

国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
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	52
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	52
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 盈利投资者数量占比	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	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 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	上证指数 ETF 国泰
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	2,042,503,665.00 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	倪莹	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	021-68476901
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	上海市黄浦区中山南路688号

	浦东大道1200号2层225室	
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路168号37层
邮政编码	200082	200120
法定代表人	周向勇	顾建忠

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	228,258,546.67
本期利润	81,375,738.20
加权平均基金份额本期利润	0.0458
本期加权平均净值利润率	3.45%
本期基金份额净值增长率	2.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	650,104,085.24
期末可供分配基金份额利润	0.3183
期末基金资产净值	2,692,607,750.24
期末基金份额净值	1.3183
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.35%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.11%	0.95%	5.20%	0.94%	-1.09%	0.01%
过去六个月	2.43%	0.98%	3.16%	0.95%	-0.73%	0.03%
过去一年	18.93%	0.84%	18.87%	0.83%	0.06%	0.01%
过去三年	43.11%	0.99%	27.87%	1.00%	15.24%	-0.01%
过去五年	44.45%	0.96%	14.01%	0.99%	30.44%	-0.03%
自基金合同生效起至今	51.35%	0.95%	21.72%	0.98%	29.63%	-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 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 21 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、国泰中证畜牧养殖 ETF、国泰中证医疗 ETF 联	2020-08-21	-	19 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，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

	接、国泰中证畜牧养殖 ETF 联接、国泰中证沪港深创新药产业 ETF、国泰中证沪港深创新药产业 ETF 发起联接、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF 的基金经理、国泰中证港股通科技 ETF、国泰中证港股通互联网 ETF 的基金经理，量化投资部总监				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 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）的基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 2 月任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 月至 2022 年 2 月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的基金经理，2021 年 6 月至 2026 年 3 月任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，2021 年 9 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开
--	--	--	--	--	---

					放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业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 12 月起兼任国泰沪深 300 增强策略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，2022 年 1 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月至 2025 年 7 月任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月至 2025 年 3 月任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月至 2026 年 5 月任国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 12 月起兼任国泰中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资部副总监，2018 年 7 月起任量化投资部总监。
吴中昊	国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、国泰沪深 300 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、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰中	2022-12-30	-	11 年	硕士研究生。曾任职于 Arrowstreet Capital（美国）。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 2 月

	证 1000 增强策略 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证煤炭 ETF、国泰创业板指数（LOF）、国泰中证香港内地国有企业 ETF（QDII）、国泰中证机器人 ETF、国泰北证 50 成份指数发起、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰恒生 A 股电网设备 ETF 的基金经理				起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 11 月起兼任国泰北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 12 月起兼任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和国泰恒生 A 股电网设备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、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场波动较大。一季度初，商业航天板块大幅上涨，带动市场热情升温。随后相关板块逐步降温，贵金属、化工等周期方向也在快速上涨后回落，市场转入震荡。3 月中旬，美伊冲突升级，霍尔木兹海峡通航受阻的消息推升全球避险情绪，A 股随之调整。整个一季度呈现冲高回落走势。

二季度，随着地缘风险阶段性缓和，A 股触底回升，主要宽基指数均以上涨收官。但市场内部分化很大，二季度仅 1524 家公司上涨，占全市场约 30%，全市场涨幅中位数为-14.9%；申万 31 个一级行业中仅 6 个行业上涨。经济数据方面，出口仍是经济的重要支撑，工业生产保持韧性，消费、地产等方向继续承压。

上半年大中小盘的代表，沪深 300，中证 500，中证 1000 分别上涨 8.1%，20.59%和 15.94%，并在风格上呈现强成长、动量风格。

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 2.43%，同期业绩比较基准收益率为 3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济总体保持韧性，但消费和地产的修复仍需观察。二季度科技与非科技板块走势过于分化，部分科技板块估值快速抬升，非科技方向则出现了一定程度的错杀。进入 7 月，科技板块波动加大，市场开始出现再平衡迹象。后续可适当关注红利、非银金融和微盘方向的修复

机会。

AI 仍然是中长期值得关注的方向，但未来的投资机会可能进一步分化。AI 产业的投资重心有望逐步由上游算力建设转向推理端和应用端。后续来看，能够形成真实需求并逐步贡献收入和利润的 AI 应用及垂直行业落地更值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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遵规守信、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，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	18,758,526.42	3,900,681.71
结算备付金		5,613,905.12	583,081.02
存出保证金		131,641.49	93,877.85
交易性金融资产	6.4.7.2	2,681,209,042.65	2,030,124,374.69
其中：股票投资		2,681,209,042.65	2,030,124,374.69
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		-	28,431.62
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		2,705,713,115.68	2,034,730,446.89
负 债 和 净 资 产			
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		8,334,900.87	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		334,753.63	284,834.67
应付托管费		111,584.54	94,944.89
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	4,324,126.40	222,225.50
负债合计		13,105,365.44	602,005.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,042,503,665.00	1,580,503,665.00
未分配利润	6.4.7.8	650,104,085.24	453,624,776.83
净资产合计		2,692,607,750.24	2,034,128,441.83
负债和净资产总计		2,705,713,115.68	2,034,730,446.89

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3183 元，基金份额总额 2,042,503,665.00 份。

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		83,789,566.52	143,561,026.27
1.利息收入		31,096.15	32,810.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,096.15	32,810.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		230,057,983.17	176,925,087.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	210,118,453.41	149,433,059.45
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	19,939,529.76	27,492,027.90
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	-146,882,808.47	-33,498,956.50
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	583,295.67	102,085.00
减：二、营业总支出		2,413,828.32	2,674,665.11
1. 管理人报酬		1,743,256.60	1,802,854.90
2. 托管费		581,085.57	600,951.64
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	89,486.15	270,858.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,375,738.20	140,886,361.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,375,738.20	140,886,361.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		81,375,738.20	140,886,361.16

6.3 净资产变动表

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 580, 503, 665. 00	453, 624, 776. 83	2, 034, 128, 441. 83
二、本期期初净资产	1,580,503,665.00	453,624,776.83	2,034,128,441.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	462,000,000.00	196,479,308.41	658,479,308.41
（一）、综合收益总额	-	81,375,738.20	81,375,738.20
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	462,000,000.00	115,103,570.21	577,103,570.21

