

**国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
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	34
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.11 投资组合报告附注	45
8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 盈利投资者数量占比	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
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	48
10.8 其他重大事件	49
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用 ETF
场内简称	ESGETF 国泰
基金主代码	159621
交易代码	159621
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 30 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,434,717.00 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 9 月 9 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略：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、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股人民币 ESG 通用指数（MSCI China A RMB ESG Universal Index）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标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	滕菲菲
	联系电话	021-31081600转	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95558
传真		021-31081800	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200082	100020
法定代表人		周向勇	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告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	2,101,094.81
本期利润	427,623.88
加权平均基金份额本期利润	0.0325
本期加权平均净值利润率	2.77%

本期基金份额净值增长率	3.19%
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	2,381,092.64
期末可供分配基金份额利润	0.2082
期末基金资产净值	13,815,809.64
期末基金份额净值	1.2082
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	20.82%

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。

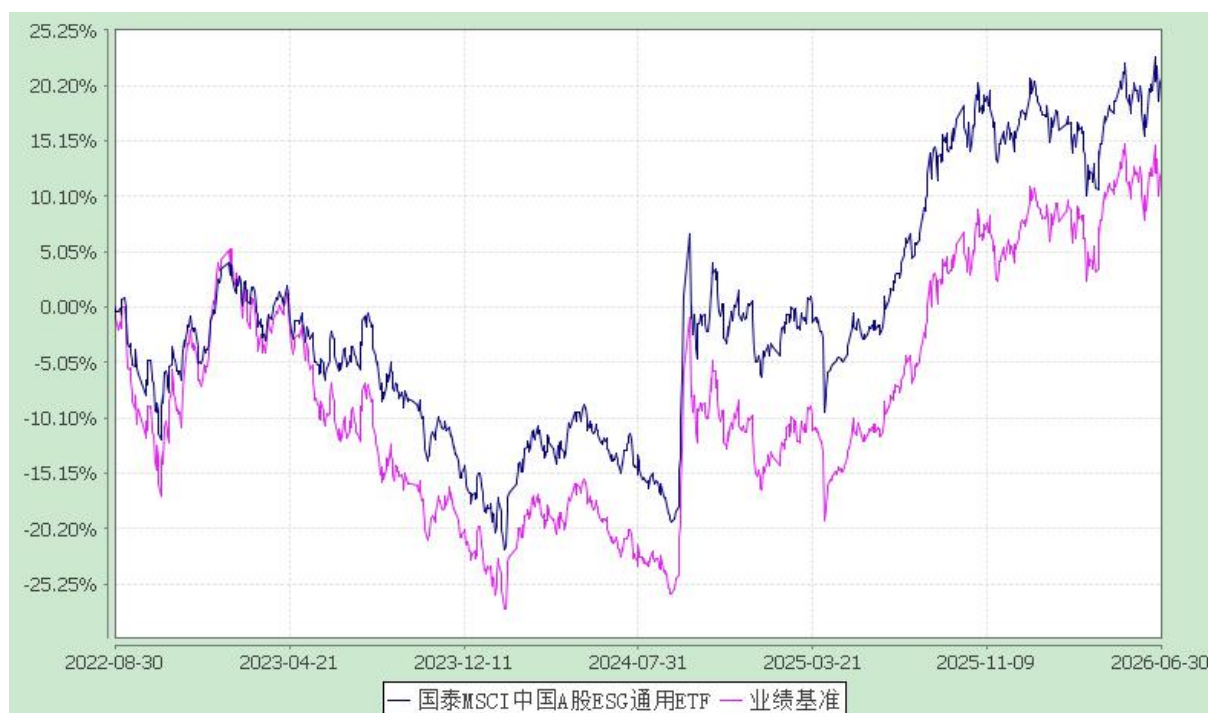
3.2 基金净值表现

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	8.49%	1.08%	8.55%	1.19%	-0.06%	-0.11%
过去六个月	3.19%	0.99%	4.59%	1.11%	-1.40%	-0.12%
过去一年	20.45%	0.91%	24.04%	1.00%	-3.59%	-0.09%
过去三年	27.14%	1.07%	27.36%	1.14%	-0.22%	-0.07%
自基金合同生效起至今	20.82%	1.04%	12.35%	1.16%	8.47%	-0.12%

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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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
 （2022 年 8 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2022 年 08 月 30 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		
苗梦羽	国泰中证全指软件 ETF、国泰中证全指软件 ETF 联接、国泰中证基建 ETF、国泰中证港股通科技 ETF 发起联接、国泰国证疫苗与生物科技 ETF、国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用 ETF、国泰中证基建 ETF 发起联接、国泰中证机床 ETF、国泰标普 500ETF 发起联接 (QDII)、国泰国证疫苗与生物科技 ETF 发起联接、国泰中证机床 ETF 发起联接、国泰国证绿色电力 ETF、国泰中证全指家用电器 ETF、国泰中证细分机械设备产业主题 ETF、国泰国证信息技术创新主题 ETF、国泰中证油气产业 ETF 的基金经理	2022-08-30	-	11 年	硕士研究生。2015 年 8 月加入国泰基金, 历任助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 9 月起任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金和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, 2022 年 2 月起兼任国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2022 年 6 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发起式联接基金的基金经理, 2022 年 8 月起兼任国泰国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金和国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2022 年 10 月起兼任国泰中证基建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机床交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2022 年 11 月起兼任国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 和国泰国证疫苗与生物科技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 12 月起兼任国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰国证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2023 年 5 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2023 年 9 月起兼任国泰国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2023 年 10 月起兼任国泰中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经

