	0.08
453	600688	上海石化	30,100	85,785.00	0.08
454	003022	联泓新科	5,400	85,482.00	0.08
455	600612	老凤祥	1,700	84,575.00	0.08
456	000937	冀中能源	14,400	82,800.00	0.08
457	301165	锐捷网络	1,340	82,356.40	0.08
458	601019	山东出版	8,500	80,495.00	0.08
459	688349	三一重能	3,159	78,785.46	0.08
460	000898	鞍钢股份	32,700	75,864.00	0.07
461	002608	江苏国信	10,300	75,499.00	0.07
462	600339	中油工程	22,900	74,883.00	0.07
463	601139	深圳燃气	11,700	74,412.00	0.07
464	688100	威胜信息	2,000	74,100.00	0.07
465	603707	健友股份	6,623	73,846.45	0.07
466	600032	浙江新能	9,700	73,332.00	0.07
467	600720	中交设计	9,400	72,662.00	0.07
468	688248	南网科技	2,307	72,578.22	0.07
469	000959	首钢股份	21,200	72,080.00	0.07
470	600928	西安银行	18,200	71,344.00	0.07
471	003035	南网能源	15,400	70,686.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	8,100	70,551.00	0.07
473	688475	萤石网络	2,200	69,344.00	0.07
474	002461	珠江啤酒	6,000	67,740.00	0.07
475	603556	海兴电力	2,600	66,222.00	0.06

476	601228	广州港	20,400	65,892.00	0.06
477	301267	华夏眼科	3,400	65,178.00	0.06
478	688375	国博电子	1,037	62,230.37	0.06
479	688172	燕东微	3,121	61,358.86	0.06
480	603786	科博达	1,100	60,951.00	0.06
481	600927	永安期货	4,000	59,240.00	0.06
482	688032	禾迈股份	592	59,117.12	0.06
483	601061	中信金属	7,300	57,743.00	0.06
484	002563	森马服饰	10,900	57,334.00	0.06
485	600007	中国国贸	2,700	55,566.00	0.05
486	000539	粤电力 A	12,000	54,480.00	0.05
487	002945	华林证券	3,700	53,169.00	0.05
488	688819	天能股份	1,900	52,744.00	0.05
489	300140	节能环保	8,500	52,445.00	0.05
490	600299	安迪苏	5,400	52,110.00	0.05
491	603826	坤彩科技	2,640	51,664.80	0.05
492	001213	中铁特货	12,100	49,126.00	0.05
493	601921	浙版传媒	6,000	48,360.00	0.05
494	601858	中国科传	2,100	40,845.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	1,200	37,212.00	0.04
496	601158	重庆水务	7,800	36,192.00	0.04
497	600956	新天绿能	4,200	32,424.00	0.03
498	001389	广合科技	500	29,385.00	0.03
499	688295	中复神鹰	1,400	29,120.00	0.03
500	603868	飞科电器	700	25,109.00	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	601117	中国化学	100,600	771,602.00	0.75
2	600803	新奥股份	28,700	542,430.00	0.53
3	600908	无锡银行	49,600	312,976.00	0.30
4	001965	招商公路	11,100	133,200.00	0.13
5	688411	海博思创	211	17,616.39	0.02
6	301458	钧崴电子	417	14,223.87	0.01
7	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
8	301602	超研股份	524	12,995.20	0.01
9	688583	思看科技	146	11,633.28	0.01
10	688757	胜科纳米	445	11,543.30	0.01
11	688545	兴福电子	410	11,049.50	0.01
12	301601	惠通科技	309	10,459.65	0.01