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	3,732,000,000.00	1,168,420,957.47	4,900,420,957.47
2.基金赎回款	-3,270,000,000.00	-1,053,317,387.26	-4,323,317,387.26
(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	2,042,503,665.00	650,104,085.24	2,692,607,750.24
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2, 828, 503, 665. 00	143, 890, 183. 30	2, 972, 393, 848. 30
二、本期期初净资产	2, 828, 503, 665. 00	143, 890, 183. 30	2, 972, 393, 848. 30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,035,000,000.00	50,679,023.75	-984,320,976.25
(一)、综合收益总额	-	140,886,361.16	140,886,361.16
(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)	-1,035,000,000.00	-90,207,337.41	-1,125,207,337.41
其中：1.基金申购款	1,509,000,000.00	46,109,334.79	1,555,109,334.79
2.基金赎回款	-2,544,000,000.00	-136,316,672.20	-2,680,316,672.20
(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	1,793,503,665.00	194,569,207.05	1,988,072,872.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰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》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 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关

于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

的个人所得税。

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

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	18,758,526.42
等于：本金	18,757,346.74
加：应计利息	1,179.68
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	18,758,526.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,723,506,457.73	-	2,681,209,042.65	-42,297,415.08
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		2,723,506,457.73	-	2,681,209,042.65	-42,297,415.08

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	429,069.47
其中：交易所市场	429,069.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
可退替代款	269,114.40

应付替代款	3,536,682.38
合计	4,324,126.40

注：1、应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,580,503,665.00	1,580,503,665.00
本期申购	3,732,000,000.00	3,732,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,270,000,000.00	-3,270,000,000.00
本期末	2,042,503,665.00	2,042,503,665.00

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。

6.4.7.8 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	796,657,811.78	-343,033,034.95	453,624,776.83
本期期初	796,657,811.78	-343,033,034.95	453,624,776.83
本期利润	228,258,546.67	-146,882,808.47	81,375,738.20
本期基金份额交易产生的变动数	286,087,006.15	-170,983,435.94	115,103,570.21
其中：基金申购款	2,172,167,974.31	-1,003,747,016.84	1,168,420,957.47
基金赎回款	-1,886,080,968.16	832,763,580.90	-1,053,317,387.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,311,003,364.60	-660,899,279.36	650,104,085.24

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,177.92
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	1,735.76

其他	182.47
合计	31,096.15

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	145,234,401.32
股票投资收益——赎回差价收入	64,884,052.09
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	210,118,453.41

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,411,141,866.70
减：卖出股票成本总额	1,264,559,155.72
减：交易费用	1,348,309.66
买卖股票差价收入	145,234,401.32

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	4,323,317,387.26
减：现金支付赎回款总额	3,041,009.26
减：赎回股票成本总额	4,255,392,325.91
减：交易费用	-
赎回差价收入	64,884,052.09

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

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,939,529.76
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	19,939,529.76

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-146,882,808.47
——股票投资	-146,882,808.47
——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	-146,882,808.47

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。

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	583,295.67
合计	583,295.67

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	226.00
合计	89,486.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,743,256.60	1,802,854.90

其中：应支付销售机构的客户维护费	50,253.93	44,416.36
应支付基金管理人的净管理费	1,693,002.67	1,758,438.54

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	581,085.57	600,951.64

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国泰上证综合 ETF 联接	301,041,101.00	14.74%	216,906,580.00	13.72%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	18,758,526.42	29,177.92	8,391,415.61	31,004.41

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

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601088	中国神华	2026-04-09	1-6 个月（含）	非公开发行流通受限	43.70	37.71	297,483.00	13,000,007.10	11,218,083.93	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	114.28	676.94	7,629.00	871,842.12	5,164,375.26	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	104.66	768.89	3,994.00	418,012.04	3,070,946.66	-

688783	西安奕材	2025-10-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.62	57.42	44,370.00	382,469.40	2,547,725.40	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.06	48.56	16,470.00	478,618.20	799,783.20	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月以上	新股锁定流通受限	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
60328	林平	2026-0	6 个月	新股	37.88	34.87	46.00	1,742.	1,604.	-

4	发展	2-03	以上	锁定 流通 受限				48	02	
---	----	------	----	----------------	--	--	--	----	----	--

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

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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	5,400.00	2,743,895.54	4,492,800.00	-

注：本基金截至 2026 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，该类股票将在消除所公布事项的重大影响后，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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证

金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,758,526.42	-	-	-	18,758,526.42
结算备付金	5,613,905.12	-	-	-	5,613,905.12
存出保证金	131,641.49	-	-	-	131,641.49
交易性金融资产	-	-	-	2,681,209,042.65	2,681,209,042.65
资产总计	24,504,073.03	-	-	2,681,209,042.65	2,705,713,115.68
负债					
应付清算款	-	-	-	8,334,900.87	8,334,900.87
应付管理人报酬	-	-	-	334,753.63	334,753.63
应付托管费	-	-	-	111,584.54	111,584.54
其他负债	-	-	-	4,324,126.40	4,324,126.40
负债总计	-	-	-	13,105,365.44	13,105,365.44
利率敏感度缺口	24,504,073.03	-	-	2,668,103,677.21	2,692,607,750.24
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,900,681.71	-	-	-	3,900,681.71
结算备付金	583,081.02	-	-	-	583,081.02
存出保证金	93,877.85	-	-	-	93,877.85
交易性金融资产	-	-	-	2,030,124,374.69	2,030,124,374.69
应收清算款	-	-	-	28,431.62	28,431.62
资产总计	4,577,640.58	-	-	2,030,152,806.31	2,034,730,446.89

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	284,834.67	284,834.67
应付托管费	-	-	-	94,944.89	94,944.89
其他负债	-	-	-	222,225.50	222,225.50
负债总计	-	-	-	602,005.06	602,005.06
利率敏感度缺口	4,577,640.58	-	-	2,029,550,801.25	2,034,128,441.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,681,209,042.65	99.58	2,030,124,374.69	99.80
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	2,681,209,042.65	99.58	2,030,124,374.69	99.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 135,064,614.32	增加约 101,476,561.50
	业绩比较基准下降 5%	减少约 135,064,614.32	减少约 101,476,561.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	2,653,088,171.98	2,016,072,933.81
第二层次	4,492,800.00	7,318,168.48
第三层次	23,628,070.67	6,733,272.40
合计	2,681,209,042.65	2,030,124,374.69