					理。
--	--	--	--	--	----

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

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股走势震荡，行情分化。年初市场情绪高涨，主要指数冲高，成交额放量；但 3 月后美伊局势紧张加剧，引发全球市场避险情绪升温，A 股主要指数回吐年初以来涨幅。进入

二季度，海外地缘冲突在反复博弈中走向缓和，市场整体触底回升，同时结构分化加剧；算力基建走出主线行情，而资金虹吸效应下，传统价值板块则进入弱势调整。从行业表现来看，申万一级行业中，电子、通信领跑全场，而商贸零售、农林牧渔等调整幅度较大。

作为指数基金，本基金旨在为投资者提供标准化的投资工具。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 3.19%，同期业绩比较基准收益率为 4.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

MSCI 中国 A 股人民币 ESG 通用指数覆盖沪深市场的大中盘股票，并在自由流通市值权重的基础上，给予 ESG 情况稳健及积极改善的公司更高权重。从成分股的行业分布来看，银行、医药生物、非银金融、食品饮料等行业的权重位居前列。整体来看，指数成分股集中度低，行业分布均衡，能够较好地分散行业和个股风险，长期配置价值值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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

本基金本报告期存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会上海监管局报告本基金的解决方案。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金 2026 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，国泰基金管理有限公司在国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，国泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2026 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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	359,572.95	424,332.19
结算备付金		87,961.28	16,994.21
存出保证金		2,815.12	4,960.33
交易性金融资产	6.4.7.2	13,374,440.81	19,978,812.25
其中：股票投资		13,374,440.81	19,978,812.25

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
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		13,824,790.16	20,425,098.98
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		5,598.29	8,605.45
应付托管费		1,119.66	1,721.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,262.57	1,515.22
负债合计		8,980.52	11,841.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	11,434,717.00	17,434,717.00
未分配利润	6.4.7.8	2,381,092.64	2,978,540.27
净资产合计		13,815,809.64	20,413,257.27
负债和净资产总计		13,824,790.16	20,425,098.98

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2082 元，基金份额总额 11,434,717.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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		473,807.15	425,020.61
1.利息收入		663.60	874.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	663.60	874.96
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）		2,105,793.58	1,468,903.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,972,702.85	1,077,322.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	133,090.73	391,580.54
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	-1,673,470.93	-1,084,778.67
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	40,820.90	40,021.05
减：二、营业总支出		46,183.27	85,309.92
1. 管理人报酬		38,418.63	70,990.31
2. 托管费		7,683.64	14,198.11
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	81.00	121.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		427,623.88	339,710.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		427,623.88	339,710.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		427,623.88	339,710.69

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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	17,434,717.00	2,978,540.27	20,413,257.27
二、本期期初净资产	17,434,717.00	2,978,540.27	20,413,257.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-597,447.63	-6,597,447.63
（一）、综合收益总额	-	427,623.88	427,623.88
（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）	-6,000,000.00	-1,025,071.51	-7,025,071.51
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	1,185,579.12	7,185,579.12
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-2,210,650.63	-14,210,650.63
（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	11,434,717.00	2,381,092.64	13,815,809.64
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	32,434,717.00	-309,770.25	32,124,946.75
二、本期期初净资产	32,434,717.00	-309,770.25	32,124,946.75
三、本期增减变动	0.00	409,398.92	409,398.92

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	339,710.69	339,710.69
（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）	0.00	69,688.23	69,688.23
其中：1.基金申购款	21,000,000.00	-330,588.56	20,669,411.44
2.基金赎回款	-21,000,000.00	400,276.79	-20,599,723.21
（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	32,434,717.00	99,628.67	32,534,345.67

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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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[2022]105 号《关于准予国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 989,403,138.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0574 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 989,434,717.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,579.00 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]877 号文审核同意, 本基金 989,434,717.00 份基金份额于 2022 年 9 月 9 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 MSCI 中国 A 股 ESG 通用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、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%, 因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准: MSCI 中国 A 股人民币 ESG 通用指数(MSCI China A RMB ESG Universal Index)收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	359,572.95
等于：本金	359,544.11
加：应计利息	28.84
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	359,572.95

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		12,138,975.08	-	13,374,440.81	1,235,465.73
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		12,138,975.08	-	13,374,440.81	1,235,465.73

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	2,262.57
其中：交易所市场	2,262.57
银行间市场	-
应付利息	-
合计	2,262.57

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	17,434,717.00	17,434,717.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	11,434,717.00	11,434,717.00

