

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	15
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	39
7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	39
7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	72
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	72
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	74
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	74
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	74
7.11 投资组合报告附注	74

8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 盈利投资者数量占比	75
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
9 开放式基金份额变动	76
10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	76
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	77
10.8 其他重大事件	80
11 影响投资者决策的其他重要信息	83
12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	国泰标普 500ETF
场内简称	标普 500ETF 国泰
基金主代码	159612
交易代码	159612
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 9 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	444,898,651.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 5 月 20 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、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、境外市场基金投资策略。
业绩比较基准	标普 500 指数收益率（经估值汇率调整）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	张姗
	联系电话	021-31081600转	400-61-95555
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	400-61-95555
传真		021-31081800	0755-83195201

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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200082	518040
法定代表人	周向勇	缪建民

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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

2.6 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	5,584,922.35
本期利润	49,801,345.05
加权平均基金份额本期利润	0.1119
本期加权平均净值利润率	6.21%
本期基金份额净值增长率	6.27%
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	65,130,501.18
期末可供分配基金份额利润	0.1464

期末基金资产净值	843,658,584.70
期末基金份额净值	1.8963
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	89.63%

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	13.24%	0.88%	13.07%	0.88%	0.17%	0.00%
过去六个月	6.27%	0.92%	6.16%	0.92%	0.11%	0.00%
过去一年	15.07%	0.81%	14.99%	0.81%	0.08%	0.00%
过去三年	57.59%	0.96%	58.83%	0.95%	-1.24%	0.01%
自基金合同生效起至今	89.63%	1.05%	86.75%	1.08%	2.88%	-0.03%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
 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
 (2022 年 5 月 9 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日为 2022 年 5 月 9 日，在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）同期业绩比较基准以人民币计价。

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		
艾小军	国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、芯片 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接、国泰中证全指证券公司 ETF 联接、国泰纳斯达克 100（QDII-ETF）、国泰标普 500ETF、国泰中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监	2023-05-23	-	25 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资

				资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月至 2023 年 9 月任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基
--	--	--	--	--

					金变更注册而来）的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）的基金经理，2019 年 7 月至 2021 年 1 月任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2020 年 12 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）的基金经理，2021 年 5 月起兼任国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理，2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程
--	--	--	--	--	---

					总监。
--	--	--	--	--	-----

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

2、证券从业的含义遵从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 年第一季度，在美国居民部门消费支出的稳健、上市企业盈利预期的边际修复以及联邦政

府财政政策的隐性托底共同支撑下，美国国内经济增长继续呈现出一定的韧性。然而，持续发酵的地缘政治冲突成为了影响一季度、尤其是 3 月份全球市场走势的重要外部因素，美伊冲突由区域性冲突向长期化趋势演进，霍尔木兹海峡的实质性封锁导致全球关键航运通道面临不确定性，相关摩擦成本顺着产业链向下游传导，加息预期升温。

2026 年第二季度，地缘政治冲突趋势上走向缓和，但进程中反复博弈，霍尔木兹海峡的封锁也持续扰动全球宏观。此外，尽管市场对美联储的降息预期变动，但是 AI 产业持续的加速，为美国的科技产业带来强势的成长。宏观方面，5 月份居民消费和劳动市场展露出修复信号，折射出美国内生增长引擎的稳健。货币政策端，沃什正式接任美联储主席，议息会议“首秀”中释放鹰派信号，市场加息预期快速升温。

在上述复杂的宏观背景下，美股科技总体上表现强势。2026 年上半年，标普 500 上涨 9.55%；纳斯达克 100 指数上涨 19.91%，而代表美股 AI 算力的费城半导体指数大涨 101.14%。

作为被动指数基金的基金经理，我们的工作重点在于紧密跟踪标的指数，力求实现与指数表现相匹配的投资回报。在 2026 年上半年，我们的基金严格按照既定的投资策略，依据标的指数的成分股及其权重构建投资组合，以最小化跟踪误差。

在实际操作中，我们对指数的成分股变化保持密切关注，及时进行相应的调整，确保基金持仓与指数成分的一致性。同时，利用量化分析和风险评估模型，对投资组合进行动态监控，以控制跟踪误差在合理范围内。尽管面临市场的大幅波动和成分股的调整，基金整体较好地实现了对标的指数的跟踪，在多数时间段内，净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年跟踪误差均控制在较低水平。

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 6.27%，同期业绩比较基准收益率为 6.16%。

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，通用人工智能技术的持续演进依然是引领全球科技创新与资本市场长周期繁荣的核心主线。进入 2026 年下半年，人工智能产业正处于从前期的“底层算力基础设施大规模建设期”向“应用生态繁荣与商业化落地期”跨越的关键历史节点。由技术驱动的效率提升，不仅能够增厚相关科技企业的自由现金流，更能在宏观层面对抗通胀带来的成本上升压力，成为支撑美股长期向上的核心动力引擎。

科技产业的繁荣并非孤立存在，其发展必然伴随着对物理资源与传统基础设施的大量消耗与衍生需求。在全球算力需求呈现指数级增长的背景下，数据中心的耗电量激增，使得全球电力基础设

施的承载能力面临严峻考验。电网的升级改造需求、新型冷却技术瓶颈以及铜、铝等关键基础金属的供需缺口，正日益成为制约算力扩张的现实物理边界。传统公用事业、高端电气设备制造与特定资源开采行业，有望在科技周期的衍生需求驱动下迎来新一轮的资产价值重估与盈利增长长期。

展望后市，AI 主导的生产力变革推动的长周期繁荣仍值得期待，但宏观地缘政治、全球供应链重塑、产业端商业化落地进程的不确定性均可能进一步放大波动。综合而言，ETF 可以实现对优质资产的均衡配置，个股涨跌可实现资产组合中权重的自我平衡，可更好代表美股整体的潜能。在种种不确定下，指数基金具备一定投资价值，我们将一如既往的控制跟踪误差，为投资者带来深度赋能。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	43,745,963.27	12,940,339.72
结算备付金		31,411,726.21	27,674,514.64
存出保证金		6,980,092.29	6,448,694.30
交易性金融资产	6.4.7.2	761,935,642.28	717,162,678.30
其中：股票投资		761,935,642.28	717,162,678.30
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	-	30,007,621.96
应收清算款		44,132.45	6,642.22
应收股利		309,243.06	328,782.48
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		844,426,799.56	794,569,273.62
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		413,475.18	407,178.37
应付托管费		103,368.79	101,794.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		173,019.61	48,061.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	78,351.28	155,000.00
负债合计		768,214.86	712,033.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	444,898,651.00	444,898,651.00
未分配利润	6.4.7.8	398,759,933.70	348,958,588.65
净资产合计		843,658,584.70	793,857,239.65
负债和净资产总计		844,426,799.56	794,569,273.62

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8963 元，基金份额总额 444,898,651.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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		52,877,983.65	28,629,719.99
1.利息收入		250,774.20	183,492.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	138,250.92	100,541.90
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		112,523.28	82,950.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,040,192.49	2,328,460.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	846,217.63	544,754.32

基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	5,150,975.77	-1,124,078.75
股利收益	6.4.7.14	4,042,999.09	2,907,784.72
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	44,216,422.70	26,110,508.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,638,066.51	-841,223.39
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,660.77	848,482.30
减：二、营业总支出		3,076,638.60	2,048,545.83
1. 管理人报酬		2,383,307.52	1,571,530.24
2. 托管费		595,826.90	392,882.54
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		18,942.90	298.64
8. 其他费用	6.4.7.17	78,561.28	83,834.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,801,345.05	26,581,174.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,801,345.05	26,581,174.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		49,801,345.05	26,581,174.16

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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	444,898,651.00	348,958,588.65	793,857,239.65
二、本期期初净资产	444,898,651.00	348,958,588.65	793,857,239.65
三、本期增减变	-	49,801,345.05	49,801,345.05

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	49,801,345.05	49,801,345.05
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	444,898,651.00	398,759,933.70	843,658,584.70
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	313,898,651.00	178,532,622.29	492,431,273.29
二、本期期初净资产	313,898,651.00	178,532,622.29	492,431,273.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	37,000,000.00	48,867,021.02	85,867,021.02
（一）、综合收益总额	-	26,581,174.16	26,581,174.16
（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）	37,000,000.00	22,285,846.86	59,285,846.86
其中：1.基金申购款	37,000,000.00	22,285,846.86	59,285,846.86
2.基金赎回款	-	-	-
（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	350,898,651.00	227,399,643.31	578,298,294.31

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

国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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]3692 号《关于准予国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》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《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式，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 247,885,000.00 元，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(2022)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2022 年 5 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 247,898,651.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 13,651.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]476 号文审批同意，本基金于 2022 年 5 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括交易型开放式基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、

商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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的相关规定。本基金可以进行境外证券借贷交易及境外正回购交易、逆回购交易。境内市场投资工具包括银行存款、债券回购、货币市场工具(含同业存单)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。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：标普 500 指数收益率(经估值汇率调整)。本基金的标的指数为标普 500 指数。

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，募集成立了国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）(以下简称“国泰标普 500ETF 发起联接（QDII）”)。国泰标普 500ETF 发起联接（QDII）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 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 上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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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]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[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) 目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b) 目前本基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(c) 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。

(d) 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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。

(f) 对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	43,745,963.27
等于：本金	43,742,466.43
加：应计利息	3,496.84
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	43,745,963.27

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		556,473,479.53	-	761,935,642.28	205,462,162.75
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		556,473,479.53	-	761,935,642.28	205,462,162.75

注：股票包括普通股、存托凭证、优先股和房地产信托凭证等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	79,149,338.17	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	79,149,338.17	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ES2609	S&P500 EMINI Sep26	31.00	79,686,082.68	536,744.51
合计	-	-	-	536,744.51
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	536,744.51
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	78,351.28
合计	78,351.28