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 4,900,420,957.47 元(2025 年上半年度：1,555,109,334.79 元)，其中包括以股票支付的申购款 4,700,680,883.97 元和以现金支付的申购款 199,740,073.50 元(2025 年上半年度：其中包括以股票支付的申购款 1,440,263,124.21 元和以现金支付的申购款 114,846,210.58 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	2,681,209,042.65	99.09

	其中：股票	2,681,209,042.65	99.09
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	24,372,431.54	0.90
8	其他各项资产	131,641.49	0.00
9	合计	2,705,713,115.68	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	645,576.00	0.02
B	采矿业	240,221,532.24	8.92
C	制造业	1,328,788,083.52	49.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	114,187,730.92	4.24
E	建筑业	48,735,747.71	1.81
F	批发和零售业	13,796,708.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	72,491,027.32	2.69
H	住宿和餐饮业	726,796.00	0.03

I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,873,330.16	7.61
J	金融业	548,110,878.21	20.36
K	房地产业	34,172,545.86	1.27
L	租赁和商务服务业	14,669,371.94	0.54
M	科学研究和技术服务业	22,455,544.52	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	20,637,321.36	0.77
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	4,285,116.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	2,668,797,309.76	99.12

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,409,986.74	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,409,986.74	0.46

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	601288	农业银行	12,418,212	75,378,546.84	2.80
2	601398	工商银行	10,625,124	75,119,626.68	2.79
3	601857	中国石油	6,539,347	56,761,531.96	2.11
4	600519	贵州茅台	45,340	53,750,116.60	2.00
5	601988	中国银行	8,553,060	48,923,503.20	1.82
6	601138	工业富联	659,496	47,582,636.40	1.77
7	688041	海光信息	126,629	46,890,718.70	1.74
8	688256	寒武纪	28,111	44,852,506.05	1.67
9	600036	招商银行	1,132,446	40,201,833.00	1.49
10	601088	中国神华	930,037	35,912,992.09	1.33
11	601318	中国平安	707,631	33,782,303.94	1.25
12	601628	中国人寿	947,733	33,502,361.55	1.24
13	600900	长江电力	1,005,484	26,615,161.48	0.99
14	600183	生益科技	152,840	26,502,456.00	0.98
15	601899	紫金矿业	1,020,174	25,647,174.36	0.95
16	688008	澜起科技	82,260	25,492,374.00	0.95
17	603986	兆易创新	28,400	23,146,000.00	0.86
18	600030	中信证券	799,925	22,981,845.25	0.85
19	601658	邮储银行	4,289,000	21,144,770.00	0.79
20	600919	江苏银行	1,873,238	20,193,505.64	0.75
21	601319	中国人保	2,861,400	19,343,064.00	0.72
22	688012	中微公司	40,736	19,084,816.00	0.71
23	688981	中芯国际	114,018	18,108,338.76	0.67
24	600150	中国船舶	520,016	17,571,340.64	0.65
25	601816	京沪高铁	3,877,690	17,565,935.70	0.65
26	600989	宝丰能源	859,080	17,465,096.40	0.65

27	688498	源杰科技	8,980	16,936,280.00	0.63
28	601601	中国太保	589,400	16,809,688.00	0.62
29	600309	万华化学	243,386	16,650,036.26	0.62
30	600938	中国海油	605,500	16,439,325.00	0.61
31	601728	中国电信	3,039,330	15,774,122.70	0.59
32	600809	山西汾酒	141,100	15,432,107.00	0.57
33	600025	华能水电	1,713,541	15,233,379.49	0.57
34	600028	中国石化	3,302,931	14,731,072.26	0.55
35	601600	中国铝业	1,771,200	14,559,264.00	0.54
36	601009	南京银行	1,469,175	14,530,140.75	0.54
37	600584	长电科技	140,184	14,516,053.20	0.54
38	601328	交通银行	2,184,137	14,044,000.91	0.52
39	600690	海尔智家	682,000	13,919,620.00	0.52
40	688521	芯原股份	36,700	13,620,838.00	0.51
41	601169	北京银行	2,660,754	13,037,694.60	0.48
42	601225	陕西煤业	638,163	12,986,617.05	0.48
43	601668	中国建筑	2,878,480	12,492,603.20	0.46
44	600050	中国联通	3,121,700	12,486,800.00	0.46
45	601127	赛力斯	199,700	12,231,625.00	0.45
46	600893	航发动力	313,016	12,001,033.44	0.45
47	688176	亚虹医药	1,191,797	11,822,626.24	0.44
48	688469	芯联集成	1,100,044	11,671,466.84	0.43
49	688047	龙芯中科	75,253	11,639,381.51	0.43
50	600487	亨通光电	105,480	11,533,183.20	0.43
51	600219	南山铝业	2,876,939	11,478,986.61	0.43
52	688110	东芯股份	55,938	11,394,570.60	0.42
53	688536	思瑞浦	31,200	11,359,608.00	0.42
54	600489	中金黄金	620,900	11,207,245.00	0.42
55	603019	中科曙光	100,886	10,818,005.78	0.40
56	688559	海目星	127,798	10,724,808.16	0.40
57	603538	美诺华	326,888	10,640,204.40	0.40
58	688002	睿创微纳	67,032	10,369,180.08	0.39
59	601888	中国中免	192,846	10,357,758.66	0.38
60	600406	国电南瑞	451,743	10,322,327.55	0.38
61	603259	药明康德	82,600	10,284,526.00	0.38
62	688099	晶晨股份	97,773	10,060,841.70	0.37
63	603993	洛阳钼业	565,800	9,929,790.00	0.37
64	600276	恒瑞医药	190,400	9,908,416.00	0.37
65	601390	中国中铁	2,376,005	9,907,940.85	0.37
66	688301	奕瑞科技	77,660	9,629,840.00	0.36
67	601778	晶科科技	2,231,500	9,595,450.00	0.36
68	688120	华海清科	29,695	9,567,135.10	0.36
69	600426	华鲁恒升	390,807	9,348,103.44	0.35
70	600887	伊利股份	387,459	9,283,517.64	0.34