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	3,108,997.45	-130,457.18	2,978,540.27
本期期初	3,108,997.45	-130,457.18	2,978,540.27
本期利润	2,101,094.81	-1,673,470.93	427,623.88
本期基金份额交易产生的变动数	-1,327,200.29	302,128.78	-1,025,071.51
其中：基金申购款	1,567,562.42	-381,983.30	1,185,579.12
基金赎回款	-2,894,762.71	684,112.08	-2,210,650.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	3,882,891.97	-1,501,799.33	2,381,092.64
-----	--------------	---------------	--------------

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	627.27
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	30.62
其他	5.71
合计	663.60

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	1,151,180.39
股票投资收益——赎回差价收入	821,522.46
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	1,972,702.85

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	11,267,654.87
减：卖出股票成本总额	10,107,011.83
减：交易费用	9,462.65
买卖股票差价收入	1,151,180.39

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	14,210,650.63
减：现金支付赎回款总额	9,335,492.63
减：赎回股票成本总额	4,053,635.54
减：交易费用	-
赎回差价收入	821,522.46

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	133,090.73
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	133,090.73

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	-1,673,470.93
——股票投资	-1,673,470.93
——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	-1,673,470.93

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

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 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	40,820.90
合计	40,820.90

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	81.00
合计	81.00

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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	38,418.63	70,990.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,094.39	977.34
应支付基金管理人的净管理费	37,324.24	70,012.97

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	7,683.64	14,198.11

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

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	359,572.95	627.27	527,778.74	798.39

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有基金托管人中信银行的 A 股普通股 6,000.00 股，成本总额为人民币 46,005.45 元，估值总额为人民币 41,580.00 元，占基金资产净值的比例为 0.30%。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而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

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	96.00	16,741.55	79,872.00	-

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，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，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中信银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；

在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	359,572.95	-	-	-	359,572.95
结算备付金	87,961.28	-	-	-	87,961.28
存出保证金	2,815.12	-	-	-	2,815.12
交易性金融资产	-	-	-	13,374,440.81	13,374,440.81
资产总计	450,349.35	-	-	13,374,440.81	13,824,790.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,598.29	5,598.29
应付托管费	-	-	-	1,119.66	1,119.66
其他负债	-	-	-	2,262.57	2,262.57
负债总计	-	-	-	8,980.52	8,980.52
利率敏感度缺口	450,349.35	-	-	13,365,460.29	13,815,809.64
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	424,332.19	-	-	-	424,332.19

结算备付金	16,994.21	-	-	-	16,994.21
存出保证金	4,960.33	-	-	-	4,960.33
交易性金融资产	-	-	-	19,978,812.25	19,978,812.25
资产总计	446,286.73	-	-	19,978,812.25	20,425,098.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,605.45	8,605.45
应付托管费	-	-	-	1,721.04	1,721.04
其他负债	-	-	-	1,515.22	1,515.22
负债总计	-	-	-	11,841.71	11,841.71
利率敏感度缺口	446,286.73	-	-	19,966,970.54	20,413,257.27

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	13,374,440.81	96.81	19,978,812.25	97.87
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	13,374,440.81	96.81	19,978,812.25	97.87

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 625,045.58	增加约 943,734.24
	业绩比较基准下降 5%	减少约 625,045.58	减少约 943,734.24

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	13,294,568.81	19,884,386.65
第二层次	79,872.00	94,425.60
第三层次	-	-
合计	13,374,440.81	19,978,812.25

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

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 7,185,579.12 元（于 2025 上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 20,669,411.44 元），其中包括以股票支付的申购款 2,546,874.00 元和以现金支付的申购款 4,638,705.12 元（于 2025 上半年度，括以股票支付的申购款 5,632,065.00 元和以现金支付的申购款 15,037,346.44 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	13,374,440.81	96.74
	其中：股票	13,374,440.81	96.74

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	447,534.23	3.24
8	其他各项资产	2,815.12	0.02
9	合计	13,824,790.16	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	69,339.00	0.50
B	采矿业	354,847.65	2.57
C	制造业	7,750,276.52	56.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	402,367.29	2.91
E	建筑业	135,693.76	0.98
F	批发和零售业	82,918.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	250,468.00	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	508,711.17	3.68

J	金融业	3,485,342.27	25.23
K	房地产业	45,963.00	0.33
L	租赁和商务服务业	66,307.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	178,539.75	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	3,691.20	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,750.20	0.14
R	文化、体育和娱乐业	4,436.00	0.03
S	综合	16,790.00	0.12
	合计	13,374,440.81	96.81

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300750	宁德时代	1,563	614,274.63	4.45
2	601138	工业富联	5,200	375,180.00	2.72
3	600036	招商银行	10,100	358,550.00	2.60
4	600519	贵州茅台	300	355,647.00	2.57
5	601288	农业银行	41,500	251,905.00	1.82
6	601318	中国平安	5,200	248,248.00	1.80
7	002371	北方华创	270	238,831.20	1.73
8	300308	中际旭创	180	228,600.00	1.65
9	601398	工商银行	30,600	216,342.00	1.57
10	688012	中微公司	447	209,419.50	1.52
11	002594	比亚迪	2,600	207,220.00	1.50
12	600900	长江电力	7,407	196,063.29	1.42
13	601166	兴业银行	10,300	170,568.00	1.23
14	600030	中信证券	5,904	169,621.92	1.23
15	300274	阳光电源	1,040	165,380.80	1.20
16	603986	兆易创新	200	163,000.00	1.18

