国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 42
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 42
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
7.11 投资组合报告附注 57
8 基金份额持有人信息 58

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 盈利投资者数量占比 58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 58
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 58
9 开放式基金份额变动 59
10 重大事件揭示 59
10.1 基金份额持有人大会决议 59
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 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 59
10.4 基金投资策略的改变 59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 59
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 60
10.8 其他重大事件 61
11 影响投资者决策的其他重要信息 61
12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 国泰
基金主代码	159338
交易代码	159338
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,825,086,664.00 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	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照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。 2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、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。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其

	风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	倪蓥	刘强
	联系电话	021-31081600转	025-83387812
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95597
传真		021-31081800	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路228号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		200082	210009
法定代表人		周向勇	王会清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,572,757,089.28
本期利润	3,634,550,683.53
加权平均基金份额本期利润	0.1523
本期加权平均净值利润率	12.16%
本期基金份额净值增长率	12.53%

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	4,705,597,400.19
期末可供分配基金份额利润	0.2640
期末基金资产净值	23,952,076,104.39
期末基金份额净值	1.3437
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	34.37%

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	14.80%	1.40%	14.26%	1.41%	0.54%	-0.01%
过去六个月	12.53%	1.28%	11.91%	1.29%	0.62%	-0.01%
过去一年	38.58%	1.14%	36.38%	1.14%	2.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	34.37%	1.19%	60.39%	1.35%	-26.02%	-0.16%

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

国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2024 年 9 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日）

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 26 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		
黄岳	国泰中证生物医药 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证全指建筑材料 ETF、国泰中证科创创业 50ETF、国泰中证 500ETF、国泰中证消费电子主题 ETF、国泰中证动漫游戏 ETF、国泰中证港股通 50ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰中证新能源汽车 ETF、国泰中证 800 汽车与零部件 ETF、国泰中证光伏产业 ETF、国泰策略价值灵活配置混合、国泰中证 A500ETF、国泰恒生生物科技 ETF 的基金经理	2024-09-26	-	11 年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021 年 2 月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月至 2023 年 9 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 4 月任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月至 2024 年 10 月任国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月至 2025 年 2 月任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 11 月任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 4 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数

					证券投资基金和国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月至 2024 年 6 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金和国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2026 年 1 月起兼任国泰恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 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同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

一季度市场大幅波动，1 月上旬商业航天相关板块大幅上涨，带动市场投资热情升温，A 股成交量逼近 4 万亿元，随后随着相关方面不断降温，市场进入震荡格局。贵金属、化工等周期方向 1 月下旬连续大涨后快速回落，引发了市场的剧烈波动。随后随着美国、以色列、伊朗地缘风险升温，霍尔木兹海峡通行几近停滞。3 月中旬全球避险情绪迅速升温，A 股出现大幅调整。整个一季度呈现冲高回落走势。

二季度随着伊朗地缘风险缓和，市场触底回升。经济数据方面，出口延续高增，而消费、地产等方向承压。A 股 5-6 月波动大幅增大，科技和非科技方向走势严重分化，由于目前宽基指数内部科技权重相对较大，上证指数、中证 A500 等指数表现尚可，但全 A 中位数二季度跌幅明显，市场二八分化显著。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 12.53%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪中证 A500 指数，覆盖了 A 股 500 家龙头上市公司。相比现有跟踪大盘股的宽基指数，中证 A500 指数的编制规则更加合理，行业分布更加均衡，能够更好的表征 A 股核心资产的整体表现，具备较好的长期配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2026 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	144,114,196.71	156,202,450.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,930,008,028.44	37,307,699,176.93
其中：股票投资		23,928,533,009.04	37,307,699,176.93
基金投资		-	-
债券投资		1,475,019.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	263,702.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		24,074,122,225.15	37,464,165,330.29
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		233,883.63	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,968,311.21	3,492,036.54
应付托管费		989,437.07	1,164,012.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.61	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	117,854,488.24	100,761,155.34
负债合计		122,046,120.76	105,417,204.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	17,825,086,664.00	31,286,086,664.00
未分配利润	6.4.7.8	6,126,989,440.39	6,072,661,462.23
净资产合计		23,952,076,104.39	37,358,748,126.23
负债和净资产总计		24,074,122,225.15	37,464,165,330.29

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3437 元，基金份额总额 17,825,086,664.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,664,374,639.93	485,766,238.40
1.利息收入		37,256.37	55,329.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	37,256.37	55,329.45
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,574,727,623.07	-9,479,879.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,345,924,665.47	-267,846,105.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18.86	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	228,802,938.74	258,366,226.08
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	61,793,594.25	461,936,403.33
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	27,816,166.24	33,254,384.97
减：二、营业总支出		29,823,956.40	23,898,275.02
1．管理人报酬		22,294,326.91	17,850,066.00

2．托管费		7,431,442.35	5,950,021.95
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		0.07	-
8．其他费用	6.4.7.16	98,187.07	98,187.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**3,634,550,683.53**	**461,867,963.38**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**3,634,550,683.53**	**461,867,963.38**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,634,550,683.53	461,867,963.38

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	31,286,086,664.00	6,072,661,462.23	37,358,748,126.23
二、本期期初净资产	31,286,086,664.00	6,072,661,462.23	37,358,748,126.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,461,000,000.00	54,327,978.16	-13,406,672,021.84
（一）、综合收益总额	-	3,634,550,683.53	3,634,550,683.53
（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）	-13,461,000,000.00	-3,580,222,705.37	-17,041,222,705.37
其中：1.基金申购款	13,344,000,000.00	3,462,811,207.06	16,806,811,207.06
2.基金赎回款	-26,805,000,000.00	-7,043,033,912.43	-33,848,033,912.43

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	17,825,086,664.00	6,126,989,440.39	23,952,076,104.39
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	29,516,086,664.00	-1,364,078,172.29	28,152,008,491.71
二、本期期初净资产	29,516,086,664.00	-1,364,078,172.29	28,152,008,491.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,500,000,000.00	786,091,830.62	-9,713,908,169.38
（一）、综合收益总额	-	461,867,963.38	461,867,963.38
（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）	-10,500,000,000.00	324,223,867.24	-10,175,776,132.76
其中：1.基金申购款	9,567,000,000.00	-697,358,300.95	8,869,641,699.05
2.基金赎回款	-20,067,000,000.00	1,021,582,168.19	-19,045,417,831.81
（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	19,016,086,664.00	-577,986,341.67	18,438,100,322.33