71	601818	光大银行	3,199,800	9,247,422.00	0.34
72	601985	中国核电	1,015,900	9,173,577.00	0.34
73	601872	招商轮船	508,600	8,936,102.00	0.33
74	600988	赤峰黄金	327,200	8,611,904.00	0.32
75	600875	东方电气	294,700	8,478,519.00	0.31
76	600105	永鼎股份	123,400	8,327,032.00	0.31
77	600674	川投能源	586,092	8,304,923.64	0.31
78	688220	翱捷科技	65,849	8,186,347.68	0.30
79	603659	璞泰来	281,450	8,142,348.50	0.30
80	688361	中科飞测	18,856	8,108,080.00	0.30
81	603931	格林达	136,000	8,078,400.00	0.30
82	600346	恒力石化	456,000	8,075,760.00	0.30
83	601012	隆基绿能	611,567	8,023,759.04	0.30
84	688326	经纬恒润	110,411	7,825,931.68	0.29
85	603933	睿能科技	345,500	7,791,025.00	0.29
86	603268	松发股份	55,600	7,743,968.00	0.29
87	600986	浙文互联	1,109,000	7,740,820.00	0.29
88	600331	宏达股份	703,800	7,734,762.00	0.29
89	601066	中信建投	264,000	7,674,480.00	0.29
90	600941	中国移动	88,960	7,662,124.80	0.28
91	603799	华友钴业	158,100	7,629,906.00	0.28
92	688525	佰维存储	15,200	7,519,896.00	0.28
93	600926	杭州银行	520,035	7,514,505.75	0.28
94	600015	华夏银行	1,159,810	7,411,185.90	0.28
95	601216	君正集团	1,659,976	7,403,492.96	0.27
96	600100	同方股份	1,069,800	7,328,130.00	0.27
97	601077	渝农商行	1,197,900	7,319,169.00	0.27
98	603345	安井食品	91,150	7,309,318.50	0.27
99	600075	新疆天业	1,797,721	7,262,792.84	0.27
100	688195	腾景科技	37,380	7,198,640.40	0.27
101	601108	财通证券	830,160	7,180,884.00	0.27
102	600547	山东黄金	309,224	7,139,982.16	0.27
103	603063	禾望电气	132,000	6,981,480.00	0.26
104	603256	宏和科技	25,900	6,872,047.00	0.26
105	688599	天合光能	484,305	6,838,386.60	0.25
106	600498	烽火通信	92,700	6,822,720.00	0.25
107	601139	深圳燃气	1,204,563	6,817,826.58	0.25
108	601212	白银有色	1,331,800	6,765,544.00	0.25
109	603200	上海洗霸	154,700	6,707,792.00	0.25
110	688155	先惠技术	82,496	6,673,101.44	0.25
111	600031	三一重工	384,454	6,643,365.12	0.25
112	600886	国投电力	497,556	6,622,470.36	0.25
113	688141	杰华特	43,016	6,602,956.00	0.25
114	601608	中信重工	1,380,714	6,586,005.78	0.24

115	600660	福耀玻璃	129,985	6,556,443.40	0.24
116	601166	兴业银行	394,305	6,529,690.80	0.24
117	600585	海螺水泥	384,500	6,517,275.00	0.24
118	601696	中银证券	511,000	6,464,150.00	0.24
119	600722	金牛化工	789,700	6,412,364.00	0.24
120	600711	盛屯矿业	555,400	6,092,738.00	0.23
121	601700	风范股份	1,383,812	6,033,420.32	0.22
122	601069	西部黄金	272,200	5,988,400.00	0.22
123	601021	春秋航空	131,300	5,984,654.00	0.22
124	601766	中国中车	1,143,005	5,943,626.00	0.22
125	600522	中天科技	97,492	5,915,814.56	0.22
126	603185	弘元绿能	354,000	5,908,260.00	0.22
127	600115	中国东航	1,534,900	5,847,969.00	0.22
128	603619	中曼石油	311,500	5,828,165.00	0.22
129	603588	高能环境	299,800	5,756,160.00	0.21
130	600298	安琪酵母	157,908	5,716,269.60	0.21
131	688052	纳芯微	19,793	5,706,519.83	0.21
132	688020	方邦股份	22,329	5,573,318.40	0.21
133	601898	中煤能源	457,389	5,570,998.02	0.21
134	600380	健康元	588,165	5,540,514.30	0.21
135	600410	华胜天成	347,000	5,493,010.00	0.20
136	688553	汇宇制药	515,729	5,482,199.27	0.20
137	600773	西藏城投	425,800	5,480,046.00	0.20
138	601995	中金公司	151,500	5,476,725.00	0.20
139	603507	振江股份	165,100	5,430,139.00	0.20
140	688799	华纳药厂	120,302	5,397,950.74	0.20
141	600299	安迪苏	679,656	5,335,299.60	0.20
142	601226	华电科工	836,400	5,319,504.00	0.20
143	605299	舒华体育	397,700	5,309,295.00	0.20
144	600208	衢州发展	1,856,600	5,254,178.00	0.20
145	603162	海通发展	580,399	5,206,179.03	0.19
146	601677	明泰铝业	313,200	5,199,120.00	0.19
147	603893	瑞芯微	27,500	5,179,900.00	0.19
148	600803	新奥股份	322,733	5,099,181.40	0.19
149	600641	先导基电	127,500	5,082,150.00	0.19
150	688266	泽璟制药	43,321	5,053,827.86	0.19
151	688081	兴图新科	122,841	5,021,740.08	0.19
152	601006	大秦铁路	1,080,440	4,980,828.40	0.18
153	688309	恒誉环保	81,713	4,974,687.44	0.18
154	600029	南方航空	954,389	4,943,735.02	0.18
155	600271	航天信息	750,700	4,939,606.00	0.18
156	600606	绿地控股	4,080,500	4,937,405.00	0.18
157	605111	新洁能	49,600	4,917,344.00	0.18
158	600066	宇通客车	180,300	4,833,843.00	0.18