13	688775	影石创新	84	10,429.44	0.01
14	301479	弘景光电	86	6,696.82	0.01
15	001391	国货航	958	6,447.34	0.01
16	688755	汉邦科技	162	6,371.46	0.01
17	301275	汉朔科技	103	5,787.57	0.01
18	603072	天和磁材	106	5,771.70	0.01
19	001356	富岭股份	355	5,126.20	0.00
20	301173	毓恬冠佳	110	4,947.80	0.00
21	301501	恒鑫生活	99	4,476.78	0.00
22	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
23	001395	亚联机械	79	3,732.75	0.00
24	603210	泰鸿万立	159	2,481.99	0.00
25	603120	肯特催化	61	2,039.23	0.00
26	603014	威高血净	62	2,026.16	0.00
27	000983	山西焦煤	300	1,920.00	0.00
28	603400	华之杰	43	1,883.83	0.00
29	603382	海阳科技	79	1,768.81	0.00
30	603202	天有为	18	1,631.88	0.00
31	603409	汇通控股	45	1,499.40	0.00
32	603257	中国瑞林	40	1,498.80	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	002625	光启技术	2,170,142.00	1.71
2	000988	华工科技	1,621,790.00	1.28
3	300339	润和软件	1,491,449.00	1.17
4	002384	东山精密	1,319,833.00	1.04
5	300476	胜宏科技	1,269,439.00	1.00
6	002966	苏州银行	1,249,803.00	0.98
7	300207	欣旺达	1,249,568.98	0.98
8	002340	格林美	1,249,171.00	0.98
9	000423	东阿阿胶	1,163,868.00	0.92
10	002797	第一创业	1,163,521.00	0.91
11	002850	科达利	1,161,195.10	0.91
12	002156	通富微电	1,125,369.60	0.88
13	002595	豪迈科技	1,086,743.00	0.85
14	002195	岩山科技	1,049,895.21	0.83
15	002273	水晶光电	1,044,303.00	0.82

16	002517	恺英网络	1,037,043.00	0.82
17	002185	华天科技	1,030,750.00	0.81
18	301236	软通动力	1,014,182.00	0.80
19	002261	拓维信息	1,010,504.00	0.79
20	002738	中矿资源	1,002,441.00	0.79

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	002625	光启技术	3,237,078.00	2.55
2	002384	东山精密	2,120,680.00	1.67
3	000988	华工科技	1,826,195.00	1.44
4	300339	润和软件	1,711,193.00	1.35
5	301236	软通动力	1,594,512.00	1.25
6	300476	胜宏科技	1,520,822.00	1.20
7	002340	格林美	1,389,037.00	1.09
8	300207	欣旺达	1,382,314.00	1.09
9	300866	安克创新	1,328,989.80	1.05
10	002966	苏州银行	1,305,261.00	1.03
11	002797	第一创业	1,292,858.00	1.02
12	002850	科达利	1,253,803.00	0.99
13	000423	东阿阿胶	1,245,058.00	0.98
14	002156	通富微电	1,207,782.20	0.95
15	002261	拓维信息	1,194,597.00	0.94
16	002195	岩山科技	1,191,522.00	0.94
17	002273	水晶光电	1,180,867.00	0.93
18	002202	金风科技	1,176,100.00	0.92
19	002517	恺英网络	1,164,165.00	0.92
20	002595	豪迈科技	1,160,104.00	0.91

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	146,662,468.45
卖出股票的收入（成交）总额	155,747,769.70

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州银行股份有限公司、天风证券股份有限公司、赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司、东吴证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	217,308.88
2	应收清算款	259,962.66

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	477,271.54

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688411	海博思创	17,616.39	0.02	新股锁定

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
2,361	46,463.36	47,795,238.00	43.57%	61,904,762.00	56.43%

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	招商证券股份有限公司	7,453,675.00	6.79%
2	申万宏源证券有限公司	7,391,110.00	6.74%
3	UBS AG	5,649,200.00	5.15%
4	华泰证券股份有限公司	5,150,107.00	4.69%
5	中信证券股份有限公司	4,690,658.00	4.28%
6	方正证券股份有限公司	4,176,837.00	3.81%
7	广发证券股份有限公司	3,888,143.00	3.54%
8	中信建投证券股份有限公司	3,124,949.00	2.85%
9	建信资本—建设银行—建信资本卓越 1 号集合资产管理计划	2,229,600.00	2.03%
10	何锦涛	1,098,900.00	1.00%

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（2021 年 8 月 18 日）基金份额总额	727,700,000.00
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	142,700,000.00
本报告期基金总申购份额	288,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	321,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,700,000.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

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

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-05-09
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别机制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提	公司已完成整改。

出整改意见)	
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	281,646,308.20	93.33%	41,948.26	91.41%	-
长江证券	2	20,126,382.70	6.67%	3,943.67	8.59%	-

注：1、交易单元的选择标准：

- (1) 实力雄厚、信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- (3) 具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；

(4) 研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

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

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易
------	------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2025-05-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。
客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688
客户投诉电话：（021）31089000
公司网址：http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司
二〇二五年八月三十日