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	444,898,651.00	444,898,651.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	444,898,651.00	444,898,651.00

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	59,545,578.83	289,413,009.82	348,958,588.65
本期期初	59,545,578.83	289,413,009.82	348,958,588.65
本期利润	5,584,922.35	44,216,422.70	49,801,345.05
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,130,501.18	333,629,432.52	398,759,933.70

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	68,752.29
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	69,498.63
其他	-
合计	138,250.92

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,789,748.55

减：卖出股票成本总额	8,940,859.63
减：交易费用	2,671.29
买卖股票差价收入	846,217.63

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	5,150,975.77

6.4.7.14 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	4,042,999.09
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	4,042,999.09

6.4.7.15 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	43,498,467.93
——股票投资	43,498,467.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	717,954.77
——权证投资	-
——股指期货	717,954.77

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	44,216,422.70

6.4.7.16 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	-
其他	8,660.77
合计	8,660.77

6.4.7.17 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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	210.00
合计	78,561.28

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
国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）（“国泰标普 500ETF 发起联接（QDII）”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
国泰基金管理有限公司	基金管理人

香港上海汇丰银行有限公司（The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited，“汇丰银行”）	境外资产托管人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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	2,383,307.52	1,571,530.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	157,186.09	77,311.91
应支付基金管理人的净管理费	2,226,121.43	1,494,218.33

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

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	595,826.90	392,882.54

注：支付基金托管人的托管费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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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
国泰标普 500ETF 发起联接（QDII）	96,177,736.00	21.62%	129,165,248.00	29.03%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	33,667,408.06	35,070.70	5,439,345.84	28,845.52
汇丰银行	10,078,555.21	33,681.59	24,047,925.86	42,707.47

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，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招商银行及境外资产托管人汇丰银行，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通过有资格的经纪商进行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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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。

本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，投资于一只境外基金的比例不超过基金资产净值的 20%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一只境外基金不得超过该基金总份额的 20%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金

与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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资产净值的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、买入返售金融资产、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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2026 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	43,745,963.27	-	-	-	43,745,963.27
结算备付金	31,411,726.21	-	-	-	31,411,726.21
存出保证金	-	-	-	6,980,092.29	6,980,092.29
交易性金融资产	-	-	-	761,935,642.28	761,935,642.28
应收清算款	-	-	-	44,132.45	44,132.45
应收股利	-	-	-	309,243.06	309,243.06
资产总计	75,157,689.48	-	-	769,269,110.08	844,426,799.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	413,475.18	413,475.18
应付托管费	-	-	-	103,368.79	103,368.79
应交税费	-	-	-	173,019.61	173,019.61
其他负债	-	-	-	78,351.28	78,351.28
负债总计	-	-	-	768,214.86	768,214.86
利率敏感度缺口	75,157,689.48	-	-	768,500,895.22	843,658,584.70
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	12,940,339.72	-	-	-	12,940,339.72
结算备付金	27,674,514.64	-	-	-	27,674,514.64
存出保证金	-	-	-	6,448,694.30	6,448,694.30
交易性金融资产	-	-	-	717,162,678.30	717,162,678.30
买入返售金融资产	30,007,621.96	-	-	-	30,007,621.96
应收清算款	-	-	-	6,642.22	6,642.22
应收股利	-	-	-	328,782.48	328,782.48
资产总计	70,622,476.32	-	-	723,946,797.30	794,569,273.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	407,178.37	407,178.37

应付托管费	-	-	-	101,794.59	101,794.59
应交税费	-	-	-	48,061.01	48,061.01
其他负债	-	-	-	155,000.00	155,000.00
负债总计	-	-	-	712,033.97	712,033.97
利率敏感度缺口	70,622,476.32	-	-	723,234,763.33	793,857,239.65

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。本基金持有以非记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	10,078,715.88	10,078,715.88
存出保证金	6,980,092.29	6,980,092.29
结算备付金	31,411,726.21	31,411,726.21
交易性金融资产	761,935,642.28	761,935,642.28
应收股利	309,243.06	309,243.06
应收清算款	44,132.45	44,132.45

资产合计	810,759,552.17	810,759,552.17
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	810,759,552.17	810,759,552.17
项目	上年度末 2025年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	6,703,854.78	6,703,854.78
存出保证金	6,448,694.30	6,448,694.30
结算备付金	27,224,466.46	27,224,466.46
交易性金融资产	717,162,678.30	717,162,678.30
应收股利	328,782.48	328,782.48
应收清算款	6,642.22	6,642.22
资产合计	757,875,118.54	757,875,118.54
以外币计价的负债		
负债合计	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	757,875,118.54	757,875,118.54

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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
	美元相对人民币升值 5%	增加约 40,537,977.61	增加约 37,893,755.93
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 40,537,977.61	减少约 37,893,755.93

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	761,935,642.28	90.31	717,162,678.30	90.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	761,935,642.28	90.31	717,162,678.30	90.34

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 42,190,150.68	增加约 39,682,670.45

	业绩比较基准下降 5%	减少约 42,190,150.68	减少约 39,682,670.45
--	-------------	-------------------	-------------------

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	761,935,642.28	717,162,678.30
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	761,935,642.28	717,162,678.30

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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 0.00 元（于 2025 上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 59,285,846.86 元），其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申

购款 0.00 元（于 2025 上半年度，括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 59,285,846.86 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	761,935,642.28	90.23
	其中：普通股	748,519,242.36	88.64
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	13,416,399.92	1.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,157,689.48	8.90
8	其他各项资产	7,333,467.80	0.87
9	合计	844,426,799.56	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	761,935,642.28	90.31

合计	761,935,642.28	90.31
----	----------------	-------

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	291,731,172.45	34.58
金融	90,253,510.96	10.70
通讯业务	74,275,882.13	8.80
非日常生活消费品	71,238,499.56	8.44
医疗保健	68,225,776.41	8.09
工业	63,359,132.78	7.51
日常消费品	35,056,629.14	4.16
能源	22,862,180.92	2.71
公用事业	16,848,048.74	2.00
原材料	14,061,918.58	1.67
房地产	14,022,890.61	1.66
合计	761,935,642.28	90.31

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA US	纳斯达 克	美国	42,326.00	57,681,575.71	6.84
2	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达 克	美国	25,666.00	50,582,604.75	6.00
3	Alphabet Inc	Alphabet 股份有限公司	GOOGL US	纳斯达 克	美国	10,246.00	24,938,880.12	2.96
			GOOG US	纳斯达 克	美国	8,259.00	19,875,244.66	2.36
4	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	纳斯达 克	美国	12,981.00	32,979,553.50	3.91

5	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	17,106.00	27,768,339.25	3.29
6	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克	美国	8,274.00	21,287,491.79	2.52
7	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU US	纳斯达克	美国	1,971.00	15,495,516.66	1.84
8	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克	美国	3,837.00	14,720,696.01	1.74
9	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克	美国	4,920.00	14,094,149.54	1.67
10	Eli Lilly & Co	礼来	LLY US	纽约	美国	1,383.00	11,298,000.54	1.34
11	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克	美国	2,850.00	11,276,081.77	1.34
12	Berkshire Hathaway Inc	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B US	纽约	美国	3,204.00	10,919,572.43	1.29
13	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM US	纽约	美国	4,682.00	10,438,106.50	1.24
14	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克	美国	8,256.00	7,851,505.26	0.93
15	Johnson & Johnson	强生	JNJ US	纽约	美国	4,207.00	7,277,118.30	0.86
16	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT US	纳斯达克	美国	1,387.00	6,829,977.33	0.81
17	Visa Inc	维萨公司	V US	纽约	美国	2,901.00	6,778,916.63	0.80
18	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚石油公司	XOM US	纽约	美国	7,243.00	6,744,581.99	0.80
19	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX US	纳斯达克	美国	2,186.00	6,451,688.91	0.76
20	Walmart Inc	沃尔玛股份有限公司	WMT US	纳斯达克	美国	7,661.00	5,909,714.81	0.70
21	Caterpillar Inc	卡特彼勒公司	CAT US	纽约	美国	805.00	5,838,606.57	0.69

22	Cisco Systems Inc	思科公司	CSCO US	纳斯达克	美国	6,902.00	5,521,657.38	0.65
23	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV US	纽约	美国	3,088.00	5,292,507.38	0.63
24	Costco Wholesale Corp	开市客公司	COST US	纳斯达克	美国	776.00	4,944,200.68	0.59
25	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	MA US	纽约	美国	1,410.00	4,932,290.32	0.58
26	KLA Corp	科磊公司	KLAC US	纳斯达克	美国	2,283.00	4,691,374.69	0.56
27	General Electric Co	通用电气公司	GE US	纽约	美国	1,824.00	4,642,878.29	0.55
28	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	UNH US	纽约	美国	1,587.00	4,492,502.40	0.53
29	Bank of America Corp	美国银行公司	BAC US	纽约	美国	11,409.00	4,427,662.70	0.52
30	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	纽约	美国	1,741.00	4,182,000.76	0.50
31	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG US	纽约	美国	4,069.00	4,063,915.28	0.48
32	Sandisk Corp	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	纳斯达克	美国	258.00	3,995,426.10	0.47
33	Merck & Co Inc	默克	MRK US	纽约	美国	4,316.00	3,777,366.01	0.45
34	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	纽约	美国	470.00	3,760,871.37	0.45
35	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO US	纽约	美国	6,767.00	3,745,682.31	0.44
36	Chevron Corp	雪佛龙	CVX US	纽约	美国	3,272.00	3,694,005.49	0.44
37	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克	美国	7,358.00	3,578,182.60	0.42
38	Goldman	高盛	GS US	纽约	美国	516.00	3,554,383.41	0.42