159	600403	大有能源	910,498	4,816,534.42	0.18
160	688025	杰普特	10,200	4,794,000.00	0.18
161	688235	百济神州	18,800	4,786,668.00	0.18
162	600227	赤天化	1,939,000	4,731,160.00	0.18
163	603920	世运电路	97,500	4,683,900.00	0.17
164	605222	起帆电缆	200,600	4,677,992.00	0.17
165	600683	京投发展	404,300	4,649,450.00	0.17
166	601939	建设银行	482,740	4,648,786.20	0.17
167	688150	莱特光电	67,700	4,645,574.00	0.17
168	688702	盛科通信	11,869	4,628,791.31	0.17
169	601998	中信银行	661,793	4,586,225.49	0.17
170	600418	江淮汽车	176,600	4,561,578.00	0.17
171	600103	青山纸业	1,468,800	4,509,216.00	0.17
172	688072	拓荆科技	5,400	4,492,800.00	0.17
173	600501	航天晨光	281,500	4,427,995.00	0.16
174	600590	泰豪科技	437,200	4,415,720.00	0.16
175	605289	罗曼股份	30,420	4,410,900.00	0.16
176	603990	麦迪科技	206,600	4,398,514.00	0.16
177	600230	沧州大化	336,900	4,386,438.00	0.16
178	600026	中远海能	240,600	4,316,364.00	0.16
179	603806	福斯特	256,200	4,301,598.00	0.16
180	688766	普冉股份	5,500	4,216,300.00	0.16
181	688252	天德钰	173,080	4,153,920.00	0.15
182	688238	和元生物	765,634	4,149,736.28	0.15
183	601868	中国能建	1,552,000	4,143,840.00	0.15
184	603393	新天然气	193,500	4,142,835.00	0.15
185	600703	三安光电	194,160	4,120,075.20	0.15
186	600577	精达股份	420,034	4,107,932.52	0.15
187	688173	希荻微	212,041	4,058,464.74	0.15
188	688580	伟思医疗	75,135	4,002,441.45	0.15
189	605196	华通线缆	153,300	4,001,130.00	0.15
190	601838	成都银行	225,572	3,992,624.40	0.15
191	603095	越剑智能	277,632	3,975,690.24	0.15
192	688568	中科星图	95,646	3,966,439.62	0.15
193	600158	中体产业	583,400	3,932,116.00	0.15
194	600490	鹏欣资源	662,800	3,857,496.00	0.14
195	600352	浙江龙盛	314,900	3,813,439.00	0.14
196	601665	齐鲁银行	658,456	3,799,291.12	0.14
197	688233	神工股份	17,600	3,773,792.00	0.14
198	605488	福莱新材	131,600	3,732,176.00	0.14
199	600048	保利发展	797,426	3,692,082.38	0.14
200	601208	东材科技	51,900	3,674,001.00	0.14
201	688717	艾罗能源	44,400	3,666,108.00	0.14
202	600010	宝钢股份	1,642,900	3,663,667.00	0.14

203	688409	富创精密	11,900	3,644,375.00	0.14
204	601228	广州港	1,290,801	3,640,058.82	0.14
205	600332	白云山	181,200	3,631,248.00	0.13
206	600666	奥瑞德	905,300	3,594,041.00	0.13
207	688069	德林海	95,726	3,576,323.36	0.13
208	601877	正泰电器	142,034	3,560,792.38	0.13
209	688428	诺诚健华	123,132	3,505,568.04	0.13
210	600233	圆通速递	221,600	3,490,200.00	0.13
211	688313	仕佳光子	18,800	3,471,420.00	0.13
212	688218	江苏北人	63,000	3,462,480.00	0.13
213	688107	安路科技	75,300	3,433,680.00	0.13
214	688385	复旦微电	48,122	3,430,617.38	0.13
215	600530	交大昂立	689,800	3,400,714.00	0.13
216	600728	佳都科技	791,700	3,372,642.00	0.13
217	600663	陆家嘴	537,011	3,372,429.08	0.13
218	600961	株冶集团	103,600	3,355,604.00	0.12
219	688516	奥特维	58,068	3,332,522.52	0.12
220	600863	华能蒙电	706,600	3,321,020.00	0.12
221	601616	广电电气	970,200	3,308,382.00	0.12
222	688277	天智航	191,955	3,282,430.50	0.12
223	601619	嘉泽新能	745,000	3,203,500.00	0.12
224	605016	百龙创园	123,900	3,202,815.00	0.12
225	688180	君实生物	94,306	3,189,428.92	0.12
226	600714	金瑞矿业	154,800	3,178,044.00	0.12
227	600482	中国动力	96,700	3,171,760.00	0.12
228	603826	坤彩科技	124,000	3,169,440.00	0.12
229	600096	云天化	104,200	3,167,680.00	0.12
230	688023	安恒信息	85,061	3,123,439.92	0.12
231	600039	四川路桥	397,877	3,111,398.14	0.12
232	600166	福田汽车	1,059,700	3,083,727.00	0.11
233	688375	国博电子	29,474	3,074,138.20	0.11
234	600905	三峡能源	810,243	3,006,001.53	0.11
235	600201	生物股份	257,300	2,997,545.00	0.11
236	605056	咸亨国际	187,300	2,996,800.00	0.11
237	601231	环旭电子	91,600	2,967,840.00	0.11
238	600348	华阳股份	387,350	2,963,227.50	0.11
239	601399	国机重装	845,200	2,958,200.00	0.11
240	688503	聚和材料	22,200	2,945,940.00	0.11
241	600343	航天动力	104,500	2,928,090.00	0.11
242	688348	昱能科技	83,933	2,919,189.74	0.11
243	600688	上海石化	984,925	2,885,830.25	0.11
244	600691	潞化科技	1,305,700	2,885,597.00	0.11
245	688556	高测股份	215,606	2,863,247.68	0.11
246	600000	浦发银行	330,284	2,843,745.24	0.11