17	600276	恒瑞医药	3,100	161,324.00	1.17
18	603259	药明康德	1,200	149,412.00	1.08
19	600000	浦发银行	16,200	139,482.00	1.01
20	002475	立讯精密	1,800	126,720.00	0.92
21	601211	国泰海通	6,900	125,580.00	0.91
22	688256	寒武纪	77	122,857.35	0.89
23	601988	中国银行	19,400	110,968.00	0.80
24	002384	东山精密	400	104,940.00	0.76
25	600183	生益科技	600	104,040.00	0.75
26	601939	建设银行	10,300	99,189.00	0.72
27	300059	东方财富	4,840	98,639.20	0.71
28	000001	平安银行	9,500	95,475.00	0.69
29	601601	中国太保	3,300	94,116.00	0.68
30	600487	亨通光电	800	87,472.00	0.63
31	688082	盛美上海	200	86,400.00	0.63
32	300502	新易盛	140	84,980.00	0.62
33	601328	交通银行	13,000	83,590.00	0.61
34	688072	拓荆科技	96	79,872.00	0.58
35	300760	迈瑞医疗	565	76,743.95	0.56
36	603288	海天味业	2,296	76,135.36	0.55
37	601688	华泰证券	3,600	74,232.00	0.54
38	688041	海光信息	200	74,060.00	0.54
39	600887	伊利股份	3,052	73,125.92	0.53
40	600176	中国巨石	1,000	72,880.00	0.53
41	601658	邮储银行	14,700	72,471.00	0.52
42	002352	顺丰控股	2,300	71,898.00	0.52
43	301308	江波龙	100	70,380.00	0.51
44	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.50
45	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.49
46	000858	五 粮 液	900	66,600.00	0.48
47	601857	中国石油	7,600	65,968.00	0.48
48	601818	光大银行	22,600	65,314.00	0.47
49	688111	金山办公	300	63,915.00	0.46
50	002938	鹏鼎控股	600	63,228.00	0.46
51	002600	领益智造	3,600	62,424.00	0.45
52	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.45
53	600690	海尔智家	3,000	61,230.00	0.44
54	601066	中信建投	2,100	61,047.00	0.44
55	600522	中天科技	1,000	60,680.00	0.44
56	000333	美的集团	800	60,424.00	0.44
57	600919	江苏银行	5,600	60,368.00	0.44
58	002714	牧原股份	1,700	59,483.00	0.43
59	601985	中国核电	6,300	56,889.00	0.41
60	603993	洛阳钼业	3,177	55,756.35	0.40

61	600016	民生银行	17,300	55,706.00	0.40
62	000988	华工科技	300	55,383.00	0.40
63	601668	中国建筑	12,624	54,788.16	0.40
64	600309	万华化学	800	54,728.00	0.40
65	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.40
66	600584	长电科技	500	51,775.00	0.37
67	601088	中国神华	1,300	50,752.00	0.37
68	601127	赛力斯	800	49,000.00	0.35
69	000792	盐湖股份	1,600	48,304.00	0.35
70	002142	宁波银行	1,610	47,800.90	0.35
71	300124	汇川技术	700	46,431.00	0.34
72	300394	天孚通信	151	45,704.68	0.33
73	600031	三一重工	2,600	44,928.00	0.33
74	688120	华海清科	137	44,138.66	0.32
75	000338	潍柴动力	1,600	43,600.00	0.32
76	000063	中兴通讯	1,200	43,428.00	0.31
77	300433	蓝思科技	800	42,928.00	0.31
78	002001	新 和 成	1,500	42,630.00	0.31
79	000776	广发证券	1,800	42,120.00	0.30
80	601998	中信银行	6,000	41,580.00	0.30
81	688271	联影医疗	400	40,492.00	0.29
82	601628	中国人寿	1,100	38,885.00	0.28
83	688777	中控技术	330	38,775.00	0.28
84	000725	京东方 A	4,400	38,192.00	0.28
85	600999	招商证券	1,800	37,980.00	0.27
86	601229	上海银行	4,300	37,324.00	0.27
87	605117	德业股份	346	36,738.28	0.27
88	002080	中材科技	400	36,000.00	0.26
89	601825	沪农商行	4,700	35,203.00	0.25
90	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.25
91	300604	长川科技	100	34,142.00	0.25
92	600549	厦门钨业	400	34,080.00	0.25
93	300857	协创数据	100	33,990.00	0.25
94	600958	东方证券	3,600	33,984.00	0.25
95	300033	同花顺	140	33,740.00	0.24
96	300408	三环集团	200	33,380.00	0.24
97	600809	山西汾酒	300	32,811.00	0.24
98	600436	片仔癀	300	32,784.00	0.24
99	300014	亿纬锂能	500	32,515.00	0.24
100	600905	三峡能源	8,700	32,277.00	0.23
101	600028	中国石化	7,100	31,666.00	0.23
102	601319	中国人保	4,600	31,096.00	0.23
103	000568	泸州老窖	400	31,008.00	0.22
104	002422	科伦药业	800	30,816.00	0.22

