

# 国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                  |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰中证 A500 增强策略 ETF                                                               |
| 场内简称       | 中证 A500 增强 ETF 国泰                                                                |
| 基金主代码      | 159226                                                                           |
| 交易代码       | 159226                                                                           |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                           |
| 基金合同生效日    | 2025 年 5 月 20 日                                                                  |
| 报告期末基金份额总额 | 78,094,840.00 份                                                                  |
| 投资目标       | 本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股及优化组合管理，在注重风险控制的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略       | 1、股票投资策略<br>本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在                                            |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。在复制标的指数的基础上，综合运用超额收益模型、风险模型、成本模型选择具有较高投资价值的股票构建投资组合。本基金个股选择范围包括标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与标的指数成份股相关度高的股票等。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会，力求在有效跟踪标的指数的基础上获取超越标的指数的投资回报。在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.50%。</p> <p>（1）超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值，定价过高的资产应当考虑回避。</p> <p>其中，多因子量化系统基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、成长性因子、技术因子、流动性因子、分析师因子等多类对股票超额收益具有较强解释能力的因子进行构建。</p> <p>（2）风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括行业偏离度、风格偏离度、波动率等，力求将主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>（3）成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等预测本基金的交易成本，以减少交易对业绩造成的负影响。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。<br><br>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资基金策略；6、金融衍生品投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证 A500 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。                                                                                       |
| 基金管理人  | 国泰基金管理有限公司                                                                                                                            |
| 基金托管人  | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                          |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|----------------|-----------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 4,761,261.44                            |
| 2.本期利润         | 9,048,381.00                            |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1347                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 104,305,013.68                          |
| 5.期末基金份额净值     | 1.3356                                  |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 9.60%  | 1.39%     | 14.26%     | 1.41%         | -4.66% | -0.02% |
| 过去六个月      | 9.48%  | 1.28%     | 11.91%     | 1.29%         | -2.43% | -0.01% |
| 过去一年       | 31.12% | 1.11%     | 36.38%     | 1.14%         | -5.26% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.56% | 1.06%     | 38.72%     | 1.10%         | -5.16% | -0.04% |

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

国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2025 年 5 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为2025年5月20日，本基金在6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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务               | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|----|------------------|-------------|------------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                  | 任职日期        | 离任日期       |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 梁杏 | 本基金的基金经理、量化投资部总监 | 2025-05-20  | 2026-05-29 | 19 年   | <p>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</p> |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |                                                 |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|-------------------------------------------------|------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                 |            |   |     | <p>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。</p> |
| 刘昉元 | <p>国泰中证 2000ETF、国泰上证科创板综合 ETF、国泰中证 A500 增强策</p> | 2025-05-21 | - | 6 年 | <p>硕士研究生。曾任职于浙商基金管理有限公司。2022 年 7 月加入国泰基金，历任量化研究员、基金经理助理。2025 年 4 月起任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰中证 A500 增强策略交易</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|  |                                                                                                                                                                                      |  |  |  |                                                                                                                                                                                  |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 略<br>ETF、国<br>泰上证<br>科创板<br>芯片<br>ETF 发<br>起联<br>接、国<br>泰中证<br>港股通<br>汽车产<br>业主题<br>ETF、国<br>泰创业<br>板医药<br>卫生<br>ETF 发<br>起联<br>接、国<br>泰创业<br>板人工<br>智能<br>ETF 发<br>起联接<br>的基金<br>经理 |  |  |  | 型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板医药卫生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，2025 年 10 月起兼任国泰创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

2、证券从业的含义遵从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所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立

运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 5 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度，市场分化加剧，科技板块与非科技板块走势差异显著，AI 相关板块涨幅明显，其他板块大都出现不同程度回调。地缘政治方面，紧张局势较一季度有所缓和。中证 A500 指数在 4 月迎来一波大幅上涨，随后进入震荡阶段，科技与非科技方向走势出现严重分化。中证 A500 指数内科技权重相对较大，极端市场风格对超额收益的获取造成了一定影响。中证 A500 指数最终单季度录得涨幅 14.26%。