247	688027	国盾量子	5,600	2,822,456.00	0.10
248	600901	江苏金租	489,567	2,815,010.25	0.10
249	601000	唐山港	673,913	2,796,738.95	0.10
250	688472	阿特斯	258,278	2,794,567.96	0.10
251	600871	石化油服	1,366,800	2,774,604.00	0.10
252	603686	福龙马	214,100	2,766,172.00	0.10
253	603308	应流股份	45,364	2,739,985.60	0.10
254	688125	安达智能	16,600	2,714,100.00	0.10
255	601106	中国一重	821,600	2,711,280.00	0.10
256	601688	华泰证券	129,900	2,678,538.00	0.10
257	603083	剑桥科技	10,500	2,676,135.00	0.10
258	600333	长春燃气	529,800	2,659,596.00	0.10
259	601020	华钰矿业	110,700	2,655,693.00	0.10
260	688275	万润新能	20,700	2,640,285.00	0.10
261	600216	浙江医药	230,800	2,631,120.00	0.10
262	600188	兖矿能源	146,221	2,598,347.17	0.10
263	600801	华新建材	166,400	2,595,840.00	0.10
264	605117	德业股份	24,400	2,590,792.00	0.10
265	688677	海泰新光	25,200	2,548,476.00	0.09
266	601698	中国卫通	83,400	2,522,850.00	0.09
267	600637	东方明珠	303,000	2,517,930.00	0.09
268	600566	济川药业	113,300	2,514,127.00	0.09
269	600795	国电电力	537,908	2,512,030.36	0.09
270	600499	科达制造	181,500	2,504,700.00	0.09
271	688652	京仪装备	12,500	2,502,125.00	0.09
272	601117	中国化学	340,000	2,499,000.00	0.09
273	603396	金辰股份	94,200	2,496,300.00	0.09
274	603171	税友股份	62,400	2,486,640.00	0.09
275	600838	上海九百	347,400	2,483,910.00	0.09
276	600176	中国巨石	33,900	2,470,632.00	0.09
277	688311	盟升电子	93,880	2,458,717.20	0.09
278	600113	浙江东日	70,700	2,345,826.00	0.09
279	603122	合富中国	213,300	2,337,768.00	0.09
280	688082	盛美上海	5,400	2,332,800.00	0.09
281	603305	旭升集团	191,000	2,314,920.00	0.09
282	688347	华虹宏力	6,800	2,286,840.00	0.08
283	688202	美迪西	28,244	2,279,573.24	0.08
284	603290	斯达半导	14,900	2,278,806.00	0.08
285	603612	索通发展	124,800	2,262,624.00	0.08
286	688667	菱电电控	16,800	2,245,320.00	0.08
287	688182	灿勤科技	52,095	2,243,731.65	0.08
288	688127	蓝特光学	22,900	2,235,040.00	0.08
289	688620	安凯微	137,686	2,230,513.20	0.08
290	601615	明阳智能	191,000	2,209,870.00	0.08

291	603186	华正新材	9,800	2,207,940.00	0.08
292	601555	东吴证券	278,600	2,206,512.00	0.08
293	600664	哈药股份	736,367	2,201,737.33	0.08
294	600330	天通股份	70,600	2,177,304.00	0.08
295	600617	国新能源	799,881	2,143,681.08	0.08
296	601618	中国中冶	877,200	2,140,368.00	0.08
297	603897	长城科技	64,900	2,106,654.00	0.08
298	601336	新华保险	35,300	2,105,998.00	0.08
299	600143	金发科技	136,000	2,101,200.00	0.08
300	603216	梦天家居	102,000	2,098,140.00	0.08
301	600513	联环药业	144,300	2,098,122.00	0.08
302	603297	永新光学	14,200	2,086,690.00	0.08
303	605060	联德股份	36,400	2,065,336.00	0.08
304	601919	中远海控	154,520	2,048,935.20	0.08
305	601126	四方股份	32,400	2,047,680.00	0.08
306	688262	国芯科技	46,900	2,027,487.00	0.08
307	603288	海天味业	60,999	2,022,726.84	0.08
308	603016	新宏泰	59,800	2,018,848.00	0.07
309	603608	天创时尚	87,900	2,006,757.00	0.07
310	688249	晶合集成	33,860	1,998,755.80	0.07
311	688418	震有科技	41,530	1,996,762.40	0.07
312	600266	城建发展	509,640	1,992,692.40	0.07
313	600415	小商品城	193,483	1,965,787.28	0.07
314	688253	英诺特	32,600	1,965,128.00	0.07
315	688582	芯动联科	30,100	1,956,500.00	0.07
316	600699	均胜电子	90,500	1,955,705.00	0.07
317	688779	五矿新能	239,200	1,939,912.00	0.07
318	688607	康众医疗	37,400	1,907,400.00	0.07
319	601311	骆驼股份	244,600	1,905,434.00	0.07
320	600556	天下秀	429,400	1,897,948.00	0.07
321	603150	万朗磁塑	26,700	1,890,360.00	0.07
322	603626	科森科技	102,000	1,887,000.00	0.07
323	600329	达仁堂	50,600	1,883,332.00	0.07
324	605499	东鹏饮料	15,134	1,867,989.62	0.07
325	688630	芯碁微装	3,400	1,867,926.00	0.07
326	600594	益佰制药	626,531	1,860,797.07	0.07
327	601869	长飞光纤	3,400	1,856,060.00	0.07
328	603306	华懋科技	17,900	1,856,051.00	0.07
329	600580	卧龙电驱	55,900	1,850,290.00	0.07
330	601800	中国交建	319,622	1,825,041.62	0.07
331	600600	青岛啤酒	34,942	1,825,020.66	0.07
332	601916	浙商银行	683,800	1,798,394.00	0.07
333	688709	成都华微	47,200	1,797,848.00	0.07
334	600623	华谊集团	222,100	1,792,347.00	0.07

335	600438	通威股份	147,900	1,791,069.00	0.07
336	688658	悦康药业	139,258	1,790,857.88	0.07
337	601689	拓普集团	31,700	1,788,514.00	0.07
338	688213	思特威	16,700	1,788,069.00	0.07
339	600785	新华百货	181,980	1,783,404.00	0.07
340	605169	洪通燃气	196,600	1,747,774.00	0.06
341	601360	三六零	200,300	1,740,607.00	0.06
342	688200	华峰测控	3,300	1,732,830.00	0.06
343	600760	中航沈飞	41,780	1,717,158.00	0.06
344	601727	上海电气	244,600	1,712,200.00	0.06
345	600515	海南机场	623,800	1,709,212.00	0.06
346	600844	金煤科技	693,200	1,677,544.00	0.06
347	688575	亚辉龙	189,312	1,658,373.12	0.06
348	688499	利元亨	31,500	1,655,325.00	0.06
349	603583	捷昌驱动	72,369	1,650,013.20	0.06
350	601865	福莱特	155,879	1,638,288.29	0.06
351	688360	德马科技	91,500	1,637,850.00	0.06
352	600398	海澜之家	303,279	1,586,149.17	0.06
353	600104	上汽集团	161,600	1,577,216.00	0.06
354	601969	海南矿业	197,875	1,565,191.25	0.06
355	603699	纽威股份	31,000	1,559,300.00	0.06
356	605365	立达信	106,400	1,530,032.00	0.06
357	600668	尖峰集团	209,501	1,527,262.29	0.06
358	688593	新相微	39,100	1,521,772.00	0.06
359	600808	马钢股份	600,500	1,501,250.00	0.06
360	605318	法狮龙	13,300	1,501,038.00	0.06
361	688618	三旺通信	47,893	1,473,667.61	0.05
362	600089	特变电工	64,800	1,458,000.00	0.05
363	600791	京能置业	165,700	1,448,218.00	0.05
364	688166	博瑞医药	41,200	1,442,412.00	0.05
365	688279	峰昭科技	6,400	1,436,416.00	0.05
366	601100	恒立液压	13,200	1,419,792.00	0.05
367	600109	国金证券	161,500	1,417,970.00	0.05
368	605333	沪光股份	82,700	1,410,035.00	0.05
369	603052	可川科技	16,700	1,352,533.00	0.05
370	600448	华纺股份	534,800	1,347,696.00	0.05
371	600206	有研新材	20,100	1,338,660.00	0.05
372	688390	固德威	12,290	1,333,587.90	0.05
373	688196	卓越新能	36,200	1,299,580.00	0.05
374	600733	北汽蓝谷	261,100	1,271,557.00	0.05
375	605068	明新旭腾	75,700	1,270,246.00	0.05
376	688488	艾迪药业	95,819	1,231,274.15	0.05
377	600234	科新发展	43,200	1,195,776.00	0.04
378	600775	南京熊猫	124,700	1,192,132.00	0.04