	Sachs Group Inc/The							
39	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际股份有限公司	PM US	纽约	美国	2,724.00	3,356,403.62	0.40
40	Palo Alto Networks Inc	派拓网络公司	PANW US	纳斯达克	美国	1,417.00	3,291,199.47	0.39
41	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳斯达克	美国	1,591.00	3,229,928.82	0.38
42	Palantir Technologies Inc	Palantir 技术股份有限公司	PLTR US	纳斯达克	美国	4,012.00	3,188,046.34	0.38
43	International Business Machines Corp	国际商业机器公司	IBM US	纽约	美国	1,642.00	3,144,911.42	0.37
44	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL US	纳斯达克	美国	1,530.00	3,104,215.47	0.37
45	Wells Fargo & Co	富国集团公司	WFC US	纽约	美国	5,348.00	3,010,136.65	0.36
46	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	纽约	美国	2,095.00	2,982,757.37	0.35
47	Oracle Corp	甲骨文股份有限公司	ORCL US	纽约	美国	2,965.00	2,959,477.38	0.35
48	Linde PLC	林德公司	LIN US	纳斯达克	美国	808.00	2,855,834.34	0.34
49	Citigroup Inc	花旗集团	C US	纽约	美国	2,981.00	2,841,648.87	0.34
50	Western Digital Corp	西部数据公司	WDC US	纳斯达克	美国	602.00	2,618,855.34	0.31
51	Amphenol Corp	安费诺公司	APH US	纽约	美国	2,150.00	2,581,930.46	0.31
52	Seagate Technology	Seagate Technology 控股公共	STX US	纳斯达克	美国	391.00	2,569,854.73	0.30

	Holdings PLC	有限公司						
53	Corning Inc	康宁公司	GLW US	纽约	美国	1,368.00	2,379,920.80	0.28
54	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳斯达克	美国	944.00	2,328,246.77	0.28
55	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	1,842.00	2,318,315.80	0.27
56	Analog Devices Inc	亚德诺半导体公司	ADI US	纳斯达克	美国	854.00	2,310,142.72	0.27
57	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 控股股份有限公司	CRWD US	纳斯达克	美国	444.00	2,307,765.58	0.27
58	McDonald's Corp	麦当劳	MCD US	纽约	美国	1,242.00	2,286,589.54	0.27
59	Thermo Fisher Scientific Inc	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	纽约	美国	650.00	2,219,563.34	0.26
60	PepsiCo Inc	百事公司	PEP US	纳斯达克	美国	2,389.00	2,203,125.91	0.26
61	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	纽约	美国	3,644.00	2,178,356.57	0.26
62	American Express Co	美国运通	AXP US	纽约	美国	930.00	2,142,521.84	0.25
63	Verizon Communications Inc	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	纽约	美国	7,297.00	2,104,261.47	0.25
64	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET US	纽约	美国	1,805.00	2,088,449.42	0.25
65	Boeing Co/The	波音	BA US	纽约	美国	1,377.00	2,030,187.56	0.24
66	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX US	纽约	美国	1,933.00	1,994,568.66	0.24
67	Walt Disney Co/The	华特迪士尼公司	DIS US	纽约	美国	3,035.00	1,989,591.59	0.24
68	Eaton	伊顿公共	ETN US	纽约	美国	679.00	1,970,635.02	0.23

	Corp PLC	有限公司						
69	Union Pacific Corp	联合太平洋	UNP US	纽约	美国	1,038.00	1,922,962.26	0.23
70	Welltower Inc	沃尔塔公司	WELL US	纽约	美国	1,233.00	1,906,057.68	0.23
71	Deere & Co	迪尔	DE US	纽约	美国	439.00	1,896,637.25	0.22
72	Abbott Laboratories	雅培制药公司	ABT US	纽约	美国	3,044.00	1,881,256.12	0.22
73	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克	美国	2,170.00	1,867,261.36	0.22
74	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW US	纽约	美国	2,857.00	1,795,458.06	0.21
75	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER US	纽约	美国	3,557.00	1,748,174.95	0.21
76	AT&T Inc	美国电话电报公司	T US	纽约	美国	12,142.00	1,711,847.52	0.20
77	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳斯达克	美国	619.00	1,676,597.84	0.20
78	Blackrock Inc	贝莱德股份有限公司	BLK US	纽约	美国	253.00	1,656,919.52	0.20
79	AppLovin Corp	AppLovin 公司	APP US	纳斯达克	美国	471.00	1,652,823.78	0.20
80	Booking Holdings Inc	缤客控股公司	BKNG US	纳斯达克	美国	1,354.00	1,643,721.90	0.19
81	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE US	纽约	美国	9,959.00	1,633,340.45	0.19
82	CVS Health Corp	CVS 健康公司	CVS US	纽约	美国	2,230.00	1,571,230.36	0.19
83	Vertiv Holdings Co	维谛技术控股公司	VRT US	纽约	美国	671.00	1,530,165.54	0.18
84	Salesforce Inc	Salesforce 股份有限公司	CRM US	纽约	美国	1,430.00	1,525,803.70	0.18

85	Progressive Corp/The	前进保险公司	PGR US	纽约	美国	1,022.00	1,520,573.61	0.18
86	ConocoPhillips	康菲石油	COP US	纽约	美国	2,129.00	1,507,462.22	0.18
87	Prologis Inc	安博	PLD US	纽约	美国	1,629.00	1,503,033.70	0.18
88	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克	美国	444.00	1,502,131.19	0.18
89	Dell Technologies Inc	戴尔科技公司	DELL US	纽约	美国	506.00	1,486,947.24	0.18
90	Capital One Financial Corp	第一资本金融	COF US	纽约	美国	1,088.00	1,486,646.20	0.18
91	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾公司	PH US	纽约	美国	221.00	1,472,274.93	0.17
92	Lowe's Cos Inc	劳氏	LOW US	纽约	美国	979.00	1,470,198.90	0.17
93	S&P Global Inc	标普全球	SPGI US	纽约	美国	530.00	1,470,117.78	0.17
94	Chubb Ltd	邱博保险集团	CB US	纽约	美国	631.00	1,464,390.77	0.17
95	Altria Group Inc	高特利	MO US	纽约	美国	2,918.00	1,429,949.14	0.17
96	DanaHER Corp	丹纳赫	DHR US	纽约	美国	1,101.00	1,428,371.60	0.17
97	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝公司	BMJ US	纽约	美国	3,569.00	1,400,632.84	0.17
98	Starbucks Corp	星巴克公司	SBUX US	纳斯达克	美国	1,992.00	1,386,443.70	0.16
99	Trane Technologies PLC	特灵科技公共有限公司	TT US	纽约	美国	387.00	1,294,608.52	0.15
100	Stryker Corp	史赛克公司	SYK US	纽约	美国	603.00	1,293,039.28	0.15
101	Quanta Services Inc	Quanta 服务股份有限公司	PWR US	纽约	美国	262.00	1,284,879.55	0.15
102	Southern	南方公司	SO US	纽约	美国	1,969.00	1,283,534.47	0.15

	Co/The							
103	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM US	纽约	美国	700.00	1,281,825.00	0.15
104	Cadence Design Systems Inc	铿腾电子科技有限公司	CDNS US	纳斯达克	美国	481.00	1,229,564.42	0.15
105	Equinix Inc	Equinix 有限公司	EQIX US	纳斯达克	美国	172.00	1,221,133.62	0.14
106	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW US	纽约	美国	1,803.00	1,219,163.63	0.14
107	Medtronic PLC	美敦力	MDT US	纽约	美国	2,244.00	1,195,640.69	0.14
108	Newmont Corp	纽蒙黄金公司	NEM US	纽约	美国	1,866.00	1,187,033.62	0.14
109	Bank of New York Mellon Corp/The	纽约梅隆银行	BNY US	纽约	美国	1,200.00	1,181,909.10	0.14
110	PNC Financial Services Group Inc/The	PNC 财务服务	PNC US	纽约	美国	702.00	1,177,239.82	0.14
111	Cummins Inc	康明斯	CMI US	纽约	美国	242.00	1,175,539.68	0.14
112	Duke Energy Corp	杜克能源公司	DUK US	纽约	美国	1,362.00	1,174,212.51	0.14
113	Fortinet Inc	飞塔信息	FTNT US	纳斯达克	美国	1,089.00	1,139,410.31	0.14
114	US Bancorp	美国合众银行	USB US	纽约	美国	2,713.00	1,116,069.49	0.13
115	McKesson Corp	McKesson 公司	MCK US	纽约	美国	211.00	1,085,872.68	0.13
116	Williams Cos Inc/The	威廉姆斯公司	WMB US	纽约	美国	2,137.00	1,082,010.77	0.13
117	Freeport-McMoRan Inc	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	纽约	美国	2,512.00	1,075,983.80	0.13

118	General Dynamics Corp	通用动力	GD US	纽约	美国	444.00	1,071,235.79	0.13
119	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克	美国	699.00	1,066,185.44	0.13
120	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	JCI US	纽约	美国	1,067.00	1,061,815.02	0.13
121	CSX Corp	CSX 公司	CSX US	纳斯达克	美国	3,247.00	1,051,125.58	0.12
122	Blackstone Inc	黑石集团股份有限公司	BX US	纽约	美国	1,299.00	1,041,068.75	0.12
123	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克	美国	6,226.00	1,041,034.49	0.12
124	Datadog Inc	数据狗	DDOG US	纳斯达克	美国	578.00	1,024,959.26	0.12
125	Synopsys Inc	新思科技公司	SNPS US	纳斯达克	美国	335.00	1,017,776.28	0.12
126	3M Co	3M 公司	MMM US	纽约	美国	912.00	1,005,710.57	0.12
127	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV US	纽约	美国	380.00	1,000,912.16	0.12
128	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克	美国	707.00	987,234.10	0.12
129	Waste Management Inc	废品管理	WM US	纽约	美国	646.00	980,636.65	0.12
130	Marriott International Inc/MD	万豪国际集团	MAR US	纳斯达克	美国	383.00	966,711.70	0.11
131	Marsh & McLennan Cos Inc	Marsh & McLennan 股份有限公司	MRSB US	纽约	美国	842.00	955,815.42	0.11
132	United Parcel Service Inc	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	纽约	美国	1,304.00	954,751.96	0.11
133	Emerson	艾默生电	EMR US	纽约	美国	979.00	954,505.75	0.11