105	601766	中国中车	5,900	30,680.00	0.22
106	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.22
107	002353	杰瑞股份	200	30,500.00	0.22
108	600150	中国船舶	900	30,411.00	0.22
109	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.22
110	601336	新华保险	500	29,830.00	0.22
111	601009	南京银行	3,000	29,670.00	0.21
112	000100	TCL 科技	5,060	29,449.20	0.21
113	688396	华润微	300	29,265.00	0.21
114	603659	璞泰来	1,010	29,219.30	0.21
115	600188	兖矿能源	1,640	29,142.80	0.21
116	000425	徐工机械	3,600	29,124.00	0.21
117	600019	宝钢股份	5,300	28,779.00	0.21
118	000657	中钨高新	300	28,716.00	0.21
119	601868	中国能建	10,700	28,569.00	0.21
120	603501	豪威集团	300	28,455.00	0.21
121	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.20
122	601916	浙商银行	10,540	27,720.20	0.20
123	002916	深南电路	60	27,474.00	0.20
124	601816	京沪高铁	6,000	27,180.00	0.20
125	601888	中国中免	500	26,855.00	0.19
126	601600	中国铝业	3,200	26,304.00	0.19
127	601077	渝农商行	4,300	26,273.00	0.19
128	000651	格力电器	700	26,250.00	0.19
129	600926	杭州银行	1,800	26,010.00	0.19
130	000938	紫光股份	900	25,974.00	0.19
131	601390	中国中铁	6,200	25,854.00	0.19
132	002709	天赐材料	500	25,715.00	0.19
133	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.19
134	601169	北京银行	5,200	25,480.00	0.18
135	002602	世纪华通	1,800	25,380.00	0.18
136	601377	兴业证券	4,200	25,368.00	0.18
137	000963	华东医药	900	25,308.00	0.18
138	601995	中金公司	700	25,305.00	0.18
139	600660	福耀玻璃	500	25,220.00	0.18
140	300223	北京君正	100	24,890.00	0.18
141	600346	恒力石化	1,400	24,794.00	0.18
142	002466	天齐锂业	400	24,528.00	0.18
143	600104	上汽集团	2,500	24,400.00	0.18
144	000807	云铝股份	1,100	24,354.00	0.18
145	000166	申万宏源	5,500	24,200.00	0.18
146	300316	晶盛机电	400	24,160.00	0.17
147	601012	隆基绿能	1,840	24,140.80	0.17
148	600886	国投电力	1,800	23,958.00	0.17

149	601179	中国西电	1,600	23,872.00	0.17
150	002460	赣锋锂业	362	23,674.80	0.17
151	002493	荣盛石化	2,200	23,650.00	0.17
152	688249	晶合集成	400	23,612.00	0.17
153	601225	陕西煤业	1,150	23,402.50	0.17
154	600026	中远海能	1,300	23,322.00	0.17
155	600406	国电南瑞	1,004	22,941.40	0.17
156	600196	复星医药	1,000	22,470.00	0.16
157	002050	三花智控	500	21,915.00	0.16
158	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.16
159	000538	云南白药	460	21,790.20	0.16
160	601727	上海电气	3,100	21,700.00	0.16
161	688469	芯联集成	2,042	21,665.62	0.16
162	601607	上海医药	1,400	21,560.00	0.16
163	300661	圣邦股份	150	21,522.00	0.16
164	601100	恒立液压	200	21,512.00	0.16
165	600160	巨化股份	400	21,204.00	0.15
166	000977	浪潮信息	300	21,000.00	0.15
167	603296	华勤技术	280	20,795.60	0.15
168	002555	三七互娱	1,100	20,757.00	0.15
169	002837	英维克	260	20,685.60	0.15
170	688187	时代电气	300	20,598.00	0.15
171	600015	华夏银行	3,200	20,448.00	0.15
172	002648	卫星化学	860	20,201.40	0.15
173	600875	东方电气	700	20,139.00	0.15
174	601881	中国银河	1,600	20,112.00	0.15
175	601919	中远海控	1,500	19,890.00	0.14
176	300759	康龙化成	675	19,527.75	0.14
177	601231	环旭电子	600	19,440.00	0.14
178	600111	北方稀土	400	19,220.00	0.14
179	002241	歌尔股份	849	19,127.97	0.14
180	600570	恒生电子	900	19,071.00	0.14
181	600803	新奥股份	1,200	18,960.00	0.14
182	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.14
183	300015	爱尔眼科	2,270	18,750.20	0.14
184	002129	TCL 中环	1,550	18,631.00	0.13
185	601058	赛轮轮胎	1,600	18,448.00	0.13
186	300919	中伟新材	420	18,375.00	0.13
187	000301	东方盛虹	1,600	18,320.00	0.13
188	600989	宝丰能源	900	18,297.00	0.13
189	600096	云天化	600	18,240.00	0.13
190	000895	双汇发展	800	17,920.00	0.13
191	601872	招商轮船	1,000	17,570.00	0.13
192	300207	欣旺达	900	17,091.00	0.12