379	603013	亚普股份	75,479	1,191,813.41	0.04
380	688486	龙迅股份	18,699	1,188,882.42	0.04
381	600816	建元信托	480,600	1,172,664.00	0.04
382	600125	铁龙物流	230,400	1,168,128.00	0.04
383	688339	亿华通	61,484	1,149,750.80	0.04
384	603991	领先股份	8,100	1,143,315.00	0.04
385	688513	苑东生物	25,900	1,138,564.00	0.04
386	688146	中船特气	3,200	1,119,968.00	0.04
387	600645	中源协和	64,200	1,098,462.00	0.04
388	600828	茂业商业	303,400	1,086,172.00	0.04
389	600821	金开新能	173,100	1,081,875.00	0.04
390	600118	中国卫星	13,000	1,066,650.00	0.04
391	600483	福能股份	104,300	1,062,817.00	0.04
392	600841	动力新科	169,900	1,036,390.00	0.04
393	600877	电科芯片	59,100	1,012,383.00	0.04
394	688655	迅捷兴	18,800	1,006,928.00	0.04
395	688679	通源环境	23,900	1,005,951.00	0.04
396	600460	士兰微	18,300	1,000,278.00	0.04
397	600916	中国黄金	144,600	989,064.00	0.04
398	603296	华勤技术	12,500	928,375.00	0.03
399	603301	振德医疗	10,600	923,896.00	0.03
400	688408	中信博	28,100	903,415.00	0.03
401	601186	中国铁建	149,442	889,179.90	0.03
402	603390	通达电气	84,700	884,268.00	0.03
403	601567	三星电气	59,100	882,954.00	0.03
404	688383	新益昌	4,600	864,984.00	0.03
405	600882	妙可蓝多	52,700	842,673.00	0.03
406	600879	航天电子	39,200	834,568.00	0.03
407	688668	鼎通科技	2,100	783,930.00	0.03
408	601238	广汽集团	152,500	774,700.00	0.03
409	600770	综艺股份	110,300	772,100.00	0.03
410	600736	苏州高新	113,600	759,984.00	0.03
411	688223	晶科能源	159,615	758,171.25	0.03
412	601330	绿色动力	108,300	754,851.00	0.03
413	601866	中远海发	331,000	731,510.00	0.03
414	600754	锦江酒店	40,400	726,796.00	0.03
415	688531	日联科技	4,000	711,360.00	0.03
416	605319	无锡振华	31,300	710,197.00	0.03
417	603867	新化股份	20,800	696,592.00	0.03
418	688028	沃尔德	4,453	694,089.11	0.03
419	688776	国光电气	11,000	674,740.00	0.03
420	600468	百利电气	109,100	662,237.00	0.02
421	600108	亚盛集团	218,100	645,576.00	0.02
422	688425	铁建重工	159,487	641,137.74	0.02

423	688307	中润光学	8,000	639,600.00	0.02
424	688778	厦钨新能	11,509	626,089.60	0.02
425	605007	五洲特纸	45,100	603,889.00	0.02
426	688515	裕太微	2,402	597,521.52	0.02
427	600353	旭光电子	12,200	556,320.00	0.02
428	600022	山东钢铁	430,200	533,448.00	0.02
429	603178	圣龙股份	38,400	531,840.00	0.02
430	688037	芯源微	1,200	526,860.00	0.02
431	600827	百联股份	71,100	526,851.00	0.02
432	603966	法兰泰克	64,500	525,675.00	0.02
433	603421	鼎信通讯	85,100	523,365.00	0.02
434	603980	吉华集团	77,600	515,264.00	0.02
435	605188	国光连锁	43,900	513,191.00	0.02
436	603738	泰晶科技	8,200	492,410.00	0.02
437	603088	宁波精达	46,400	466,784.00	0.02
438	600981	苏豪汇鸿	204,400	459,900.00	0.02
439	600868	梅雁吉祥	167,700	441,051.00	0.02
440	600713	南京医药	87,900	439,500.00	0.02
441	600367	红星发展	6,700	421,631.00	0.02
442	603031	安孚科技	7,800	415,350.00	0.02
443	600748	上实发展	107,400	399,528.00	0.01
444	605287	德才股份	9,300	385,857.00	0.01
445	603331	百达精工	34,700	369,902.00	0.01
446	688387	信科移动	18,600	369,024.00	0.01
447	600724	宁波富达	71,500	362,505.00	0.01
448	600635	大众公用	82,600	353,528.00	0.01
449	603999	读者传媒	70,600	353,000.00	0.01
450	601633	长城汽车	23,263	351,038.67	0.01
451	600316	洪都航空	12,500	349,250.00	0.01
452	603139	康惠股份	8,200	345,302.00	0.01
453	600152	维科技术	34,500	344,655.00	0.01
454	600651	飞乐音响	61,500	343,785.00	0.01
455	688561	奇安信	14,200	340,516.00	0.01
456	600428	中远海特	42,600	332,706.00	0.01
457	603906	龙蟠科技	12,500	331,625.00	0.01
458	601599	浙文影业	117,100	326,709.00	0.01
459	601068	中铝国际	74,900	323,568.00	0.01
460	603127	昭衍新药	8,100	309,582.00	0.01
461	600156	华升股份	35,900	298,688.00	0.01
462	601298	青岛港	34,984	281,621.20	0.01
463	603759	海天股份	40,400	277,952.00	0.01
464	688231	隆达股份	7,410	272,169.30	0.01
465	603138	海量数据	19,100	268,355.00	0.01
466	600743	华远控股	119,100	257,256.00	0.01