	Electric Co	气						
134	CME Group Inc	芝加哥商业交易所	CME US	纳斯达克	美国	633.00	952,064.31	0.11
135	Constellation Energy Corp	美国联合能源公司	CEG US	纳斯达克	美国	559.00	945,617.39	0.11
136	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市场股份公司	HOOD US	纳斯达克	美国	1,383.00	944,584.92	0.11
137	Royal Caribbean Cruises Ltd	皇家加勒比国际游轮有限公司	RCL US	纽约	美国	436.00	942,921.97	0.11
138	Sherwin-Williams Co/The	宣伟公司	SHW US	纽约	美国	401.00	940,396.76	0.11
139	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	纳斯达克	美国	814.00	929,907.30	0.11
140	Valero Energy Corp	Valero 能源	VLO US	纽约	美国	519.00	920,618.18	0.11
141	Coherent Corp	相干公司	COHR US	纽约	美国	341.00	916,163.24	0.11
142	Accenture PLC	埃森哲公司	ACN US	纽约	美国	1,073.00	909,419.43	0.11
143	O'Reilly Automotive Inc	奥莱利汽车公司	ORLY US	纳斯达克	美国	1,449.00	908,835.67	0.11
144	American Tower Corp	美国发射塔公司	AMT US	纽约	美国	815.00	907,958.01	0.11
145	Teradyne Inc	泰瑞达	TER US	纳斯达克	美国	274.00	902,935.72	0.11
146	Hilton Worldwide Holdings Inc	希尔顿全球控股股份有限公司	HLT US	纽约	美国	398.00	895,790.55	0.11
147	Marathon Petroleum Corp	马拉松石油公司	MPC US	纽约	美国	511.00	889,826.17	0.11

148	TransDigm Group Inc	TransDigm 集团公司	TDG US	纽约	美国	98.00	889,094.34	0.11
149	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP US	纳斯达克	美国	950.00	885,209.27	0.10
150	Mondelez International Inc	亿滋国际公司	MDLZ US	纳斯达克	美国	2,243.00	883,612.93	0.10
151	Colgate-Palmolive Co	高露洁棕榄	CL US	纽约	美国	1,399.00	873,568.21	0.10
152	Cigna Group/Ther	信诺集团	CI US	纽约	美国	462.00	867,464.56	0.10
153	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG US	纽约	美国	567.00	863,687.16	0.10
154	Intuit Inc	财捷集团	INTU US	纳斯达克	美国	484.00	860,380.13	0.10
155	CRH PLC	CRH 公共股份公司	CRH US	纽约	美国	1,168.00	851,199.04	0.10
156	United Rentals Inc	联合租赁公司	URI US	纽约	美国	110.00	848,760.06	0.10
157	Aon PLC	怡安公共有限公司	AON US	纽约	美国	374.00	844,906.18	0.10
158	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳斯达克	美国	554.00	844,828.12	0.10
159	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克	美国	441.00	844,103.65	0.10
160	Illinois Tool Works Inc	伊利诺伊工具股份有限公司	ITW US	纽约	美国	458.00	843,702.01	0.10
161	Norfolk Southern Corp	诺福克南方	NSC US	纽约	美国	393.00	842,057.93	0.10
162	Ecolab Inc	艺康集团	ECL US	纽约	美国	443.00	840,630.09	0.10
163	Travelers	旅行家集	TRV US	纽约	美国	372.00	836,410.12	0.10

	Cos Inc/The	团						
164	Honeywell Aerospace Inc	霍尼韦尔航空航天股份有限公司	HONA US	纳斯达克	美国	554.00	834,187.59	0.10
165	DoorDash Inc	DoorDash 股份有限公司	DASH US	纳斯达克	美国	661.00	830,754.96	0.10
166	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所（ICE）	ICE US	纽约	美国	989.00	829,266.51	0.10
167	SLB Ltd	斯伦贝谢有限公司	SLB US	纽约	美国	2,613.00	827,377.03	0.10
168	General Motors Co	通用汽车公司	GM US	纽约	美国	1,576.00	827,375.06	0.10
169	Ciena Corp	Ciena 公司	CIEN US	纽约	美国	247.00	825,265.31	0.10
170	Comfort Systems USA Inc	美国舒适系统公司	FIX US	纽约	美国	61.00	823,430.66	0.10
171	Motorola Solutions Inc	摩托罗拉解决方案股份有限公司	MSI US	纽约	美国	291.00	823,093.11	0.10
172	EOG Resources Inc	EOG 资源	EOG US	纽约	美国	931.00	822,611.17	0.10
173	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	纳斯达克	美国	1,248.00	817,020.31	0.10
174	FedEx Corp	联邦快递	FDX US	纽约	美国	383.00	816,823.00	0.10
175	Ross Stores Inc	罗斯百货股份有限公司	ROST US	纳斯达克	美国	563.00	816,181.14	0.10
176	Moody's Corp	穆迪	MCO US	纽约	美国	263.00	811,300.51	0.10
177	Phillips 66	菲利浦 66	PSX US	纽约	美国	701.00	807,119.23	0.10
178	Monolithic Power	芯源系统有限公司	MPWR US	纳斯达克	美国	85.00	800,284.84	0.09

	Systems Inc							
179	Lumentum Holdings Inc	Lumentum 控股股份有限公司	LITE US	纳斯达克	美国	135.00	788,961.72	0.09
180	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟探索股份有限公司	WBD US	纳斯达克	美国	4,331.00	786,416.89	0.09
181	Air Products and Chemicals Inc	空气产品公司	APD US	纽约	美国	390.00	778,759.67	0.09
182	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX US	纽约	美国	2,598.00	755,210.57	0.09
183	KKR & Co Inc	KKR & Co 股份有限公司	KKR US	纽约	美国	1,208.00	755,126.12	0.09
184	PACCAR Inc	帕卡公司	PCAR US	纳斯达克	美国	920.00	752,675.28	0.09
185	Kinder Morgan Inc	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽约	美国	3,422.00	745,121.59	0.09
186	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克	美国	175.00	743,202.00	0.09
187	Truist Financial Corp	Truist 金融公司	TFC US	纽约	美国	2,177.00	738,697.55	0.09
188	Allstate Corp/The	好事达保险公司	ALL US	纽约	美国	450.00	729,263.50	0.09
189	Delta Air Lines Inc	达美航空有限公司	DAL US	纽约	美国	1,141.00	727,854.05	0.09
190	HCA Healthcare Inc	HCA 医疗保健有限公司	HCA US	纽约	美国	272.00	722,296.49	0.09
191	Sempra	Sempra	SRE US	纽约	美国	1,143.00	721,734.25	0.09
192	Keysight Technologies Inc	是德科技公司	KEYS US	纽约	美国	300.00	715,287.53	0.08

193	Dominion Energy Inc	Dominion 能源股份有限公司	D US	纽约	美国	1,536.00	714,418.73	0.08
194	Hewlett Packard Enterprise Co	慧与公司	HPE US	纽约	美国	2,319.00	712,488.86	0.08
195	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	ABNB US	纳斯达克	美国	731.00	712,461.69	0.08
196	Flex Ltd	伟创力国际有限公司	FLEX US	纳斯达克	美国	642.00	708,666.93	0.08
197	Target Corp	塔吉特公司	TGT US	纽约	美国	794.00	706,319.89	0.08
198	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR US	纽约	美国	577.00	705,729.52	0.08
199	WW Grainger Inc	固安捷股份有限公司	GWG US	纽约	美国	76.00	704,181.68	0.08
200	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	AJG US	纽约	美国	449.00	702,046.66	0.08
201	TE Connectivity PLC	TE Connectivity 公共有限公司	TEL US	纽约	美国	511.00	701,677.38	0.08
202	Cintas Corp	信达思公司	CTAS US	纳斯达克	美国	595.00	689,246.73	0.08
203	Realty Income Corp	Realty Income 公司	O US	纽约	美国	1,629.00	687,443.48	0.08
204	Targa Resources Corp	Targa 资源公司	TRGP US	纽约	美国	376.00	686,679.30	0.08
205	Carrier Global Corp	开利全球公司	CARR US	纽约	美国	1,365.00	681,926.04	0.08
206	Corteva Inc	科迪华公司	CTVA US	纽约	美国	1,169.00	674,296.88	0.08
207	Cardinal Health Inc	嘉德诺健康集团	CAH US	纽约	美国	410.00	663,378.94	0.08
208	AMETEK	阿美特克	AME US	纽约	美国	401.00	660,779.49	0.08