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

国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1270 号《关于准予国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,000,000,515.00 元，基金合同于 2024 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,086,664.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,149.00 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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2024]第 831 号文审核同意，本基金 2,000,086,664.00 份基金份额于 2024 年 10 月 15 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》和《国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 A500 指数收益率。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“国泰中证 A500ETF 发起联接”)。国泰中证 A500ETF 发起联接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 年半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,367,982.75
等于：本金	2,367,108.07
加：应计利息	874.68
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	141,746,213.96
等于：本金	141,744,295.09
加：应计利息	1,918.87
合计	144,114,196.71

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	21,302,832,785.34	-	23,928,533,009.04	2,625,700,223.70
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	1,475,000.00	19.40	1,475,019.40	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,475,000.00	19.40	1,475,019.40	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		21,304,307,785.34	19.40	23,930,008,028.44	2,625,700,223.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	98,187.07
其他应付款	738,986.35
可退替代款	1,532,413.57
应付替代款	115,484,901.25
合计	117,854,488.24

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

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

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,286,086,664.00	31,286,086,664.00
本期申购	13,344,000,000.00	13,344,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-26,805,000,000.00	-26,805,000,000.00
本期末	17,825,086,664.00	17,825,086,664.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,230,773,198.65	2,841,888,263.58	6,072,661,462.23
本期期初	3,230,773,198.65	2,841,888,263.58	6,072,661,462.23
本期利润	3,572,757,089.28	61,793,594.25	3,634,550,683.53
本期基金份额交易产生的变动数	-2,097,932,887.74	-1,482,289,817.63	-3,580,222,705.37
其中：基金申购款	2,488,660,959.84	974,150,247.22	3,462,811,207.06
基金赎回款	-4,586,593,847.58	-2,456,440,064.85	-7,043,033,912.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,705,597,400.19	1,421,392,040.20	6,126,989,440.39

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	12,789.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	24,466.56
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	37,256.37

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,184,196,486.72
股票投资收益——赎回差价收入	2,161,728,178.75
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,345,924,665.47

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	20,867,174,690.95
减：卖出股票成本总额	19,664,183,942.41
减：交易费用	18,794,261.82
买卖股票差价收入	1,184,196,486.72

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	33,848,033,912.43
减：现金支付赎回款总额	17,507,645,619.43
减：赎回股票成本总额	14,178,660,114.25
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,161,728,178.75

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	18.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	18.86

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	228,802,938.74
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	228,802,938.74

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	61,793,594.25
——股票投资	61,793,594.25
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	61,793,594.25

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	27,816,166.24
合计	27,816,166.24

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	38,679.70
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	98,187.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
国泰中证 A500 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 A500ETF 发起联接 ”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	33,438,672,767.08	100.00%	18,976,317,275.99	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	1,475,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	6,216,165.29	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			

	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	3,527,852.20	100.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费等手续费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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	22,294,326.91	17,850,066.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,938,456.56	2,826,309.68
应支付基金管理人的净管理费	19,355,870.35	15,023,756.32

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.15% / 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	7,431,442.35	5,950,021.95

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.05% / 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

份额单位：份

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

期初持有的基金份额	359,232,300.00	-
期间申购/买入总份额	381,726,000.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	740,958,300.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.16%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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
国泰中证 A500ETF 发起联接	1,139,697,400.00	6.39%	2,256,264,400.00	7.21%
华泰证券	428,987,624.00	2.41%	862,927,726.00	2.76%

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
华泰证券	2,367,982.75	12,789.81	1,173,791.35	9,053.15

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰证券保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

2026 年度上半年，本基金参与了华泰联合证券有限责任公司(托管人华泰证券股份有限公司的关联方)主承的芜湖埃泰克汽车电子股份有限公司首次公开发行人民币普通股（A 股）的网下申购。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601088	中国神华	2026-04-09	1-6 个月（含）	非公开发行流通受限	43.70	37.71	1,372,997.00	59,999,968.90	51,775,716.87	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	114.28	676.94	10,828.00	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.62	57.42	44,370.00	382,469.40	2,547,725.40	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.06	48.56	16,470.00	478,618.20	799,783.20	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.11	10.11	58,873.00	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月以上	新股锁定流通	46.08	463.33	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-

				受限						
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	网下中签流通受限	10.11	10.11	25,231.00	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-

001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月以上	新股锁定流通受限	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	53.26	58.74	285.00	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月以上	新股锁定流通受限	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
30168	固德	2026-0	6 个月	新股	58.00	112.16	117.00	6,786.	13,122	-

0	电材	2-27	以上	锁定流通受限				00	.72	
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月以上	新股锁定流通受限	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月以上	新股锁定流通受限	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月以上	新股锁定流通受限	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-25	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	14,750.00	1,475,000.00	1,475,019.40	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	146,061.00	45,853,109.63	121,522,752.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在消除所公布事项的重大影响后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 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华泰证券开立于具有基金托管资格的银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.01%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	144,114,196.71	-	-	-	144,114,196.71
交易性金融资产	-	-	1,475,019.40	23,928,533,009.04	23,930,008,028.44
资产总计	144,114,196.71	-	1,475,019.40	23,928,533,009.04	24,074,122,225.15
负债					
应付清算款	-	-	-	233,883.63	233,883.63
应付管理人报酬	-	-	-	2,968,311.21	2,968,311.21
应付托管费	-	-	-	989,437.07	989,437.07
应交税费	-	-	-	0.61	0.61
其他负债	-	-	-	117,854,488.24	117,854,488.24
负债总计	-	-	-	122,046,120.76	122,046,120.76
利率敏感度缺口	144,114,196.71	-	1,475,019.40	23,806,486,888.28	23,952,076,104.39
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	156,202,450.91	-	-	-	156,202,450.91
交易性金融资产	-	-	-	37,307,699,176.93	37,307,699,176.93
应收清算款	-	-	-	263,702.45	263,702.45
资产总计	156,202,450.91	-	-	37,307,962,879.38	37,464,165,330.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,492,036.54	3,492,036.54
应付托管费	-	-	-	1,164,012.18	1,164,012.18

其他负债	-	-	-	100,761,155.34	100,761,155.34
负债总计	-	-	-	105,417,204.06	105,417,204.06
利率敏感度缺口	156,202,450.91	-	-	37,202,545,675.32	37,358,748,126.23

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 0.01%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金资产

		产净值比例（%）		净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	23,928,533,009.04	99.90	37,307,699,176.93	99.86
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,928,533,009.04	99.90	37,307,699,176.93	99.86

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 1,194,923,478.56	增加约 1,866,724,056.06
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,194,923,478.56	减少约 1,866,724,056.06

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	23,741,421,346.74	37,126,466,214.95