467	603596	伯特利	10,000	248,400.00	0.01
468	603997	继峰股份	20,800	246,064.00	0.01
469	600643	爱建集团	62,570	232,134.70	0.01
470	688215	瑞晟智能	5,500	220,880.00	0.01
471	600676	交运股份	33,800	219,362.00	0.01
472	603816	顾家家居	9,100	203,476.00	0.01
473	605167	利柏特	12,500	201,250.00	0.01
474	600531	豫光金铅	12,800	188,928.00	0.01
475	603766	隆鑫通用	15,400	183,722.00	0.01
476	688615	合合信息	1,600	180,960.00	0.01
477	603777	来伊份	11,600	180,148.00	0.01
478	688543	国科军工	4,440	175,158.00	0.01
479	603803	瑞斯康达	13,600	159,664.00	0.01
480	600586	金晶科技	34,201	156,298.57	0.01
481	601669	中国电建	33,100	155,570.00	0.01
482	688170	德龙激光	1,400	134,414.00	0.00
483	688548	广钢气体	2,500	130,250.00	0.00
484	600408	安泰集团	54,200	128,996.00	0.00
485	603098	森特股份	11,000	116,050.00	0.00
486	600268	国电南自	9,900	115,038.00	0.00
487	600629	华建集团	9,300	112,623.00	0.00
488	600573	惠泉啤酒	12,500	111,250.00	0.00
489	688660	电气风电	9,400	81,028.00	0.00
490	600409	三友化工	12,600	76,986.00	0.00
491	600162	香江控股	26,900	75,320.00	0.00
492	688480	赛恩斯	800	70,072.00	0.00
493	603773	沃格光电	400	65,188.00	0.00
494	603005	晶方科技	800	43,096.00	0.00
495	688158	优刻得	900	33,084.00	0.00
496	603501	豪威集团	100	9,485.00	0.00
497	603336	宏辉果蔬	900	7,128.00	0.00
498	600958	东方证券	200	1,888.00	0.00
499	603042	华脉科技	130	1,872.00	0.00
500	600873	梅花生物	200	1,470.00	0.00

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	688795	摩尔线程	7,629	5,164,375.26	0.19
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.11
3	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.09

4	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.03
5	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
7	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
8	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
9	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
10	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
11	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
12	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
13	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
14	603284	林平发展	46	1,604.02	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	600938	中国海油	18,512,040.26	0.91
2	603986	兆易创新	18,069,131.00	0.89
3	601600	中国铝业	14,555,090.00	0.72
4	601088	中国神华	14,168,547.10	0.70
5	601888	中国中免	13,978,665.50	0.69
6	600519	贵州茅台	13,667,269.00	0.67
7	688498	源杰科技	13,281,749.08	0.65
8	600489	中金黄金	13,164,731.00	0.65
9	603538	美诺华	12,356,328.00	0.61
10	600690	海尔智家	12,069,079.00	0.59
11	688981	中芯国际	11,931,197.51	0.59
12	601127	赛力斯	11,785,343.00	0.58
13	601778	晶科科技	11,589,763.00	0.57
14	688141	杰华特	11,341,406.72	0.56
15	600183	生益科技	10,909,274.00	0.54
16	688313	仕佳光子	10,401,477.37	0.51
17	600809	山西汾酒	10,336,188.00	0.51
18	688052	纳芯微	10,312,082.34	0.51
19	601872	招商轮船	10,280,428.00	0.51
20	688256	寒武纪	10,230,153.17	0.50

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	688025	杰普特	26,113,100.43	1.28
2	600584	长电科技	17,707,010.00	0.87
3	688702	盛科通信	15,556,373.73	0.76
4	600487	亨通光电	15,465,994.00	0.76
5	600498	烽火通信	14,961,452.48	0.74
6	603538	美诺华	14,692,827.64	0.72
7	600183	生益科技	14,413,852.00	0.71
8	600958	东方证券	13,895,198.00	0.68
9	688261	东微半导	12,994,723.53	0.64
10	688548	广钢气体	12,968,951.29	0.64
11	603738	泰晶科技	12,953,254.96	0.64
12	688347	华虹宏力	12,641,411.16	0.62
13	601898	中煤能源	12,635,949.46	0.62
14	600268	国电南自	12,632,010.35	0.62
15	688361	中科飞测	12,323,032.46	0.61
16	603308	应流股份	11,437,918.00	0.56
17	688981	中芯国际	11,100,556.74	0.55
18	603019	中科曙光	11,014,228.00	0.54
19	688141	杰华特	10,804,262.42	0.53
20	688332	中科蓝讯	10,751,634.78	0.53

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	1,617,238,074.09
卖出股票的收入（成交）总额	1,411,141,866.70

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，中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行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约定备选股票库之外的情况。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	131,641.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,641.49

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

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	601088	中国神华	11,218,083.93	0.42	增发中签

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	688795	摩尔线程	5,164,375.26	0.19	新股锁定
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.11	新股锁定
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.09	新股锁定
4	688765	禾元生物	799,783.20	0.03	新股锁定
5	688820	盛合晶微	338,302.59	0.01	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		上证 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
31,566	64,705.81	744,153,709.00	36.43%	997,308,855.00	48.83%	301,041,101.00	14.74%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	1,580,503,665.00
本报告期基金总申购份额	3,732,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,270,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,042,503,665.00

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：

2026 年 5 月 9 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经

本基金管理人第八届董事会第四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

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、基金财产相关的诉讼事项。

报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	5	3,014,306,914.37	100.00%	449,469.40	100.00%	-

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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比 例	成交金额	占当期回购成交总额的比 例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

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关于旗下部分上交所ETF变更扩位证券简称的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-01-30
2	关于国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金调整基金份额参考净值（IOPV）计算机构的公告	《中国证券报》	2026-02-06
3	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
4	国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行 A 股的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-04-11
5	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2026-05-09

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

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

基金托管人住所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日