193	600674	川投能源	1,200	17,004.00	0.12
194	600585	海螺水泥	1,000	16,950.00	0.12
195	002027	分众传媒	3,500	16,940.00	0.12
196	600673	东阳光	500	16,790.00	0.12
197	688188	柏楚电子	157	16,751.90	0.12
198	002851	麦格米特	100	16,718.00	0.12
199	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.12
200	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.12
201	601168	西部矿业	600	16,284.00	0.12
202	002517	恺英网络	1,000	16,250.00	0.12
203	688126	沪硅产业	403	16,075.67	0.12
204	000728	国元证券	2,145	16,066.05	0.12
205	600588	用友网络	1,700	15,606.00	0.11
206	002304	洋河股份	400	15,260.00	0.11
207	600050	中国联通	3,800	15,200.00	0.11
208	002156	通富微电	200	15,174.00	0.11
209	002625	光启技术	500	15,160.00	0.11
210	601111	中国国航	2,500	15,125.00	0.11
211	601360	三六零	1,700	14,773.00	0.11
212	600498	烽火通信	200	14,720.00	0.11
213	001965	招商公路	1,600	14,656.00	0.11
214	300866	安克创新	140	14,630.00	0.11
215	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.10
216	002202	金风科技	600	14,340.00	0.10
217	600029	南方航空	2,750	14,245.00	0.10
218	001979	招商蛇口	2,200	14,146.00	0.10
219	601689	拓普集团	250	14,105.00	0.10
220	002736	国信证券	1,400	13,986.00	0.10
221	600547	山东黄金	600	13,854.00	0.10
222	002558	巨人网络	500	13,780.00	0.10
223	600048	保利发展	2,900	13,427.00	0.10
224	002812	恩捷股份	200	13,382.00	0.10
225	600438	通威股份	1,100	13,321.00	0.10
226	601878	浙商证券	1,400	13,300.00	0.10
227	600415	小商品城	1,300	13,208.00	0.10
228	600988	赤峰黄金	500	13,160.00	0.10
229	600362	江西铜业	300	12,990.00	0.09
230	600418	江淮汽车	500	12,915.00	0.09
231	301236	软通动力	300	12,735.00	0.09
232	600703	三安光电	600	12,732.00	0.09
233	688122	西部超导	200	12,562.00	0.09
234	601877	正泰电器	500	12,535.00	0.09
235	600010	包钢股份	5,500	12,265.00	0.09
236	002230	科大讯飞	300	12,252.00	0.09

237	301269	华大九天	100	11,942.00	0.09
238	300136	信维通信	100	11,925.00	0.09
239	000157	中联重科	1,700	11,849.00	0.09
240	002738	中矿资源	200	11,798.00	0.09
241	688036	传音控股	200	11,790.00	0.09
242	601006	大秦铁路	2,500	11,525.00	0.08
243	600893	航发动力	300	11,502.00	0.08
244	601456	国联民生	1,300	11,492.00	0.08
245	688223	晶科能源	2,400	11,400.00	0.08
246	600845	宝信软件	684	11,374.92	0.08
247	601991	大唐发电	1,600	11,328.00	0.08
248	601958	金钼股份	400	11,244.00	0.08
249	600219	南山铝业	2,800	11,172.00	0.08
250	002074	国轩高科	400	11,004.00	0.08
251	600460	士兰微	200	10,932.00	0.08
252	600489	中金黄金	600	10,830.00	0.08
253	601577	长沙银行	1,200	10,452.00	0.08
254	600600	青岛啤酒	200	10,446.00	0.08
255	002379	宏桥控股	700	10,339.00	0.07
256	688099	晶晨股份	100	10,290.00	0.07
257	600795	国电电力	2,200	10,274.00	0.07
258	000999	华润三九	456	10,255.44	0.07
259	603806	福斯特	609	10,225.11	0.07
260	000630	铜陵有色	1,600	10,176.00	0.07
261	601669	中国电建	2,100	9,870.00	0.07
262	300498	温氏股份	800	9,856.00	0.07
263	688472	阿特斯	900	9,738.00	0.07
264	603799	华友钴业	200	9,652.00	0.07
265	605499	东鹏饮料	78	9,627.54	0.07
266	300454	深信服	100	9,620.00	0.07
267	300347	泰格医药	200	9,600.00	0.07
268	600918	中泰证券	1,800	9,576.00	0.07
269	002294	信立泰	300	9,567.00	0.07
270	601108	财通证券	1,100	9,515.00	0.07
271	601555	东吴证券	1,200	9,504.00	0.07
272	600143	金发科技	600	9,270.00	0.07
273	300748	金力永磁	300	9,255.00	0.07
274	300803	指南针	100	9,167.00	0.07
275	601021	春秋航空	200	9,116.00	0.07
276	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.07
277	002185	华天科技	400	8,924.00	0.06
278	002311	海大集团	200	8,922.00	0.06
279	601838	成都银行	500	8,850.00	0.06
280	000876	新 希 望	1,400	8,778.00	0.06

