

上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 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 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 41 |
| 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 | 41 |
| 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 | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 42 |
| 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 | 44 |
| 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 | 44 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 44 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 44 |
| 8 基金份额持有人信息 | 47 |

| | | |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 8.2 | 期末上市基金前十名持有人 | 48 |
| 8.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 48 |
| 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 | 48 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 49 |
| 10 | 重大事件揭示 | 49 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 49 |
| 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 | 49 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 49 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 49 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 50 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 50 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 51 |
| 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 52 |
| 12 | 备查文件目录 | 52 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 52 |
| 12.2 | 存放地点 | 52 |
| 12.3 | 查阅方式 | 52 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称 | 上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 国泰上证 180 金融 ETF |
| 场内简称 | 金融 ETF |
| 基金主代码 | 510230 |
| 交易代码 | 510230 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 3 月 31 日 |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,252,808,035.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2011 年 5 月 23 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最小化。 |
| 投资策略 | 1、股票投资策略：本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，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；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、融资与转融通证券出借投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 上证 180 金融股指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 刘国华 | 许俊 |
| | 联系电话 | 021-31081600转 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com | fxjd_hq@bank-of-china.com |

| | | |
|--------|----------------------------------|---------------|
| 客户服务电话 | (021) 31089000, 400-888-8688 | 95566 |
| 传真 | 021-31081800 | 010-66594942 |
| 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 | 北京西城区复兴门内大街1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 | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 邮政编码 | 200082 | 100818 |
| 法定代表人 | 周向勇 | 葛海蛟 |

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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gtfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -46,641,467.15 |
| 本期利润 | 262,683,038.26 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0777 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.75% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.07% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,045,195,968.88 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3213 |
| 期末基金资产净值 | 3,335,835,215.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.0255 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 77.92% |

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -1.28% | 0.59% | -1.85% | 0.55% | 0.57% | 0.04% |
| 过去三个月 | 3.21% | 0.78% | 2.85% | 0.77% | 0.36% | 0.01% |
| 过去六个月 | 8.07% | 0.84% | 7.88% | 0.84% | 0.19% | 0.00% |
| 过去一年 | 5.45% | 0.93% | 2.23% | 0.93% | 3.22% | 0.00% |
| 过去三年 | -8.75% | 1.15% | -18.19% | 1.16% | 9.44% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 77.92% | 1.48% | 30.30% | 1.49% | 47.62% | -0.01% |

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

上证 180 金融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
 (2011 年 3 月 31 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：本基金的合同生效日为 2011 年 3 月 31 日。本基金在三个月建仓期结束时，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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 266 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 艾小军 | 国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰上证航天军工指 | 2014-01-13 | - | 23 年 | 硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | <p>数 (LOF)、国泰中证申万证券行业指数 (LOF)、芯片 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接、国泰中证全指证券公司 ETF 联接、国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰标普 500ETF、国泰中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理、投资总监 (量化)、金融工程总监</p> | | | <p>年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理, 2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理, 2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理, 2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 5 月至 2023 年 9 月任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰保本混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金 (由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 (由国泰结构转型灵活配</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理, 2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来)的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)的基金经理, 2019 年 7 月至 2021 年 1 月任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 7 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理, 2020 年 12 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来)的基金经理, 2021 年 5 月起兼任国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理, 2023 年 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理, 2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。</p> |
|--|--|--|--|---|

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，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

今年一季度，A 股市场在国内外多重因素的影响下，呈现出了较大的波动性。国内经济在新冠疫情常态化管理后逐步恢复，但复苏过程中仍面临一些挑战。经历了短期流动性风险的释放，上证指数一度跌到 2635 点低点；之后中央汇金持续大力增持场内宽基 ETF，并将增持标的扩大到包括中证 1000 等中小盘成长性标的 ETF，市场流动性危机逐步缓解。国内外在人工智能技术领域的大规模投入和进步，对相关板块带来持续提振。全季度来看，上证指数宽幅震荡、小幅收涨，大盘蓝筹股上涨，成长性中盘股及小盘股下跌。行业表现上，申万一级行业中表现靠前的为银行、石油石化、煤炭等高分红高股息防御板块，表现落后的为医药生物、计算机、电子等成长性板块。

二季度，A 股市场在国内外多重因素的影响下，呈现出了较大的波动性。宏观经济呈现出总体需求不足，国内整体经济仍然偏弱的态势；资金面上，资产荒蔓延，债券市场收益率持续下行。政策端，“国九条”和一系列配套政策文件落地，高股息的上游资源类行业以及具有龙头垄断属性的公用事业类行业吸引力上升。另一方面，全球 AI 浪潮仍然持续扩散，国内外对大语言模型的投入持续加大，国内半导体先进制程国产化进程稳步推进，经过前期的下跌的风险释放，包括半导体设备、存储以及光模块等板块迎来了一波估值修复行情；整体市场呈现高股息和 AI 科技板块哑铃型结构行情，投资者持股周期偏短，板块轮动加快。5 月下旬以来，由于美联储偏鹰派言论、欧美对部分产品加征关税、汇率贬值等外部因素扰动，加上国内金融数据等反映出内需仍然偏弱，二季度市场整体回调。行业表现上，按照申万一级行业划分，二季度表现靠前的为银行、公用事业、煤炭、石油石化等高分红高股息防御板块，表现落后的为计算机、社会服务、医药生物等。风格特征上，二季度市场风格偏向大市值、高分红，成长、消费有所回调。