	Inc	股份有限公司						
209	Rockwell Automation Inc	罗克韦尔自动化	ROK US	纽约	美国	195.00	657,528.37	0.08
210	Fastenal Co	法思诺公司	FAST US	纳斯达克	美国	2,006.00	656,217.82	0.08
211	Cencora Inc	Cencora 股份有限公司	COR US	纽约	美国	340.00	655,298.48	0.08
212	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR US	纳斯达克	美国	1,733.00	655,082.58	0.08
213	ONEOK Inc	Oneok 股份有限公司	OKE US	纽约	美国	1,101.00	651,945.75	0.08
214	Apollo Global Management Inc	阿波罗全球管理股份有限公司	APO US	纽约	美国	806.00	649,472.85	0.08
215	Ford Motor Co	福特汽车	F US	纽约	美国	6,839.00	647,458.46	0.08
216	L3Harris Technologies Inc	L3Harris Technologies 股份有限公司	LHX US	纽约	美国	326.00	645,212.49	0.08
217	Aflac Inc	家庭人寿保险公司	AFL US	纽约	美国	801.00	639,661.00	0.08
218	AutoZone Inc	AutoZone 股份有限公司	AZO US	纽约	美国	29.00	631,249.60	0.07
219	Entergy Corp	Entergy 公司	ETR US	纽约	美国	800.00	625,839.98	0.07
220	Edwards Lifesciences Corp	爱德华生命科学公司	EW US	纽约	美国	1,007.00	620,426.81	0.07
221	Fifth Third Bancorp	五三银行	FITB US	纽约	美国	1,583.00	607,761.88	0.07
222	Nucor Corp	纽柯公司	NUE US	纽约	美国	398.00	603,816.93	0.07
223	Public Storage	公共存储	PSA US	纽约	美国	277.00	600,529.79	0.07
224	Vistra	Vistra 公司	VST US	纽约	美国	554.00	598,548.84	0.07

	Corp							
225	Xcel Energy Inc	Xcel 能源股份有限公司	XEL US	纳斯达克	美国	1,090.00	596,137.64	0.07
226	eBay Inc	eBay 股份有限公司	EBAY US	纳斯达克	美国	776.00	590,627.63	0.07
227	Microchip Technology Inc	微芯科技股份有限公司	MCHP US	纳斯达克	美国	946.00	587,611.76	0.07
228	NIKE Inc	耐克公司	NKE US	纽约	美国	2,096.00	586,015.28	0.07
229	Humana Inc	Humana 股份有限公司	HUM US	纽约	美国	210.00	568,139.40	0.07
230	Exelon Corp	爱克斯龙公司	EXC US	纳斯达克	美国	1,788.00	567,733.19	0.07
231	Devon Energy Corp	戴文能源	DVN US	纽约	美国	2,015.00	567,074.17	0.07
232	Carvana Co	Carvana 公司	CVNA US	纽约	美国	1,251.00	560,815.09	0.07
233	State Street Corp	道富集团	STT US	纽约	美国	484.00	559,082.26	0.07
234	Electronic Arts Inc	艺电公司	EA US	纳斯达克	美国	394.00	550,223.73	0.07
235	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	西屋制动公司	WAB US	纽约	美国	297.00	545,356.94	0.06
236	MetLife Inc	大都会集团	MET US	纽约	美国	945.00	544,575.39	0.06
237	Axon Enterprise Inc	Axon Enterprise 股份有限公司	AXON US	纳斯达克	美国	140.00	534,556.21	0.06
238	Keurig Dr Pepper Inc	克里格胡椒博士	KDP US	纳斯达克	美国	2,378.00	530,105.56	0.06
239	United Airlines Holdings Inc	美国联合航空控股股份有限公司	UAL US	纳斯达克	美国	567.00	525,163.50	0.06
240	Yum!	百胜餐饮	YUM US	纽约	美国	482.00	524,797.01	0.06

	Brands Inc	集团						
241	Take-Two Interactive Software Inc	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO US	纳斯达克	美国	305.00	519,289.58	0.06
242	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG US	纽约	美国	2,242.00	519,181.29	0.06
243	Ventas Inc	Ventas 公司	VTR US	纽约	美国	849.00	513,481.92	0.06
244	DR Horton Inc	霍顿房屋公司	DHI US	纽约	美国	461.00	511,414.68	0.06
245	Republic Services Inc	公共服务公司	RSG US	纽约	美国	350.00	507,943.30	0.06
246	Becton Dickinson & Co	碧迪	BDX US	纽约	美国	482.00	496,794.27	0.06
247	IDEXX Laboratories Inc	爱德士股份有限公司	IDXX US	纳斯达克	美国	138.00	494,803.17	0.06
248	Ameriprise Financial Inc	阿默普莱斯金融公司	AMP US	纽约	美国	158.00	493,681.82	0.06
249	Autodesk Inc	欧特克公司	ADSK US	纳斯达克	美国	369.00	488,620.64	0.06
250	MSCI Inc	MSCI 明晟	MSCI US	纽约	美国	128.00	488,240.18	0.06
251	Jabil Inc	捷普集团	JBL US	纽约	美国	185.00	485,711.16	0.06
252	Consolidated Edison Inc	联合爱迪生	ED US	纽约	美国	644.00	485,247.47	0.06
253	Block Inc	Block 股份有限公司	XYZ US	纽约	美国	936.00	484,500.18	0.06
254	Public Service Enterprise Group Inc	公共服务企业集团	PEG US	纽约	美国	871.00	481,464.97	0.06
255	Sysco	Sysco 公司	SY Y US	纽约	美国	836.00	475,897.20	0.06

	Corp							
256	Old Dominion Freight Line Inc	奥多明尼昂货运	ODFL US	纳斯达克	美国	320.00	472,077.10	0.06
257	American International Group Inc	美国国际集团	AIG US	纽约	美国	927.00	470,560.38	0.06
258	CBRE Group Inc	世邦魏理仕	CBRE US	纽约	美国	511.00	468,771.02	0.06
259	Garmin Ltd	佳明有限公司	GRMN US	纽约	美国	287.00	464,326.16	0.06
260	Interactive Brokers Group Inc	盈透证券股份有限公司	IBKR US	纳斯达克	美国	779.00	461,807.35	0.05
261	Vulcan Materials Co	Vulcan 材料	VMC US	纽约	美国	227.00	456,107.38	0.05
262	PayPal Holdings Inc	贝宝	PYPL US	纳斯达克	美国	1,542.00	453,493.97	0.05
263	WEC Energy Group Inc	WEC 能源集团股份有限公司	WEC US	纽约	美国	570.00	453,326.01	0.05
264	Agilent Technologies Inc	安捷伦	A US	纽约	美国	494.00	446,917.77	0.05
265	Iron Mountain Inc	美国铁山公司	IRM US	纽约	美国	519.00	446,487.80	0.05
266	Prudential Financial Inc	保德信金融集团	PRU US	纽约	美国	607.00	446,205.97	0.05
267	ON Semiconductor Corp	安森美半导体	ON US	纳斯达克	美国	685.00	441,073.20	0.05
268	PG&E Corp	太平洋煤气电力	PCG US	纽约	美国	3,849.00	440,938.89	0.05
269	EMCOR Group Inc	埃姆科集团公司	EME US	纽约	美国	78.00	440,873.92	0.05
270	Waters Corp	沃特世公司	WAT US	纽约	美国	172.00	439,349.91	0.05

271	Archer-Daniels-Midland Co	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM US	纽约	美国	843.00	438,657.38	0.05
272	Carnival Corp Ltd	嘉年华公司	CCL US	纽约	美国	2,248.00	437,432.50	0.05
273	Kenvue Inc	科赴股份有限公司	KVUE US	纽约	美国	3,355.00	436,674.38	0.05
274	Kimberly-Clark Corp	金佰利	KMB US	纳斯达克	美国	581.00	434,374.48	0.05
275	Hartford Insurance Group Inc/The	哈特福德保险集团股份有限公司	HIG US	纽约	美国	479.00	432,336.04	0.05
276	Huntington Bancshares Inc/OH	俄亥俄州亨廷顿银行控股公司	HBAN US	纳斯达克	美国	3,543.00	427,842.96	0.05
277	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY US	纽约	美国	1,268.00	419,461.26	0.05
278	Nasdaq Inc	纳斯达克股份有限公司	NDAQ US	纳斯达克	美国	781.00	419,268.24	0.05
279	M&T Bank Corp	M&T 银行	MTB US	纽约	美国	256.00	414,991.95	0.05
280	Martin Marietta Materials Inc	Martin Marietta 材料股份有限公司	MLM US	纽约	美国	105.00	412,423.83	0.05
281	Roper Technologies Inc	儒博技术公司	ROP US	纳斯达克	美国	177.00	407,939.06	0.05
282	Qnity Electronics Inc	启诺迪电子股份有限公司	Q US	纽约	美国	366.00	407,097.44	0.05
283	Diamondback Energy Inc	戴蒙德巴克能源	FANG US	纳斯达克	美国	340.00	407,054.80	0.05
284	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	ACGL US	纳斯达克	美国	609.00	402,589.17	0.05

285	EQT Corp	EQT 公司	EQT US	纽约	美国	1,093.00	395,814.16	0.05
286	Crown Castle Inc	冠城股份有限公司	CCI US	纽约	美国	763.00	393,547.36	0.05
287	Coinbase Global Inc	Coinbase 全球股份有限公司	COIN US	纳斯达克克	美国	389.00	387,321.65	0.05
288	IQVIA Holdings Inc	艾昆纬	IQV US	纽约	美国	292.00	384,272.61	0.05
289	Northern Trust Corp	北美信托	NTRS US	纳斯达克克	美国	324.00	383,618.22	0.05
290	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克克	美国	258.00	379,663.27	0.05
291	DTE Energy Co	DTE 能源公司	DTE US	纽约	美国	364.00	377,750.77	0.04
292	Paychex Inc	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克克	美国	564.00	377,719.71	0.04
293	Kroger Co/The	克罗格公司	KR US	纽约	美国	992.00	375,183.60	0.04
294	Ameren Corp	Ameren 公司	AEE US	纽约	美国	484.00	372,633.60	0.04
295	Steel Dynamics Inc	Steel Dynamics 股份有限公司	STLD US	纳斯达克克	美国	237.00	370,390.50	0.04
296	Teledyne Technologies Inc	Teledyne 科技股份有限公司	TDY US	纽约	美国	81.00	367,917.33	0.04
297	NRG Energy Inc	NRG 能源股份有限公司	NRG US	纽约	美国	369.00	367,081.22	0.04
298	Extra Space Storage Inc	Extra Space Storage 有限公司	EXR US	纽约	美国	370.00	366,160.79	0.04
299	NetApp Inc	美国网域存储技术有限公司	NTAP US	纳斯达克克	美国	345.00	363,648.93	0.04
300	Dover Corp	都福	DOV US	纽约	美国	236.00	360,501.48	0.04
301	Zoetis Inc	硕腾股份有限公司	ZTS US	纽约	美国	733.00	358,753.12	0.04