长期来看，国内经济仍处于复苏阶段，围绕人工智能展开的科技叙事仍在延续。经过四季度的调整后，前期涨幅较大板块的投资性价比有所提升，市场继续维持长期向好趋势。

作为指数增强型基金，本基金股票投资方面主要采取基于海量数据开发、高度自动化的指数增强量化投资策略，在将跟踪误差控制在目标范围内的基础上，力争获取超越基准指数的超额收益。

#### 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 9.60%，同期业绩比较基准收益率为 14.26%。

#### 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，随着宏观政策逐步落地，提振内需趋势进一步强化，市场风险偏好有望维持在较高位置。短期来看，经过前期大幅上涨后市场短期波动有所放大，估值也处于近几年相对高位。随着资金面逐步从增量市向存量市转变，指数层面出现系统性估值提升的概率相对不大，缺乏基本面支撑的个股可能面临较大调整压力。

市场波动维持高位的背景下，行业、个股间的分歧可能将进一步放大。但从中长期角度看，国内“稳增长”等政策红利有望延续，推动上市公司盈利改善，叠加市场当前较为宽松的流动性环境，中长期角度下市场或仍将有所表现，具备较好的中长期配置价值。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 103,442,747.17 | 99.08        |
|    | 其中：股票             | 103,442,747.17 | 99.08        |
| 2  | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 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  | 银行存款和结算备付金合计      | 963,407.56     | 0.92         |
| 7  | 其他各项资产            | —              | —            |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 8 | 合计 | 104,406,154.73 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | 1,218.00     | 0.00         |
| C  | 制造业              | 2,215,783.00 | 2.12         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,188.00     | 0.01         |
| E  | 建筑业              | 512,076.00   | 0.49         |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 508,686.00   | 0.49         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 761,188.48   | 0.73         |
| J  | 金融业              | 1,046,886.00 | 1.00         |
| 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          | 154,176.00   | 0.15         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 5,207,201.48 | 4.99         |

### 5.2.2 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | 601,828.00 | 0.58         |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| B | 采矿业              | 6,147,896.00  | 5.89  |
| C | 制造业              | 67,238,138.17 | 64.46 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,124,142.00  | 2.04  |
| E | 建筑业              | 547,575.00    | 0.52  |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,873,550.00  | 2.75  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 8,252,007.52  | 7.91  |
| J | 金融业              | 8,527,874.00  | 8.18  |
| K | 房地产业             | 92,586.00     | 0.09  |
| L | 租赁和商务服务业         | 7,125.00      | 0.01  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 1,486,334.00  | 1.42  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 336,490.00    | 0.32  |
| 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               | 98,235,545.69 | 94.18 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 3,400  | 4,318,000.00 | 4.14         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 9,500  | 3,733,595.00 | 3.58         |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 3,640  | 2,209,480.00 | 2.12         |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 2,700  | 2,200,500.00 | 2.11         |
| 5  | 688256 | 寒武纪  | 1,352  | 2,157,183.60 | 2.07         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 43,900 | 2,095,786.00 | 2.01         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 1,600  | 1,896,784.00 | 1.82         |
| 8  | 601899 | 紫金矿业 | 69,600 | 1,749,744.00 | 1.68         |
| 9  | 002475 | 立讯精密 | 23,100 | 1,626,240.00 | 1.56         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 10 | 000333 | 美的集团 | 21,300 | 1,608,789.00 | 1.54 |
|----|--------|------|--------|--------------|------|

### 5.3.2 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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 002222 | 福晶科技 | 5,900  | 544,452.00 | 0.52         |
| 2  | 002402 | 和而泰  | 20,300 | 524,349.00 | 0.50         |
| 3  | 600986 | 浙文互联 | 74,000 | 516,520.00 | 0.50         |
| 4  | 002163 | 海南发展 | 61,400 | 512,076.00 | 0.49         |
| 5  | 603162 | 海通发展 | 56,500 | 506,805.00 | 0.49         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 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。

#### 5.11.5.2 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |               |
|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 69,094,840.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 33,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 24,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | —             |
| 本报告期期末基金份额总额   | 78,094,840.00 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

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

基金托管人住所或办公场所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇二六年七月二十一日