281	002252	上海莱士	2,000	8,680.00	0.06
282	000960	锡业股份	200	8,538.00	0.06
283	601162	天风证券	2,500	8,425.00	0.06
284	300832	新产业	200	8,400.00	0.06
285	600011	华能国际	1,100	8,349.00	0.06
286	688387	信科移动	416	8,253.44	0.06
287	002236	大华股份	500	8,245.00	0.06
288	300765	石药创新	300	8,169.00	0.06
289	300628	亿联网络	240	8,116.80	0.06
290	603392	万泰生物	300	8,091.00	0.06
291	300418	昆仑万维	200	8,072.00	0.06
292	600066	宇通客车	300	8,043.00	0.06
293	600115	中国东航	2,100	8,001.00	0.06
294	002340	格林美	1,196	7,905.56	0.06
295	600733	北汽蓝谷	1,600	7,792.00	0.06
296	002966	苏州银行	1,100	7,656.00	0.06
297	000066	中国长城	400	7,620.00	0.06
298	600895	张江高科	200	7,450.00	0.05
299	000786	北新建材	400	7,236.00	0.05
300	601788	光大证券	500	7,215.00	0.05
301	601901	方正证券	1,000	7,200.00	0.05
302	600426	华鲁恒升	300	7,176.00	0.05
303	000625	长安汽车	1,000	7,170.00	0.05
304	000002	万 科 A	2,400	7,104.00	0.05
305	002414	高德红外	530	7,027.80	0.05
306	600221	海航控股	5,200	7,020.00	0.05
307	300896	爱美客	80	6,976.00	0.05
308	002128	电投能源	300	6,936.00	0.05
309	600085	同仁堂	300	6,933.00	0.05
310	600601	方正科技	500	6,920.00	0.05
311	000783	长江证券	700	6,825.00	0.05
312	002595	豪迈科技	145	6,757.00	0.05
313	000661	长春高新	100	6,660.00	0.05
314	002459	晶澳科技	820	6,642.00	0.05
315	002653	海思科	100	6,634.00	0.05
316	600580	卧龙电驱	200	6,620.00	0.05
317	000426	兴业银锡	200	6,592.00	0.05
318	002532	天山铝业	600	6,438.00	0.05
319	000933	神火股份	300	6,360.00	0.05
320	600023	浙能电力	1,200	6,312.00	0.05
321	600233	圆通速递	400	6,300.00	0.05
322	600741	华域汽车	400	6,208.00	0.04
323	600039	四川路桥	780	6,099.60	0.04
324	601238	广汽集团	1,200	6,096.00	0.04

325	600021	上海电力	400	6,028.00	0.04
326	601567	三星电气	400	5,976.00	0.04
327	000617	中油资本	900	5,931.00	0.04
328	601699	潞安环能	400	5,712.00	0.04
329	002064	华峰化学	600	5,694.00	0.04
330	688599	天合光能	400	5,648.00	0.04
331	300115	长盈精密	200	5,588.00	0.04
332	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.04
333	300122	智飞生物	471	5,505.99	0.04
334	300058	蓝色光标	400	5,504.00	0.04
335	601198	东兴证券	400	5,436.00	0.04
336	601618	中国中冶	2,200	5,368.00	0.04
337	600027	华电国际	1,200	5,340.00	0.04
338	002049	紫光国微	60	5,325.00	0.04
339	600061	国投资本	800	5,240.00	0.04
340	600642	申能股份	600	5,238.00	0.04
341	688303	大全能源	300	5,229.00	0.04
342	000559	万向钱潮	400	5,172.00	0.04
343	601117	中国化学	700	5,145.00	0.04
344	000975	山金国际	300	5,100.00	0.04
345	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.04
346	603606	东方电缆	120	4,981.20	0.04
347	002601	龙佰集团	300	4,944.00	0.04
348	601777	千里科技	600	4,896.00	0.04
349	600352	浙江龙盛	400	4,844.00	0.04
350	600009	上海机场	200	4,620.00	0.03
351	002195	岩山科技	700	4,578.00	0.03
352	601216	君正集团	1,000	4,460.00	0.03
353	300251	光线传媒	400	4,436.00	0.03
354	600711	盛屯矿业	400	4,388.00	0.03
355	600157	永泰能源	2,700	4,347.00	0.03
356	600839	四川长虹	600	4,188.00	0.03
357	002939	长城证券	500	4,170.00	0.03
358	601212	白银有色	800	4,064.00	0.03
359	000983	山西焦煤	700	4,060.00	0.03
360	600515	海南机场	1,400	3,836.00	0.03
361	002465	海格通信	300	3,831.00	0.03
362	002131	利欧股份	800	3,800.00	0.03
363	601696	中银证券	300	3,795.00	0.03
364	000708	中信特钢	300	3,786.00	0.03
365	002078	太阳纸业	300	3,747.00	0.03
366	603568	伟明环保	240	3,691.20	0.03
367	600298	安琪酵母	100	3,620.00	0.03
368	000932	华菱钢铁	1,000	3,470.00	0.03