302	Centene Corp	Centene 公司	CNC US	纽约	美国	819.00	358,059.98	0.04
303	Tapestry Inc	TPR-DRS-RS	TPR US	纽约	美国	354.00	352,930.76	0.04
304	Citizens Financial Group Inc	公民金融集团股份有限公司	CFG US	纽约	美国	739.00	352,680.18	0.04
305	Expedia Group Inc	亿客行集团股份有限公司	EXPE US	纳斯达克	美国	201.00	350,297.39	0.04
306	Ingersoll Rand Inc	英格索兰股份有限公司	IR US	纽约	美国	623.00	347,899.21	0.04
307	GE Healthcare Technologies Inc	GE 医疗技术公司	GEHC US	纳斯达克	美国	795.00	346,592.74	0.04
308	Casey's General Stores Inc	凯西杂货公司	CASY US	纳斯达克	美国	64.00	346,447.05	0.04
309	Live Nation Entertainment Inc	Live Nation 娱乐公司	LYV US	纽约	美国	277.00	345,458.86	0.04
310	VICI Properties Inc	VICI Properties 股份有限公司	VICI US	纽约	美国	1,910.00	345,384.14	0.04
311	CenterPoint Energy Inc	中点能源	CNP US	纽约	美国	1,144.00	343,145.13	0.04
312	Cincinnati Financial Corp	辛辛那提金融	CINF US	纳斯达克	美国	271.00	341,722.88	0.04
313	Atmos Energy Corp	Atmos 能源公司	ATO US	纽约	美国	291.00	341,434.30	0.04
314	Edison International	爱迪生国际	EIX US	纽约	美国	673.00	341,259.12	0.04
315	Halliburton Co	哈利伯顿	HAL US	纽约	美国	1,460.00	337,595.88	0.04
316	ResMed	瑞思迈股	RMD US	纽约	美国	254.00	337,136.28	0.04

	Inc	份有限公司						
317	Xylem Inc/NY	赛莱默公司	XYL US	纽约	美国	416.00	334,928.46	0.04
318	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO US	纽约	美国	41.00	333,638.61	0.04
319	Hubbell Inc	哈贝尔公司	HUBB US	纽约	美国	93.00	331,402.05	0.04
320	Otis Worldwide Corp	奥的斯电梯公司	OTIS US	纽约	美国	671.00	327,220.16	0.04
321	Williams-Sonoma Inc	Williams-Sonoma 股份有限公司	WSM US	纽约	美国	206.00	327,049.88	0.04
322	PPL Corp	PPL 公司	PPL US	纽约	美国	1,314.00	325,315.15	0.04
323	Eversource Energy	Eversource 能源公司	ES US	纽约	美国	658.00	323,883.22	0.04
324	PPG Industries Inc	PPG 工业	PPG US	纽约	美国	390.00	322,176.68	0.04
325	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份有限公司	VEEV US	纽约	美国	263.00	317,896.10	0.04
326	Raymond James Financial Inc	Raymond James 金融股份有限公司	RJF US	纽约	美国	304.00	314,780.18	0.04
327	Mettler-Toledo International Inc	梅特勒-托利多国际股份有限公司	MTD US	纽约	美国	36.00	313,235.74	0.04
328	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay 社区股份有限公司	AVB US	纽约	美国	243.00	312,291.14	0.04
329	Fiserv Inc	Fiserv 股份有限公司	FISV US	纳斯达克	美国	932.00	311,357.57	0.04
330	PulteGroup Inc	Pulte 集团公司	PHM US	纽约	美国	333.00	311,196.36	0.04
331	Hershey Co/The	好时公司	HSY US	纽约	美国	260.00	310,692.83	0.04
332	Dexcom	德康医疗	DXCM US	纳斯达克	美国	675.00	309,632.03	0.04

	Inc			克				
333	Regions Financial Corp	Regions 金融公司	RF US	纽约	美国	1,492.00	306,888.26	0.04
334	American Water Works Co Inc	美国自来水股份有限公司	AWK US	纽约	美国	342.00	306,492.95	0.04
335	Synchrony Financial	同步金融公司	SYF US	纽约	美国	588.00	304,565.74	0.04
336	Texas Pacific Land Corp	德克萨斯州太平洋土地公司	TPL US	纽约	美国	102.00	304,033.67	0.04
337	West Pharmaceutical Services Inc	西氏医药服务公司	WST US	纽约	美国	124.00	303,194.02	0.04
338	Cboe Global Markets Inc	Cboe 环球市场公司	CBOE US	芝加哥	美国	183.00	302,462.60	0.04
339	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克	美国	188.00	302,134.79	0.04
340	Dollar General Corp	达乐公司	DG US	纽约	美国	385.00	301,841.04	0.04
341	Southwest Airlines Co	西南航空	LUV US	纽约	美国	855.00	299,435.09	0.04
342	Copart Inc	科帕特公司	CPRT US	纳斯达克	美国	1,549.00	297,406.87	0.04
343	Workday Inc	Workday 股份有限公司	WDAY US	纳斯达克	美国	356.00	296,829.37	0.04
344	Willis Towers Watson PLC	韦莱韬睿惠悦公共有限公司	WTW US	纳斯达克	美国	166.00	295,507.38	0.04
345	FirstEnergy Corp	第一能源	FE US	纽约	美国	910.00	294,649.07	0.03

346	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克	美国	617.00	294,288.84	0.03
347	T Rowe Price Group Inc	普徠仕	TROW US	纳斯达克	美国	375.00	290,374.21	0.03
348	Smurfit Westrock PLC	斯墨菲特·韦斯特罗克集团	SW US	纽约	美国	916.00	288,606.17	0.03
349	Darden Restaurants Inc	达登餐饮公司	DRI US	纽约	美国	201.00	282,025.82	0.03
350	CMS Energy Corp	CMS 能源	CMS US	纽约	美国	539.00	280,837.25	0.03
351	F5 Inc	F5 股份有限公司	FFIV US	纳斯达克	美国	99.00	280,473.13	0.03
352	Verisk Analytics Inc	威瑞斯克分析公司	VRSK US	纳斯达克	美国	229.00	280,012.24	0.03
353	Ares Management Corp	阿瑞斯管理公司	ARES US	纽约	美国	368.00	278,988.63	0.03
354	Quest Diagnostics Inc	Quest Diagnostics 股份有限公司	DGX US	纽约	美国	193.00	278,609.06	0.03
355	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR US	纽约	美国	596.00	275,748.00	0.03
356	Labcorp Holdings Inc	Labcorp 控股股份有限公司	LH US	纽约	美国	144.00	274,615.49	0.03
357	Church & Dwight Co Inc	切迟杜威股份有限公司	CHD US	纽约	美国	415.00	273,833.60	0.03
358	NiSource Inc	NiSource 公司	NI US	纽约	美国	838.00	271,393.25	0.03
359	CH Robinson Worldwide Inc	罗宾逊全球物流有限公司	CHRW US	纳斯达克	美国	206.00	264,249.57	0.03
360	Dollar Tree Inc	美元树公司	DLTR US	纳斯达克	美国	317.00	261,137.74	0.03
361	Corpay	Corpay 股	CPAY US	纽约	美国	115.00	261,034.89	0.03

	Inc	份有限公司						
362	Veralto Corp	Veralto 公司	VLTO US	纽约	美国	430.00	259,715.96	0.03
363	Expand Energy Corp	Expand 能源公司	EXE US	纳斯达克	美国	418.00	259,613.94	0.03
364	JB Hunt Transport Services Inc	JB Hunt 运输服务股份有限公司	JBHT US	纳斯达克	美国	131.00	258,237.52	0.03
365	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	EXPD US	纽约	美国	229.00	254,199.27	0.03
366	KeyCorp	KeyCorp 公司	KEY US	纽约	美国	1,611.00	252,912.90	0.03
367	Principal Financial Group Inc	信安金融	PFG US	纳斯达克	美国	344.00	252,523.11	0.03
368	Packaging Corp of America	美国包装公司	PKG US	纽约	美国	155.00	251,549.69	0.03
369	Snap-on Inc	实耐宝	SNA US	纽约	美国	91.00	249,404.26	0.03
370	Omnicom Group Inc	Omnicom 集团股份有限公司	OMC US	纽约	美国	498.00	247,026.85	0.03
371	W R Berkley Corp	WR Berkley 公司	WRB US	纽约	美国	514.00	246,911.61	0.03
372	VeriSign Inc	威瑞信股份有限公司	VRSN US	纳斯达克	美国	144.00	246,722.40	0.03
373	STERIS PLC	思泰瑞医疗公共有限公司	STE US	纽约	美国	172.00	246,677.45	0.03
374	International Flavors & Fragrances Inc	国际香料	IFF US	纽约	美国	447.00	241,183.10	0.03