第二层次	123,848,062.84	174,448,283.20
第三层次	64,738,618.86	6,784,678.78
合计	23,930,008,028.44	37,307,699,176.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2026 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 16,806,811,207.06 元，其中包括以股票支付的申购款 7,766,882,060.72 元和以现金支付的申购款 9,039,929,146.34 元(于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 8,869,641,699.05 元，其中包括以股票支付的申购款 3,631,645,996.84 元和以现金支付的申购款 5,237,995,702.21 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	23,928,533,009.04	99.40
	其中：股票	23,928,533,009.04	99.40

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,475,019.40	0.01
	其中：债券	1,475,019.40	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	144,114,196.71	0.60
8	其他各项资产	-	-
9	合计	24,074,122,225.15	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	75,274,376.42	0.31
B	采矿业	982,256,144.98	4.10
C	制造业	16,904,392,358.01	70.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	521,777,766.00	2.18
E	建筑业	291,635,720.20	1.22
F	批发和零售业	185,179,880.07	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	532,656,709.17	2.22
H	住宿和餐饮业	11,242,210.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,341,018,209.53	5.60

J	金融业	2,318,726,802.90	9.68
K	房地产业	133,917,629.35	0.56
L	租赁和商务服务业	172,888,137.21	0.72
M	科学研究和技术服务业	285,831,866.65	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	41,325,505.66	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,914,819.60	0.03
Q	卫生和社会工作	46,925,877.42	0.20
R	文化、体育和娱乐业	18,222,392.40	0.08
S	综合	43,216,002.66	0.18
	合计	23,914,402,408.23	99.84

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	13,098,653.15	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,989,121.85	0.06

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	806,450	1,024,191,500.00	4.28
2	300750	宁德时代	1,909,547	750,471,066.47	3.13
3	300502	新易盛	1,005,054	610,067,778.00	2.55
4	600519	贵州茅台	449,955	533,417,152.95	2.23
5	603986	兆易创新	481,200	392,178,000.00	1.64
6	601318	中国平安	7,695,447	367,380,639.78	1.53
7	688256	寒武纪	228,468	364,532,117.40	1.52
8	600036	招商银行	8,933,000	317,121,500.00	1.32
9	601899	紫金矿业	11,894,400	299,025,216.00	1.25
10	002371	北方华创	310,323	274,499,312.88	1.15
11	000333	美的集团	3,506,576	264,851,685.28	1.11
12	002475	立讯精密	3,682,951	259,279,750.40	1.08
13	688008	澜起科技	824,756	255,591,884.40	1.07
14	688012	中微公司	536,088	251,157,228.00	1.05
15	688041	海光信息	667,465	247,162,289.50	1.03
16	002384	东山精密	923,219	242,206,504.65	1.01
17	600900	长江电力	8,826,900	233,648,043.00	0.98
18	688981	中芯国际	1,445,672	229,601,627.04	0.96
19	000725	京东方 A	26,200,800	227,422,944.00	0.95
20	603259	药明康德	1,785,917	222,364,525.67	0.93
21	600030	中信证券	7,045,605	202,420,231.65	0.85
22	601166	兴业银行	12,222,536	202,405,196.16	0.85
23	300059	东方财富	9,137,860	186,229,586.80	0.78
24	600183	生益科技	1,050,902	182,226,406.80	0.76
25	600276	恒瑞医药	3,224,300	167,792,572.00	0.70
26	300274	阳光电源	1,046,530	166,419,200.60	0.69
27	601398	工商银行	23,335,700	164,983,399.00	0.69
28	300408	三环集团	966,605	161,326,374.50	0.67

29	002594	比亚迪	1,962,292	156,394,672.40	0.65
30	600487	亨通光电	1,424,800	155,787,632.00	0.65
31	300476	胜宏科技	439,182	152,145,820.26	0.64
32	601211	国泰海通	8,156,500	148,448,300.00	0.62
33	002463	沪电股份	969,925	148,204,540.00	0.62
34	300394	天孚通信	471,837	142,815,623.16	0.60
35	688498	源杰科技	72,426	136,595,436.00	0.57
36	688525	佰维存储	274,161	135,635,671.53	0.57
37	000988	华工科技	723,735	133,608,718.35	0.56
38	301308	江波龙	184,500	129,851,100.00	0.54
39	600176	中国巨石	1,732,600	126,271,888.00	0.53
40	601288	农业银行	20,750,400	125,954,928.00	0.53
41	601328	交通银行	19,267,940	123,892,854.20	0.52
42	000651	格力电器	3,242,449	121,591,837.50	0.51
43	688072	拓荆科技	146,061	121,522,752.00	0.51
44	600522	中天科技	1,971,800	119,648,824.00	0.50
45	688521	芯原股份	305,580	113,412,961.20	0.47
46	603019	中科曙光	1,054,600	113,084,758.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	6,301,500	110,591,325.00	0.46
48	600150	中国船舶	3,262,625	110,244,098.75	0.46
49	600887	伊利股份	4,597,500	110,156,100.00	0.46
50	300604	长川科技	318,500	108,742,270.00	0.45
51	600584	长电科技	1,032,100	106,873,955.00	0.45
52	000338	潍柴动力	3,885,600	105,882,600.00	0.44
53	000858	五 粮 液	1,400,721	103,653,354.00	0.43
54	688347	华虹宏力	296,106	99,580,447.80	0.42
55	601816	京沪高铁	21,161,700	95,862,501.00	0.40
56	688120	华海清科	288,131	92,830,045.58	0.39
57	600309	万华化学	1,356,100	92,770,801.00	0.39
58	300124	汇川技术	1,369,294	90,825,271.02	0.38
59	002916	深南电路	197,910	90,622,989.00	0.38
60	002415	海康威视	2,647,950	90,559,890.00	0.38
61	002281	光迅科技	347,689	89,335,211.66	0.37
62	002008	大族激光	588,950	88,407,284.50	0.37
63	600111	北方稀土	1,827,000	87,787,350.00	0.37
64	000100	TCL 科技	14,979,423	87,180,241.86	0.36
65	000063	中兴通讯	2,321,053	83,998,908.07	0.35
66	300857	协创数据	244,200	83,003,580.00	0.35
67	600000	浦发银行	9,616,666	82,799,494.26	0.35
68	300136	信维通信	690,106	82,295,140.50	0.34
69	600089	特变电工	3,649,100	82,104,750.00	0.34
70	601857	中国石油	9,353,500	81,188,380.00	0.34
71	002028	思源电气	448,000	77,504,000.00	0.32
72	300433	蓝思科技	1,437,297	77,125,357.02	0.32