369	601933	永辉超市	1,100	3,124.00	0.02
370	000564	供销大集	2,200	2,926.00	0.02
370	300413	芒果超媒	200	2,926.00	0.02
372	300782	卓胜微	25	2,739.50	0.02
373	600536	中国软件	80	2,249.60	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601138	工业富联	254,506.00	1.25
2	600519	贵州茅台	253,806.00	1.24
3	600036	招商银行	207,928.00	1.02
4	688041	海光信息	184,486.00	0.90
5	601318	中国平安	162,402.00	0.80
6	601288	农业银行	149,526.00	0.73
7	688008	澜起科技	141,058.00	0.69
8	603986	兆易创新	138,426.00	0.68
9	600900	长江电力	134,018.00	0.66
10	002371	北方华创	127,854.00	0.63
11	002594	比亚迪	125,169.00	0.61
12	601398	工商银行	124,098.00	0.61
13	601166	兴业银行	104,313.00	0.51
14	603993	洛阳钼业	95,088.00	0.47
15	600030	中信证券	89,365.00	0.44
16	600276	恒瑞医药	88,344.00	0.43
17	600000	浦发银行	87,468.00	0.43
18	601857	中国石油	81,849.00	0.40
19	600183	生益科技	67,974.00	0.33
20	601988	中国银行	65,450.00	0.32

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	675,522.00	3.31
2	601138	工业富联	562,091.00	2.75
3	600036	招商银行	433,560.00	2.12
4	601318	中国平安	345,663.00	1.69
5	601288	农业银行	311,776.00	1.53
6	688256	寒武纪	295,238.15	1.45
7	603993	洛阳钼业	292,341.00	1.43
8	601398	工商银行	253,346.00	1.24
9	300308	中际旭创	233,990.00	1.15
10	688041	海光信息	225,124.00	1.10
11	601166	兴业银行	219,298.00	1.07
12	600276	恒瑞医药	198,085.00	0.97
13	600900	长江电力	184,025.00	0.90
14	600030	中信证券	179,163.00	0.88
15	600000	浦发银行	175,600.00	0.86
16	688008	澜起科技	163,304.82	0.80
17	603986	兆易创新	153,997.00	0.75
18	601601	中国太保	140,086.00	0.69
19	603259	药明康德	132,346.00	0.65
20	601211	国泰海通	131,577.00	0.64

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	6,682,872.86
卖出股票的收入（成交）总额	11,267,654.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,815.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,815.12

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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
382	29,933.81	6,437,825.00	56.30%	4,996,892.00	43.70%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

	单位：份
基金合同生效日（2022 年 8 月 30 日）基金份额总额	989,434,717.00
本报告期期初基金份额总额	17,434,717.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,434,717.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 5 月 9 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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，中信银行股份有限公司托管业务未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

报告期内，基金托管人未受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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	
申万宏源证券	2	13,972,507.70	77.84%	1,898.71	70.91%	-
广发证券	2	3,972,230.03	22.13%	777.99	29.06%	-
长江证券	1	5,790.00	0.03%	0.79	0.03%	-

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

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席

位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰基金管理有限公司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》	2026-02-02
2	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
3	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2026-05-09

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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
机构	1	2026 年 04 月 08 日至 2026 年 04 月 19 日，2026 年 05 月 22 日至 2026 年 05 月 25 日，2026 年 06 月 04 日至	2,347,643.00	4,027,017.00	4,210,787.00	2,163,873.00	18.92%

		2026 年 06 月 16 日					
	2	2026 年 01 月 23 日至 2026 年 01 月 25 日, 2026 年 01 月 30 日至 2026 年 02 月 04 日, 2026 年 02 月 11 日至 2026 年 02 月 23 日, 2026 年 03 月 02 日至 2026 年 03 月 03 日, 2026 年 03 月 05 日至 2026 年 03 月 09 日, 2026 年 03 月 11 日至 2026 年 03 月 15 日, 2026 年 03 月 23 日至 2026 年 03 月 23 日, 2026 年 03 月 27 日至 2026 年 03 月 31 日, 2026 年 05 月 14 日至 2026 年 05 月 17 日, 2026 年 05 月 20 日至 2026 年 05 月 21 日	3, 243, 023. 00	10, 021 , 006. 0 0	11, 204, 5 42. 00	2, 059, 487. 0 0	18. 01%
个人	1	2026 年 05 月 27 日至 2026 年 05 月 27 日	-	3, 000, 000. 00	3, 000, 00 0. 00	-	-
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

- 关于准予国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 国泰 MSCI 中国 A 股 ESG 通用交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 报告期内披露的各项公告
- 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