375	International Paper Co	国际纸业	IP US	纽约	美国	926.00	240,292.64	0.03
376	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克	美国	1,492.00	240,023.20	0.03
377	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	FIS US	纽约	美国	904.00	239,386.24	0.03
378	HP Inc	惠普	HPQ US	纽约	美国	1,599.00	238,940.40	0.03
379	Amcor PLC	安姆科公共有限公司	AMCR US	纽约	美国	808.00	238,564.03	0.03
380	Evergy Inc	Evergy 股份有限公司	EVRG US	纳斯达克	美国	403.00	237,232.43	0.03
381	Ulta Beauty Inc	Ulta 美容产品公司	ULTA US	纳斯达克	美国	77.00	236,511.64	0.03
382	Dow Inc	陶氏公司	DOW US	纽约	美国	1,259.00	234,609.90	0.03
383	Alliant Energy Corp	Alliant 能源公司	LNT US	纳斯达克	美国	451.00	234,341.21	0.03
384	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰黛	EL US	纽约	美国	433.00	232,833.00	0.03
385	Lennar Corp	莱纳公司	LEN US	纽约	美国	377.00	232,352.01	0.03
386	Constellation Brands Inc	星座品牌股份有限公司	STZ US	纽约	美国	244.00	231,148.05	0.03
387	Loews Corp	罗斯公司	L US	纽约	美国	295.00	227,463.29	0.03
388	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克	美国	293.00	226,220.50	0.03
389	Equifax Inc	Equifax 股份有限公司	EFX US	纽约	美国	209.00	225,934.44	0.03
390	Essex	埃塞克斯	ESS US	纽约	美国	113.00	224,416.91	0.03

	Property Trust Inc	房地产信托公司						
391	SBA Communications Corp	SBA 通信公司	SBAC US	纳斯达克	美国	186.00	223,544.36	0.03
392	Brown & Brown Inc	Brown & Brown 股份有限公司	BRO US	纽约	美国	510.00	222,828.81	0.03
393	Fortive Corp	福迪威公司	FTV US	纽约	美国	533.00	221,769.51	0.03
394	General Mills Inc	通用磨坊	GIS US	纽约	美国	933.00	221,139.03	0.03
395	DuPont de Nemours Inc	杜邦公司	DD US	纽约	美国	239.00	220,795.48	0.03
396	Viatis Inc	晖致	VTRS US	纳斯达克	美国	2,035.00	220,099.68	0.03
397	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技解决方案公司	CTSH US	纳斯达克	美国	829.00	218,678.72	0.03
398	Lennox International Inc	雷诺士国际有限公司	LII US	纽约	美国	56.00	218,529.09	0.03
399	CDW Corp/DE	特拉华 CDW 公司	CDW US	纳斯达克	美国	224.00	214,566.23	0.03
400	Weyerhaeuser Co	惠好	WY US	纽约	美国	1,260.00	205,446.71	0.02
401	Generac Holdings Inc	Generac 控股公司	GNRC US	纽约	美国	103.00	205,412.86	0.02
402	Akamai Technologies Inc	阿卡迈技术公司	AKAM US	纳斯达克	美国	254.00	204,499.59	0.02
403	Kimco Realty Corp	Kimco Realty Corp	KIM US	纽约	美国	1,179.00	203,561.80	0.02
404	Fox Corp	福克斯公司	FOXA US	纳斯达克	美国	349.00	123,984.53	0.01
			FOX US	纳斯达克	美国	243.00	77,522.48	0.01

405	Global Payments Inc	环汇有限公司	GPN US	纽约	美国	407.00	201,138.95	0.02
406	IDEX Corp	艺达思集团	IEX US	纽约	美国	130.00	200,945.39	0.02
407	Zimmer Biomet Holdings Inc	捷迈邦美控股股份有限公司	ZBH US	纽约	美国	339.00	198,772.78	0.02
408	CF Industries Holdings Inc	CF 工业控股股份有限公司	CF US	纽约	美国	269.00	198,346.62	0.02
409	Ball Corp	波尔	BALL US	纽约	美国	466.00	198,050.07	0.02
410	Tractor Supply Co	拖拉机供应公司	TSCO US	纳斯达克	美国	917.00	197,423.27	0.02
411	Invitation Homes Inc	邀请家园公司	INVH US	纽约	美国	955.00	196,498.21	0.02
412	Super Micro Computer Inc	超微电脑	SMCI US	纳斯达克	美国	983.00	196,367.71	0.02
413	Masco Corp	马斯可	MAS US	纽约	美国	353.00	195,633.64	0.02
414	Fedex Freight Holding Co Inc	联邦快递货运控股股份有限公司	FDXF US	纽约	美国	190.00	195,404.72	0.02
415	Genuine Parts Co	原配部件	GPC US	纽约	美国	241.00	193,655.55	0.02
416	Mid-America Apartment Communities Inc	Mid-America Apartment Communities 股份有限公司	MAA US	纽约	美国	204.00	193,046.51	0.02
417	Tyson Foods Inc	泰森食品公司	TSN US	纽约	美国	493.00	192,232.54	0.02
418	Nordson Corp	诺信公司	NDSN US	纳斯达克	美国	93.00	191,094.58	0.02
419	Albemarle Corp	雅保公司	ALB US	纽约	美国	207.00	190,372.90	0.02
420	Textron	德事隆	TXT US	纽约	美国	304.00	189,928.21	0.02

	Inc							
421	Broadridge Financial Solutions Inc	布罗德里奇金融解决方案股份有限公司	BR US	纽约	美国	203.00	189,348.81	0.02
422	Ralph Lauren Corp	拉夫劳伦	RL US	纽约	美国	68.00	185,909.51	0.02
423	Host Hotels & Resorts Inc	Host 酒店及度假股份有限公司	HST US	纳斯达克	美国	1,113.00	179,734.41	0.02
424	Jacobs Solutions Inc	嘉科解决方案股份有限公司	J US	纽约	美国	206.00	176,783.72	0.02
425	Best Buy Co Inc	百思买	BBY US	纽约	美国	342.00	176,749.39	0.02
426	Healthpeak Properties Inc	Healthpeak Properties Inc	DOC US	纽约	美国	1,205.00	175,632.68	0.02
427	Stanley Black & Decker Inc	史丹利百得公司	SWK US	纽约	美国	272.00	174,363.40	0.02
428	Bunge Global SA	Bunge Global SA	BG US	纽约	美国	238.00	173,008.71	0.02
429	Everest Group Ltd	Everest 集团有限公司	EG US	纽约	美国	70.00	170,314.05	0.02
430	Deckers Outdoor Corp	德克斯户外用品公司	DECK US	纽约	美国	249.00	168,387.31	0.02
431	Cooper Cos Inc/The	库柏股份有限公司	COO US	纳斯达克	美国	341.00	166,547.69	0.02
432	Globe Life Inc	Globe Life 股份有限公司	GL US	纽约	美国	136.00	165,508.14	0.02
433	EchoStar Corp	回声星通信公司	ECHO US	纳斯达克	美国	238.00	164,530.91	0.02
434	Las Vegas Sands	拉斯维加斯金沙公	LVS US	纽约	美国	522.00	164,218.84	0.02

	Corp	司						
435	Gen Digital Inc	Gen Digital 股份有限公司	GEN US	纳斯达克	美国	964.00	163,420.46	0.02
436	LyondellBasell Industries NV	利安德巴塞尔工业公司	LYB US	纽约	美国	452.00	162,084.44	0.02
437	Assurant Inc	安信龙集团	AIZ US	纽约	美国	87.00	159,116.99	0.02
438	Regency Centers Corp	Regency Centers 公司	REG US	纳斯达克	美国	288.00	156,413.14	0.02
439	PTC Inc	PTC 股份有限公司	PTC US	纳斯达克	美国	202.00	156,304.84	0.02
440	Aptiv PLC	安波福公共有限公司	APTIV US	纽约	美国	370.00	154,679.63	0.02
441	Leidos Holdings Inc	Leidos 控股公司	LDOS US	纽约	美国	220.00	154,290.04	0.02
442	Pinnacle West Capital Corp	Pinnacle 西部资本	PNW US	纽约	美国	211.00	153,769.69	0.02
443	McCormick & Co Inc/MD	味好美股份有限公司/马里兰州	MKC US	纽约	美国	444.00	152,472.08	0.02
444	TKO Group Holdings Inc	TKO 集团控股股份有限公司	TKO US	纽约	美国	111.00	152,192.35	0.02
445	Zebra Technologies Corp	斑马技术公司	ZBRA US	纳斯达克	美国	84.00	150,615.15	0.02
446	News Corp	新闻集团	NWSA US	纳斯达克	美国	638.00	107,895.14	0.01
			NWS US	纳斯达克	美国	211.00	40,325.02	0.00
447	Avery Dennison Corp	艾利丹尼森	AVY US	纽约	美国	134.00	148,170.45	0.02
448	Revvity	Revvity 股	RVTY US	纽约	美国	195.00	147,767.24	0.02