73	601088	中国神华	1,983,197	75,597,924.87	0.32
74	600031	三一重工	4,278,300	73,929,024.00	0.31
75	300475	香农芯创	239,100	71,730,000.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	1,099,001	71,468,035.03	0.30
77	002050	三花智控	1,613,650	70,726,279.50	0.30
78	601601	中国太保	2,472,500	70,515,700.00	0.29
79	000001	平安银行	7,000,081	70,350,814.05	0.29
80	000792	盐湖股份	2,297,438	69,359,653.22	0.29
81	300223	北京君正	277,025	68,951,522.50	0.29
82	002714	牧原股份	1,970,558	68,949,824.42	0.29
83	600549	厦门钨业	802,900	68,407,080.00	0.29
84	002353	杰瑞股份	442,600	67,496,500.00	0.28
85	002156	通富微电	883,945	67,064,907.15	0.28
86	600406	国电南瑞	2,895,281	66,157,170.85	0.28
87	601668	中国建筑	14,914,000	64,726,760.00	0.27
88	000657	中钨高新	657,600	62,945,472.00	0.26
89	002436	兴森科技	1,226,048	62,467,145.60	0.26
90	601919	中远海控	4,534,100	60,122,166.00	0.25
91	002602	世纪华通	4,255,600	60,003,960.00	0.25
92	601988	中国银行	10,343,800	59,166,536.00	0.25
93	300760	迈瑞医疗	432,129	58,696,082.07	0.25
94	600660	福耀玻璃	1,157,900	58,404,476.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	549,800	58,262,306.00	0.24
96	601728	中国电信	11,196,600	58,110,354.00	0.24
97	603501	豪威集团	611,924	58,040,991.40	0.24
98	601012	隆基绿能	4,372,600	57,368,512.00	0.24
99	601225	陕西煤业	2,797,800	56,935,230.00	0.24
100	002230	科大讯飞	1,387,185	56,652,635.40	0.24
101	600941	中国移动	647,300	55,751,949.00	0.23
102	600690	海尔智家	2,700,200	55,111,082.00	0.23
103	002352	顺丰控股	1,726,686	53,976,204.36	0.23
104	601985	中国核电	5,941,100	53,648,133.00	0.22
105	002460	赣锋锂业	816,729	53,414,076.60	0.22
106	688777	中控技术	451,956	53,104,830.00	0.22
107	603799	华友钴业	1,097,800	52,979,828.00	0.22
108	002709	天赐材料	1,027,143	52,825,964.49	0.22
109	300757	罗博特科	85,300	52,800,700.00	0.22
110	300033	同花顺	218,900	52,754,900.00	0.22
111	002938	鹏鼎控股	499,035	52,588,308.30	0.22
112	000977	浪潮信息	744,056	52,083,920.00	0.22
113	600160	巨化股份	971,200	51,483,312.00	0.21
114	300442	润泽科技	592,022	49,179,267.54	0.21
115	002851	麦格米特	291,500	48,732,970.00	0.20
116	000425	徐工机械	5,905,059	47,771,927.31	0.20

117	002202	金风科技	1,994,546	47,669,649.40	0.20
118	688126	沪硅产业	1,194,889	47,664,122.21	0.20
119	000938	紫光股份	1,651,497	47,662,203.42	0.20
120	601600	中国铝业	5,732,700	47,122,794.00	0.20
121	600938	中国海油	1,729,800	46,964,070.00	0.20
122	600028	中国石化	10,500,740	46,833,300.40	0.20
123	600460	士兰微	842,469	46,049,355.54	0.19
124	300346	南大光电	496,742	46,023,146.30	0.19
125	002600	领益智造	2,643,500	45,838,290.00	0.19
126	002466	天齐锂业	747,418	45,831,671.76	0.19
127	601766	中国中车	8,780,800	45,660,160.00	0.19
128	600050	中国联通	11,327,000	45,308,000.00	0.19
129	300567	精测电子	142,400	45,226,240.00	0.19
130	300661	圣邦股份	310,838	44,599,036.24	0.19
131	002837	英维克	551,968	43,914,574.08	0.18
132	002080	中材科技	482,700	43,443,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	485,258	43,066,647.50	0.18
134	002185	华天科技	1,918,845	42,809,431.95	0.18
135	002407	多氟多	847,480	42,568,920.40	0.18
136	601628	中国人寿	1,202,100	42,494,235.00	0.18
137	688002	睿创微纳	273,225	42,265,175.25	0.18
138	002138	顺络电子	577,700	42,229,870.00	0.18
139	002179	中航光电	913,493	42,203,376.60	0.18
140	000568	泸州老窖	531,660	41,214,283.20	0.17
141	601100	恒立液压	381,150	40,996,494.00	0.17
142	601872	招商轮船	2,331,400	40,962,698.00	0.17
143	600879	航天电子	1,907,100	40,602,159.00	0.17
144	300395	菲利华	302,053	40,393,547.69	0.17
145	002241	歌尔股份	1,788,913	40,304,209.89	0.17
146	603288	海天味业	1,211,026	40,157,622.16	0.17
147	601006	大秦铁路	8,583,500	39,569,935.00	0.17
148	300390	天华新能	421,563	39,420,356.13	0.16
149	000408	藏格矿业	567,414	39,333,138.48	0.16
150	601658	邮储银行	7,947,300	39,180,189.00	0.16
151	688017	绿的谐波	93,269	38,973,384.34	0.16
152	605117	德业股份	364,873	38,742,215.14	0.16
153	688469	芯联集成	3,637,840	38,597,482.40	0.16
154	600905	三峡能源	10,343,700	38,375,127.00	0.16
155	002625	光启技术	1,250,234	37,907,094.88	0.16
156	600489	中金黄金	2,096,024	37,833,233.20	0.16
157	688396	华润微	387,376	37,788,528.80	0.16
158	601888	中国中免	703,400	37,779,614.00	0.16
159	000630	铜陵有色	5,795,600	36,860,016.00	0.15
160	600893	航发动力	958,800	36,760,392.00	0.15

161	688271	联影医疗	360,348	36,478,028.04	0.15
162	600010	包钢股份	16,349,400	36,459,162.00	0.15
163	600673	东阳光	1,085,327	36,445,280.66	0.15
164	601127	赛力斯	587,500	35,984,375.00	0.15
165	688111	金山办公	168,755	35,953,252.75	0.15
166	300058	蓝色光标	2,586,611	35,591,767.36	0.15
167	002273	水晶光电	1,002,479	35,567,954.92	0.15
168	601689	拓普集团	626,601	35,352,828.42	0.15
169	300037	新宙邦	380,600	35,338,710.00	0.15
170	002027	分众传媒	7,276,615	35,218,816.60	0.15
171	600118	中国卫星	426,600	35,002,530.00	0.15
172	300751	迈为股份	121,739	34,386,397.94	0.14
173	600019	宝钢股份	6,301,300	34,216,059.00	0.14
174	600760	中航沈飞	821,460	33,762,006.00	0.14
175	000426	兴业银锡	1,020,724	33,643,063.04	0.14
176	000807	云铝股份	1,498,813	33,183,719.82	0.14
177	601168	西部矿业	1,200,200	32,573,428.00	0.14
178	300450	先导智能	798,046	32,496,433.12	0.14
179	600104	上汽集团	3,322,400	32,426,624.00	0.14
180	600362	江西铜业	747,700	32,375,410.00	0.14
181	600989	宝丰能源	1,591,800	32,361,294.00	0.14
182	601727	上海电气	4,557,200	31,900,400.00	0.13
183	600875	东方电气	1,102,800	31,727,556.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	1,202,600	31,652,432.00	0.13
185	688099	晶晨股份	306,569	31,545,950.10	0.13
186	002001	新 和 成	1,108,428	31,501,523.76	0.13
187	605589	圣泉集团	487,600	30,996,732.00	0.13
188	002422	科伦药业	803,800	30,962,376.00	0.13
189	601390	中国中铁	7,390,800	30,819,636.00	0.13
190	600667	太极实业	1,055,200	30,790,736.00	0.13
191	600885	宏发股份	889,280	30,671,267.20	0.13
192	002738	中矿资源	518,340	30,576,876.60	0.13
193	000960	锡业股份	711,300	30,365,397.00	0.13
194	600547	山东黄金	1,306,000	30,155,540.00	0.13
195	600795	国电电力	6,449,300	30,118,231.00	0.13
196	002126	银轮股份	604,300	30,094,140.00	0.13
197	600392	盛和资源	1,010,700	30,088,539.00	0.13
198	000538	云南白药	633,344	30,001,505.28	0.13
199	000831	中国稀土	533,800	29,620,562.00	0.12
200	600585	海螺水泥	1,734,300	29,396,385.00	0.12
201	601669	中国电建	6,241,600	29,335,520.00	0.12
202	600418	江淮汽车	1,125,300	29,066,499.00	0.12
203	300316	晶盛机电	473,301	28,587,380.40	0.12
204	002648	卫星化学	1,216,524	28,576,148.76	0.12

205	600141	兴发集团	605,700	28,449,729.00	0.12
206	002812	恩捷股份	424,505	28,403,629.55	0.12
207	002129	TCL 中环	2,328,583	27,989,567.66	0.12
208	600096	云天化	917,800	27,901,120.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	3,372,635	27,857,965.10	0.12
210	301358	湖南裕能	363,586	27,585,269.82	0.12
211	601179	中国西电	1,845,706	27,537,933.52	0.11
212	600346	恒力石化	1,525,000	27,007,750.00	0.11
213	601868	中国能建	10,098,000	26,961,660.00	0.11
214	300782	卓胜微	246,040	26,961,063.20	0.11
215	600482	中国动力	820,900	26,925,520.00	0.11
216	002195	岩山科技	4,080,495	26,686,437.30	0.11
217	000066	中国长城	1,392,221	26,521,810.05	0.11
218	600497	驰宏锌锗	2,188,200	26,499,102.00	0.11
219	002558	巨人网络	956,484	26,360,699.04	0.11
220	300418	昆仑万维	648,783	26,184,881.88	0.11
221	600580	卧龙电驱	789,525	26,133,277.50	0.11
222	600066	宇通客车	962,200	25,796,582.00	0.11
223	000625	长安汽车	3,583,009	25,690,174.53	0.11
224	600426	华鲁恒升	1,065,630	25,489,869.60	0.11
225	600157	永泰能源	15,815,400	25,462,794.00	0.11
226	600221	海航控股	18,583,200	25,087,320.00	0.10
227	000157	中联重科	3,597,299	25,073,174.03	0.10
228	600895	张江高科	672,100	25,035,725.00	0.10
229	002532	天山铝业	2,330,000	25,000,900.00	0.10
230	688036	传音控股	416,760	24,568,002.00	0.10
231	600711	盛屯矿业	2,225,400	24,412,638.00	0.10
232	002340	格林美	3,687,200	24,372,392.00	0.10
233	605499	东鹏饮料	196,597	24,265,967.71	0.10
234	000933	神火股份	1,140,480	24,178,176.00	0.10
235	600011	华能国际	3,184,800	24,172,632.00	0.10
236	600048	保利发展	5,191,600	24,037,108.00	0.10
237	600436	片仔癀	219,260	23,960,732.80	0.10
238	600143	金发科技	1,543,500	23,847,075.00	0.10
239	300803	指南针	258,300	23,678,361.00	0.10
240	002821	凯莱英	146,000	23,652,000.00	0.10
241	600438	通威股份	1,946,800	23,575,748.00	0.10
242	300017	网宿科技	1,802,400	23,449,224.00	0.10
243	600115	中国东航	6,149,300	23,428,833.00	0.10
244	002236	大华股份	1,414,130	23,319,003.70	0.10
245	002493	荣盛石化	2,165,137	23,275,222.75	0.10
246	002131	利欧股份	4,885,523	23,206,234.25	0.10
247	600570	恒生电子	1,087,200	23,037,768.00	0.10
248	600886	国投电力	1,727,900	22,998,349.00	0.10