	Inc	份有限公司						
449	Pentair PLC	Pentair 公共有限公司	PNR US	纽约	美国	283.00	147,760.98	0.02
450	Tyler Technologies Inc	Tyler 科技公司	TYL US	纽约	美国	74.00	147,401.77	0.02
451	Rollins Inc	Rollins 公司	ROL US	纽约	美国	514.00	146,123.50	0.02
452	Allegion plc	安朗杰公共有限公司	ALLE US	纽约	美国	151.00	144,486.36	0.02
453	J M Smucker Co/The	JM 斯马克公司	SJM US	纽约	美国	187.00	143,284.31	0.02
454	Charter Communications Inc	特许通讯公司	CHTR US	纳斯达克	美国	147.00	142,380.98	0.02
455	Lululemon Athletica Inc	露露乐蒙	LULU US	纳斯达克	美国	183.00	142,313.35	0.02
456	Trimble Inc	天宝股份有限公司	TRMB US	纳斯达克	美国	408.00	142,221.40	0.02
457	UDR Inc	UDR 公司	UDR US	纽约	美国	517.00	140,567.71	0.02
458	Invesco Ltd	景顺有限公司	IVZ US	纽约	美国	775.00	139,298.23	0.02
459	Clorox Co/The	高乐氏公司	CLX US	纽约	美国	212.00	137,806.85	0.02
460	CoStar Group Inc	科斯塔集团	CSGP US	纳斯达克	美国	714.00	137,719.67	0.02
461	Camden Property Trust	Camden 房地产信托公司	CPT US	纽约	美国	176.00	137,241.27	0.02
462	APA Corp	APA	APA US	纳斯达克	美国	618.00	137,091.57	0.02
463	Solventum Corp	索尔文图姆公司	SOLV US	纽约	美国	258.00	135,568.92	0.02
464	Align Technology Inc	Align 科技股份有限公司	ALGN US	纳斯达克	美国	117.00	134,400.99	0.02
465	GoDaddy	GoDaddy	GDDY US	纽约	美国	232.00	134,121.33	0.02

	Inc	股份有限公司						
466	Bio-Techne Corp	Bio-technec 公司	TECH US	纳斯达克克	美国	274.00	131,846.08	0.02
467	Hasbro Inc	孩之宝	HAS US	纳斯达克克	美国	234.00	131,627.86	0.02
468	Charles River Laboratories International Inc	查里斯河实验室国际有限公司	CRL US	纽约	美国	85.00	131,294.74	0.02
469	Baxter International Inc	百特	BAX US	纽约	美国	902.00	130,977.97	0.02
470	Insulet Corp	Insulet 股份有限公司	PODD US	纳斯达克克	美国	122.00	126,509.06	0.01
471	AES Corp/The	爱伊斯公司	AES US	纽约	美国	1,247.00	124,510.20	0.01
472	Franklin Resources Inc	富兰克林资源	BEN US	纽约	美国	536.00	121,456.87	0.01
473	Skyworks Solutions Inc	思佳讯解决方案公司	SWKS US	纳斯达克克	美国	263.00	121,447.88	0.01
474	Jack Henry & Associates Inc	Jack Henry & Associates 公司	JKHY US	纳斯达克克	美国	125.00	117,266.67	0.01
475	BXP Inc	波士顿地产公司	BXP US	纽约	美国	259.00	116,972.37	0.01
476	Federal Realty Investment Trust	联邦房地产投资信托公司	FRT US	纽约	美国	138.00	116,021.77	0.01
477	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	挪威邮轮控股有限公司	NCLH US	纽约	美国	802.00	115,310.04	0.01
478	Builders FirstSource Inc	Builders FirstSource 股份有限公司	BLDR US	纽约	美国	188.00	114,574.59	0.01

479	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	MGM US	纽约	美国	336.00	109,411.39	0.01
480	Domino's Pizza Inc	达美乐披萨公司	DPZ US	纳斯达克	美国	54.00	108,880.14	0.01
481	Gartner Inc	Gartner 公司	IT US	纽约	美国	117.00	103,290.98	0.01
482	FactSet Research Systems Inc	FactSet 研究系统股份有限公司	FDS US	纽约	美国	64.00	100,291.32	0.01
483	Alexandria Real Estate Equities Inc	亚历山大房地产股份有限公司	ARE US	纽约	美国	274.00	98,627.96	0.01
484	Wynn Resorts Ltd	永利渡假村有限公司	WYNN US	纳斯达克	美国	147.00	97,206.73	0.01
485	Henry Schein Inc	亨利香恩公司	HSIC US	纳斯达克	美国	170.00	96,703.88	0.01
486	Universal Health Services Inc	Universal 保健服务股份有限公司	UHS US	纽约	美国	94.00	95,195.00	0.01
487	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 股份有限公司	TTD US	纳斯达克	美国	747.00	91,986.38	0.01
488	DaVita Inc	DaVita 股份有限公司	DVA US	纽约	美国	57.00	86,371.47	0.01
489	Hormel Foods Corp	荷美尔食品有限公司	HRL US	纽约	美国	510.00	86,213.73	0.01
490	A O Smith Corp	AO 史密斯公司	AOS US	纽约	美国	196.00	83,727.21	0.01
491	Mosaic Co/The	Mosaic 公司	MOS US	纽约	美国	556.00	80,243.57	0.01
492	Molson Coors Beverage Co	莫尔森库尔斯饮料公司	TAP US	纽约	美国	281.00	74,564.10	0.01

493	Erie Indemnity Co	伊利赔偿公司	ERIE US	纳斯达克	美国	44.00	71,848.18	0.01
494	Brown-Forman Corp	百富门公司	BF/B US	纽约	美国	295.00	53,545.59	0.01
495	Paramount Skydance Corp	Paramount Skydance 公司	PSKY US	纳斯达克	美国	551.00	37,002.67	0.00

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Marvell Technology Inc	MRVL US	3,209,971.66	0.40
2	Vertiv Holdings Co	VRT US	1,186,630.73	0.15
3	Lumentum Holdings Inc	LITE US	690,014.29	0.09
4	Flex Ltd	FLEX US	681,704.59	0.09
5	Coherent Corp	COHR US	615,267.55	0.08
6	Ciena Corp	CIEN US	497,443.74	0.06
7	Alphabet Inc	GOOG US	261,795.20	0.03
		GOOGL US	167,993.57	0.02
8	Casey's General Stores Inc	CASY US	333,363.94	0.04
9	Veeva Systems Inc	VEEV US	305,452.97	0.04
10	Devon Energy Corp	DVN US	288,902.89	0.04
11	Palo Alto Networks Inc	PANW US	243,988.66	0.03
12	EchoStar Corp	SATS US	179,849.69	0.02
13	Fifth Third Bancorp	FITB US	159,335.36	0.02
14	Intel Corp	INTC US	134,746.58	0.02
15	Huntington Bancshares Inc/OH	HBAN US	106,467.52	0.01
16	Amazon.com Inc	AMZN US	85,406.31	0.01
17	Sandisk Corp	SNDK US	67,900.86	0.01
18	Carnival Corp Ltd	CCL US	62,431.61	0.01
19	Seagate Technology Holdings PLC	STX US	59,647.06	0.01

20	Broadcom Inc	AVGO US	55,850.31	0.01
----	--------------	---------	-----------	------

- 注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。
- 2.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。

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	Apple Inc	AAPL US	617,842.63	0.08
2	NVIDIA Corp	NVDA US	603,416.09	0.08
3	Coterra Energy Inc	CTRA US	290,981.87	0.04
4	Microsoft Corp	MSFT US	265,335.48	0.03
5	Salesforce Inc	CRM US	261,217.97	0.03
6	JPMorgan Chase & Co	JPM US	228,681.97	0.03
7	Alphabet Inc	GOOGL US	129,368.97	0.02
		GOOG US	79,656.88	0.01
8	Hologic Inc	HOLX US	204,611.72	0.03
9	Exxon Mobil Corp	XOM US	182,293.77	0.02
10	Visa Inc	V US	151,385.61	0.02
11	Bank of America Corp	BAC US	150,729.03	0.02
12	Broadcom Inc	AVGO US	150,351.53	0.02
13	Citigroup Inc	C US	148,130.80	0.02
14	Dayforce Inc	DAY US	136,771.41	0.02
15	Caterpillar Inc	CAT US	116,265.47	0.01
16	Mastercard Inc	MA US	111,494.64	0.01
17	Eli Lilly & Co	LLY US	105,221.11	0.01
18	Amazon.com Inc	AMZN US	102,722.68	0.01
19	Wells Fargo & Co	WFC US	97,558.52	0.01
20	Match Group Inc	MTCH US	89,620.86	0.01

- 注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。
- 2.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。

7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	10,061,061.61
卖出收入（成交）总额	9,789,748.55

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Sep26	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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未发现有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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	6,980,092.29
2	应收清算款	44,132.45
3	应收股利	309,243.06
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	7,333,467.80

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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		标普 500ETF 联接基金	
		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
24,330	18,286.01	83,387,641.00	18.74%	265,333,274.00	59.64%	96,177,736.00	21.62%

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	8,100.00	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（2022 年 5 月 9 日）基金份额总额	247,898,651.00
本报告期期初基金份额总额	444,898,651.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	444,898,651.00

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、基金财产相关的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
China Galaxy International Financial Holdings Limited	1	-	-	-	-	-

Goldman Sachs And Co. LLC.	2	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co. Ltd	1	18,932,143.48	100.00%	2,535.79	100.00%	-
Haitong International Securities Co Ltd	1	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 民生	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商	-	-	180,0	100.00%	-	-	-	-

证券			00,00 0.00					
China Galaxy International Financial Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

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国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-01-06
2	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-01-07
3	关于旗下部分基金 2026 年 1 月 19 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-01-14
4	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-01-22
5	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-01-23
6	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-02-12
7	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-02-13
8	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-02-24
9	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-02-25
10	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-02-26
11	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-02
12	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-03
13	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-06
14	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-09
15	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级	《上海证券报》	2026-03-12

	市场交易价格溢价风险提示公告		
16	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-13
17	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-16
18	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-17
19	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-18
20	国泰基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-03-19
21	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-19
22	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-20
23	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-03-31
24	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-03-31
25	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-04-01
26	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
27	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-04-09
28	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
29	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-05-20
30	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-02

31	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-03
32	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-04
33	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-10
34	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-16
35	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-18
36	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-22
37	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-25
38	国泰基金管理有限公司关于国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	《上海证券报》	2026-06-26
39	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 3 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-06-30

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	129,165,248.00	-	32,987,512.00	96,177,736.00	21.62%

(QDII)							
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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