249	002456	欧菲光	2,414,700	22,843,062.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	1,874,000	22,694,140.00	0.09
251	688047	龙芯中科	145,581	22,517,013.27	0.09
252	601233	桐昆股份	1,033,700	22,379,605.00	0.09
253	603659	璞泰来	768,100	22,221,133.00	0.09
254	300339	润和软件	575,486	22,161,965.86	0.09
255	003816	中国广核	5,667,700	22,160,707.00	0.09
256	688213	思特威	205,825	22,037,682.75	0.09
257	601058	赛轮轮胎	1,905,300	21,968,109.00	0.09
258	601360	三六零	2,508,000	21,794,520.00	0.09
259	000301	东方盛虹	1,900,226	21,757,587.70	0.09
260	600026	中远海能	1,200,900	21,544,146.00	0.09
261	300759	康龙化成	743,100	21,497,883.00	0.09
262	002074	国轩高科	780,500	21,471,555.00	0.09
263	688578	艾力斯	195,619	21,361,594.80	0.09
264	688235	百济神州	83,829	21,343,701.69	0.09
265	002555	三七互娱	1,111,513	20,974,250.31	0.09
266	600009	上海机场	900,600	20,803,860.00	0.09
267	688122	西部超导	331,100	20,796,391.00	0.09
268	300438	鹏辉能源	249,800	20,695,930.00	0.09
269	600196	复星医药	919,600	20,663,412.00	0.09
270	000768	中航西飞	1,002,724	20,535,787.52	0.09
271	000975	山金国际	1,196,500	20,340,500.00	0.08
272	601111	中国国航	3,359,200	20,323,160.00	0.08
273	002472	双环传动	487,742	20,246,170.42	0.08
274	300001	特锐德	533,900	20,197,437.00	0.08
275	300207	欣旺达	1,061,394	20,155,872.06	0.08
276	002517	恺英网络	1,238,200	20,120,750.00	0.08
277	600415	小商品城	1,980,300	20,119,848.00	0.08
278	600674	川投能源	1,415,500	20,057,635.00	0.08
279	600029	南方航空	3,868,900	20,040,902.00	0.08
280	603129	春风动力	77,800	19,901,240.00	0.08
281	002601	龙佰集团	1,205,500	19,866,640.00	0.08
282	002128	电投能源	855,740	19,784,708.80	0.08
283	300458	全志科技	501,024	19,770,407.04	0.08
284	601186	中国铁建	3,322,400	19,768,280.00	0.08
285	600219	南山铝业	4,951,200	19,755,288.00	0.08
286	601877	正泰电器	778,900	19,527,023.00	0.08
287	600233	圆通速递	1,233,203	19,422,947.25	0.08
288	002595	豪迈科技	416,705	19,418,453.00	0.08
289	601117	中国化学	2,632,100	19,345,935.00	0.08
290	300115	长盈精密	690,000	19,278,600.00	0.08
291	301236	软通动力	445,400	18,907,230.00	0.08
292	600372	中航机载	1,736,167	18,837,411.95	0.08

293	002155	湖南黄金	788,541	18,822,473.67	0.08
294	600839	四川长虹	2,668,700	18,627,526.00	0.08
295	002465	海格通信	1,439,600	18,383,692.00	0.08
296	300454	深信服	189,000	18,181,800.00	0.08
297	300568	星源材质	966,200	18,087,264.00	0.08
298	000963	华东医药	633,800	17,822,456.00	0.07
299	600741	华域汽车	1,143,300	17,744,016.00	0.07
300	300347	泰格医药	369,337	17,728,176.00	0.07
301	000547	航天发展	923,219	17,679,643.85	0.07
302	002920	德赛西威	216,900	17,677,350.00	0.07
303	603650	彤程新材	180,300	17,665,794.00	0.07
304	688506	百利天恒	59,812	17,586,522.36	0.07
305	300024	机器人	899,860	17,394,293.80	0.07
306	002130	沃尔核材	901,400	17,090,544.00	0.07
307	688676	金盘科技	200,113	16,937,564.32	0.07
308	300012	华测检测	1,218,600	16,889,796.00	0.07
309	002497	雅化集团	827,700	16,860,249.00	0.07
310	688331	荣昌生物	128,629	16,755,213.54	0.07
311	001979	招商蛇口	2,596,829	16,697,610.47	0.07
312	002432	九安医疗	236,166	16,692,212.88	0.07
313	000878	云南铜业	1,050,515	16,682,178.20	0.07
314	002271	东方雨虹	1,389,050	16,488,023.50	0.07
315	300083	创世纪	1,205,172	16,414,442.64	0.07
316	300866	安克创新	156,854	16,391,243.00	0.07
317	002414	高德红外	1,236,000	16,389,360.00	0.07
318	300496	中科创达	264,641	16,352,167.39	0.07
319	000034	神州数码	586,797	16,283,616.75	0.07
320	601021	春秋航空	357,000	16,272,060.00	0.07
321	002444	巨星科技	516,443	16,061,377.30	0.07
322	000661	长春高新	238,910	15,911,406.00	0.07
323	603979	金诚信	269,400	15,902,682.00	0.07
324	300474	景嘉微	261,031	15,787,154.88	0.07
325	300763	锦浪科技	174,024	15,723,068.40	0.07
326	000733	振华科技	276,963	15,687,184.32	0.07
327	688266	泽璟制药	133,889	15,619,490.74	0.07
328	601319	中国人保	2,289,300	15,475,668.00	0.06
329	600699	均胜电子	706,600	15,269,626.00	0.06
330	300748	金力永磁	494,326	15,249,957.10	0.06
331	002756	永兴材料	269,240	15,249,753.60	0.06
332	601615	明阳智能	1,308,400	15,138,188.00	0.06
333	002078	太阳纸业	1,207,000	15,075,430.00	0.06
334	300073	当升科技	313,700	15,070,148.00	0.06
335	002025	航天电器	197,300	15,038,206.00	0.06
336	300142	沃森生物	1,155,679	15,012,270.21	0.06

337	300432	富临精工	744,300	14,952,987.00	0.06
338	601677	明泰铝业	891,200	14,793,920.00	0.06
339	601800	中国交建	2,578,000	14,720,380.00	0.06
340	300919	中伟新材	335,815	14,691,906.25	0.06
341	600039	四川路桥	1,878,700	14,691,434.00	0.06
342	603606	东方电缆	353,180	14,660,501.80	0.06
343	000002	万　科Ａ	4,946,707	14,642,252.72	0.06
344	603087	甘李药业	257,200	14,598,672.00	0.06
345	000423	东阿阿胶	319,518	14,493,336.48	0.06
346	002252	上海莱士	3,338,540	14,489,263.60	0.06
347	600226	亨通股份	1,500,600	14,390,754.00	0.06
348	688608	恒玄科技	86,047	14,386,197.93	0.06
349	300724	捷佳伟创	203,620	14,375,572.00	0.06
350	688599	天合光能	1,017,085	14,361,240.20	0.06
351	688169	石头科技	151,005	14,340,944.85	0.06
352	688223	晶科能源	2,970,530	14,110,017.50	0.06
353	600588	用友网络	1,499,800	13,768,164.00	0.06
354	002064	华峰化学	1,430,842	13,578,690.58	0.06
355	001965	招商公路	1,471,700	13,480,772.00	0.06
356	601633	长城汽车	891,638	13,454,817.42	0.06
357	688390	固德威	123,867	13,440,808.17	0.06
358	000786	北新建材	734,300	13,283,487.00	0.06
359	002831	裕同科技	371,712	13,218,078.72	0.06
360	688180	君实生物	387,009	13,088,644.38	0.05
361	300677	英科医疗	326,000	12,769,420.00	0.05
362	000519	中兵红箭	605,200	12,751,564.00	0.05
363	002294	信立泰	398,125	12,696,206.25	0.05
364	600516	方大炭素	2,052,000	12,660,840.00	0.05
365	688188	柏楚电子	118,569	12,651,312.30	0.05
366	601618	中国中冶	5,180,200	12,639,688.00	0.05
367	603806	福斯特	752,200	12,629,438.00	0.05
368	600177	雅戈尔	1,672,400	12,593,172.00	0.05
369	300972	万辰集团	72,000	12,485,520.00	0.05
370	688065	凯赛生物	260,902	12,484,160.70	0.05
371	302132	中航成飞	213,600	12,457,152.00	0.05
372	601607	上海医药	808,200	12,446,280.00	0.05
373	002176	江特电机	1,242,000	12,432,420.00	0.05
374	300699	光威复材	425,862	12,200,946.30	0.05
375	603260	合盛硅业	251,700	12,147,042.00	0.05
376	000623	吉林敖东	681,600	12,084,768.00	0.05
377	000617	中油资本	1,821,400	12,003,026.00	0.05
378	002085	万丰奥威	1,080,188	11,979,284.92	0.05
379	300832	新产业	283,207	11,894,694.00	0.05
380	300558	贝达药业	182,300	11,862,261.00	0.05

381	002318	久立特材	495,141	11,833,869.90	0.05
382	002459	晶澳科技	1,444,820	11,703,042.00	0.05
383	300251	光线传媒	1,049,700	11,641,173.00	0.05
384	002065	东华软件	1,625,600	11,606,784.00	0.05
385	600499	科达制造	835,900	11,535,420.00	0.05
386	600085	同仁堂	498,100	11,511,091.00	0.05
387	002266	浙富控股	2,274,000	11,506,440.00	0.05
388	300342	天银机电	243,500	11,444,500.00	0.05
389	002044	美年健康	2,275,088	11,443,692.64	0.05
390	688472	阿特斯	1,045,745	11,314,960.90	0.05
391	605090	九丰能源	303,300	11,273,661.00	0.05
392	301550	斯菱智驱	123,215	11,265,547.45	0.05
393	688617	惠泰医疗	62,032	11,262,529.92	0.05
394	600515	海南机场	4,106,000	11,250,440.00	0.05
395	300409	道氏技术	564,100	11,242,513.00	0.05
396	603596	伯特利	450,400	11,187,936.00	0.05
397	002223	鱼跃医疗	435,300	11,169,798.00	0.05
398	300003	乐普医疗	939,600	11,134,260.00	0.05
399	000400	许继电气	512,175	11,114,197.50	0.05
400	688005	容百科技	362,001	11,077,230.60	0.05
401	600521	华海药业	765,300	11,020,320.00	0.05
402	002405	四维图新	1,700,818	11,004,292.46	0.05
403	000032	深桑达 A	440,700	10,995,465.00	0.05
404	000415	渤海租赁	2,682,800	10,918,996.00	0.05
405	000683	博源化工	1,891,700	10,896,192.00	0.05
406	601216	君正集团	2,439,200	10,878,832.00	0.05
407	600862	中航高科	601,500	10,845,045.00	0.05
408	000999	华润三九	481,507	10,829,092.43	0.05
409	000039	中集集团	1,324,292	10,740,008.12	0.04
410	600803	新奥股份	678,200	10,715,560.00	0.04
411	600704	物产中大	2,252,500	10,631,800.00	0.04
412	603766	隆鑫通用	885,000	10,558,050.00	0.04
413	600312	平高电气	590,400	10,426,464.00	0.04
414	603605	珀莱雅	173,600	10,402,112.00	0.04
415	600018	上港集团	2,198,500	10,376,920.00	0.04
416	000887	中鼎股份	576,300	10,310,007.00	0.04
417	600332	白云山	505,500	10,130,220.00	0.04
418	688116	天奈科技	263,599	10,069,481.80	0.04
419	000967	盈峰环境	955,500	10,061,415.00	0.04
420	300122	智飞生物	860,430	10,058,426.70	0.04
421	600153	建发股份	1,267,700	10,052,861.00	0.04
422	600765	中航重机	777,000	10,038,840.00	0.04
423	000830	鲁西化工	835,013	10,020,156.00	0.04
424	600166	福田汽车	3,411,700	9,928,047.00	0.04

425	002410	广联达	1,189,600	9,707,136.00	0.04
426	600323	瀚蓝环境	353,000	9,693,380.00	0.04
427	002007	华兰生物	787,811	9,603,416.09	0.04
428	300896	爱美客	109,674	9,563,572.80	0.04
429	601799	星宇股份	103,000	9,333,860.00	0.04
430	688114	华大智造	179,687	9,178,411.96	0.04
431	603568	伟明环保	593,980	9,135,412.40	0.04
432	600398	海澜之家	1,732,900	9,063,067.00	0.04
433	002603	以岭药业	601,900	9,028,500.00	0.04
434	601000	唐山港	2,160,400	8,965,660.00	0.04
435	600486	扬农化工	175,790	8,912,553.00	0.04
436	688009	中国通号	1,864,080	8,873,020.80	0.04
437	002389	航天彩虹	498,163	8,852,356.51	0.04
438	600529	山东药玻	479,300	8,843,085.00	0.04
439	600208	衢州发展	3,103,600	8,783,188.00	0.04
440	601018	宁波港	2,788,100	8,782,515.00	0.04
441	000738	航发控制	474,410	8,676,958.90	0.04
442	603486	科沃斯	170,702	8,663,126.50	0.04
443	600008	首创环保	3,182,300	8,655,856.00	0.04
444	600170	上海建工	3,858,660	8,566,225.20	0.04
445	600316	洪都航空	306,400	8,560,816.00	0.04
446	000932	华菱钢铁	2,452,400	8,509,828.00	0.04
447	600998	九州通	1,813,400	8,504,846.00	0.04
448	600161	天坛生物	714,680	8,275,994.40	0.03
449	600820	隧道股份	1,588,100	8,274,001.00	0.03
450	300118	东方日升	660,000	8,217,000.00	0.03
451	601238	广汽集团	1,608,300	8,170,164.00	0.03
452	603885	吉祥航空	785,800	8,085,882.00	0.03
453	688303	大全能源	461,106	8,037,077.58	0.03
454	002607	中公教育	4,397,122	7,914,819.60	0.03
455	688166	博瑞医药	225,139	7,882,116.39	0.03
456	603816	顾家家居	350,000	7,826,000.00	0.03
457	603939	益丰药房	434,017	7,803,625.66	0.03
458	600763	通策医疗	225,036	7,624,219.68	0.03
459	600038	中直股份	296,900	7,508,601.00	0.03
460	601567	三星电气	500,300	7,474,482.00	0.03
461	300573	兴齐眼药	182,071	7,421,213.96	0.03
462	300049	福瑞医科	189,400	7,363,872.00	0.03
463	300676	华大基因	209,683	7,351,485.98	0.03
464	603392	万泰生物	272,200	7,341,234.00	0.03
465	601880	辽港股份	5,318,500	7,339,530.00	0.03
466	600535	天士力	544,500	7,203,735.00	0.03
467	600511	国药股份	269,200	7,009,968.00	0.03
468	002244	滨江集团	900,200	6,841,520.00	0.03

469	600816	建元信托	2,802,300	6,837,612.00	0.03
470	300100	双林股份	244,400	6,789,432.00	0.03
471	000833	粤桂股份	289,100	6,770,722.00	0.03
472	688063	派能科技	125,716	6,696,891.32	0.03
473	002120	韵达股份	1,048,171	6,666,367.56	0.03
474	601155	新城控股	648,000	6,648,480.00	0.03
475	300144	宋城演艺	1,132,740	6,581,219.40	0.03
476	000998	隆平高科	838,800	6,324,552.00	0.03
477	002544	普天科技	346,800	6,318,696.00	0.03
478	600064	南京高科	867,400	6,184,562.00	0.03
479	601866	中远海发	2,766,200	6,113,302.00	0.03
480	600635	大众公用	1,425,300	6,100,284.00	0.03
481	300457	赢合科技	280,800	5,919,264.00	0.02
482	600754	锦江酒店	329,000	5,918,710.00	0.02
483	000035	中国天楹	1,222,495	5,904,650.85	0.02
484	600655	豫园股份	1,410,200	5,795,922.00	0.02
485	300601	康泰生物	486,620	5,518,270.80	0.02
486	600004	白云机场	747,800	5,429,028.00	0.02
487	600663	陆家嘴	859,700	5,398,916.00	0.02
488	600258	首旅酒店	487,500	5,323,500.00	0.02
489	600859	王府井	577,200	5,298,696.00	0.02
490	603899	晨光股份	256,300	5,287,469.00	0.02
491	002091	江苏国泰	713,842	5,161,077.66	0.02
492	300070	碧水源	1,594,239	5,085,622.41	0.02
493	000069	华侨城 A	2,852,319	4,677,803.16	0.02
494	600864	哈投股份	892,800	4,633,632.00	0.02
495	301078	孩子王	622,200	4,206,072.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	637,400	4,181,344.00	0.02
497	603833	欧派家居	133,150	4,009,146.50	0.02
498	002891	中宠股份	139,800	3,735,456.00	0.02
499	600325	华发股份	1,610,400	3,720,024.00	0.02
500	002572	索菲亚	406,100	2,964,530.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.03
2	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.01
3	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
4	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.00
5	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00

6	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
7	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
8	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
9	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
10	688809	强一股份	259	161,357.00	0.00
11	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
12	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
13	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
14	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
15	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
16	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
17	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
18	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
19	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
20	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
21	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
22	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
23	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
24	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
25	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
26	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
27	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
28	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
29	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
30	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
31	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
32	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
33	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
34	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
35	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
38	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占**期初**基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	741,607,643.85	1.99
2	601318	中国平安	371,345,911.61	0.99

3	688041	海光信息	348,040,542.24	0.93
4	601899	紫金矿业	306,772,228.94	0.82
5	600036	招商银行	259,650,109.58	0.70
6	688008	澜起科技	229,413,623.76	0.61
7	603986	兆易创新	206,979,620.49	0.55
8	600900	长江电力	181,336,700.46	0.49
9	601166	兴业银行	173,009,152.27	0.46
10	600276	恒瑞医药	145,730,317.61	0.39
11	600030	中信证券	142,365,829.59	0.38
12	688012	中微公司	138,306,668.04	0.37
13	601088	中国神华	137,982,962.91	0.37
14	600183	生益科技	135,517,689.68	0.36
15	603259	药明康德	134,658,331.69	0.36
16	601398	工商银行	131,088,387.64	0.35
17	600941	中国移动	122,956,483.84	0.33
18	002371	北方华创	119,989,881.33	0.32
19	688498	源杰科技	112,224,092.93	0.30
20	601211	国泰海通	109,066,588.39	0.29

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占**期初**基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,247,206,260.77	3.34
2	601318	中国平安	750,411,152.97	2.01
3	601899	紫金矿业	647,905,451.02	1.73
4	600036	招商银行	540,549,707.85	1.45
5	688041	海光信息	496,499,463.42	1.33
6	600900	长江电力	371,868,397.51	1.00
7	601166	兴业银行	356,238,678.02	0.95
8	688008	澜起科技	344,321,854.95	0.92
9	603986	兆易创新	335,045,107.82	0.90
10	600030	中信证券	295,612,629.53	0.79
11	600276	恒瑞医药	292,556,068.05	0.78
12	603259	药明康德	281,406,655.76	0.75
13	601398	工商银行	270,126,339.00	0.72
14	688981	中芯国际	246,904,949.04	0.66
15	601088	中国神华	245,264,628.91	0.66
16	601211	国泰海通	227,476,544.33	0.61
17	601288	农业银行	220,571,627.29	0.59

18	601328	交通银行	205,524,904.00	0.55
19	603993	洛阳钼业	203,132,545.08	0.54
20	600150	中国船舶	193,904,046.37	0.52

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,635,002,233.80
卖出股票的收入（成交）总额	20,867,174,690.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,475,019.40	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,475,019.40	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

1	111025	圣泉转债	14,750	1,475,019.40	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.03	新股锁定
2	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.01	新股锁定
3	688765	禾元生物	799,783.20	0.00	新股锁定
4	001248	华润新能源	595,206.03	0.00	新股锁定
5	301666	大普微	565,262.60	0.00	新股锁定
6	001248	华润新能源	255,085.41	0.00	网下中签

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		中证 A500ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
93,921	189,788.08	12,994,813,295.00	72.90%	3,690,575,969.00	20.70%	1,139,697,400.00	6.39%

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	668,160.00	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	50~100
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（2024 年 9 月 26 日）基金份额总额	2,000,086,664.00
本报告期期初基金份额总额	31,286,086,664.00
本报告期基金总申购份额	13,344,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	26,805,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,825,086,664.00

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、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及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

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）及其该部门高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）相关从业人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	6	33,438,672,767.08	100.00%	6,216,165.29	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：

（1）实力雄厚、信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；

（3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；

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

2、选择程序：

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

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	1,475,000.00	100.00%	-	-	-	-

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指定证券投资基金主流动性服务商的公告	《证券日报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-01-30
2	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
3	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
4	国泰基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金投资关联方承销证券的公告	《证券日报》	2026-04-10
5	国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行 A 股的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2026-04-11
6	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
7	国泰基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金新增流动性服务商的公告	《证券日报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-05-21
8	国泰基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-06-01

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、关于准予国泰中证 A500 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、国泰中证 A500 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

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