上半年整体来看，上证指数持续震荡、小幅收跌 0.25%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数上涨 2.95%，沪深 300 指数微涨 0.89%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 8.96%，小盘股表征指数中证 1000 下跌 16.84%。板块上，新能源汽车、医药医疗科技占比较多的创业板指下跌 10.99%，硬科技占比较高的科创板 50 大幅下挫 16.42%。行业表现上，按照申万一级行业划分，上半年表现靠前的为银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等高分红高股息防御板块，表现落后的为计算机、商贸零售、社会服务、传媒、医药生物等；风格上，高股息红利风格相对占优。

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 8.07%，同期业绩比较基准收益率为 7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为国内经济将继续稳步恢复，政策层面的支持和市场信心的逐步修复将为 A 股市场提供支撑。宏观流动性角度，当前国内流动性环境易松难紧、美国高利率的宏观环境可能继续对红利风格构成一定利好，高股息、红利类板块可能依然值得关注。

同时，科技创新仍然是推动经济发展的关键力量，特别是在人工智能、半导体等前沿技术领域，预计将持续吸引投资者的关注。文生视频模型 Sora 面世，Gemini1.5、Chatwith RTX 发布，AI 创新持续爆发。AI 领域大语言模型的持续推出以及参数量的不断增长有望驱动模型训练端、推理端 GPU 芯片需求快速增长。

上游端，半导体自主可控重要性持续凸显，今明年晶圆厂存储厂保持有序扩产，国产化进展仍在加速。未来 3 年国产化仍然是行业最强主线之一。随着 AI 的持续发展，通信在训练/推理中的重

要性正在不断提升，产品迭代速度明显加速，国内光通信产业链在众多环节优势均较为明显。下游需求端，苹果预告 Apple Intelligence 等新品，全球消费电子需求有望回升，拉动芯片需求触底回暖，芯片及上游制造相关的半导体设备行业也值得关注。此外，军工板块也有望底部反转。当前随着影响行业运行的不利因素逐步消退，需求有望在 2025 迎来全面恢复，在“十四五”任务收官和中上游企业“十五五”需求前置落地的共同作用下，部分公司有望提前兑现订单，加上后续大规模合同持续推进，行业景气度或迎来抬升；近期，多家军工企业已公告新签订单。长期看，“百年未有之大变局”下，国防军工行业作为大国博弈下的必选消费，依然具有较好的景气度。

在全球层面，地缘政治的不确定性仍然是影响市场的重要因素。我们将持续关注全球政治经济形势的变化，以及其对 A 股市场的潜在影响。

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银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 13,120,966.42 | 7,211,969.38 |
| 结算备付金 | | 7,669.41 | 9,589.51 |
| 存出保证金 | | 5,835.66 | 100,828.19 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,330,328,264.32 | 3,258,701,598.76 |
| 其中：股票投资 | | 3,330,328,264.32 | 3,258,701,598.76 |
| 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 | | - | 511,184.21 |
| 应收股利 | | - | 896.00 |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | 4,114.31 | 22,772.45 |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产总计 | | 3,343,466,850.12 | 3,266,558,838.50 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 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 | | 5,161,131.05 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,372,027.95 | 1,368,917.52 |
| 应付托管费 | | 274,405.60 | 273,783.49 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 831.21 | 2,390.83 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 823,238.89 | 790,764.11 |
| 负债合计 | | 7,631,634.70 | 2,435,855.95 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 2,290,639,246.54 | 2,422,325,326.22 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 1,045,195,968.88 | 841,797,656.33 |
| 净资产合计 | | 3,335,835,215.42 | 3,264,122,982.55 |
| 负债和净资产总计 | | 3,343,466,850.12 | 3,266,558,838.50 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0255 元，基金份额总额 3,252,808,035.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 273,435,411.22 | 73,297,787.56 |
| 1.利息收入 | | 218,220.64 | 662,800.69 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 10,559.66 | 12,786.76 |
| 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 | | 207,660.98 | 650,013.93 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------------|----------------------|
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -36,136,669.52 | -57,058,253.84 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -58,345,031.09 | -113,415,636.90 |
| 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 | 22,208,361.57 | 56,357,383.06 |
| 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 | 309,324,505.41 | 129,738,266.29 |
| 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 | 29,354.69 | -45,025.58 |
| 减：二、营业总支出 | | 10,752,372.96 | 11,568,252.24 |
| 1. 管理人报酬 | | 8,440,884.22 | 9,087,960.97 |
| 2. 托管费 | | 1,688,176.86 | 1,817,592.23 |
| 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 | | 747.30 | 2,340.31 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.16 | 622,564.58 | 660,358.73 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 262,683,038.26 | 61,729,535.32 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 262,683,038.26 | 61,729,535.32 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 262,683,038.26 | 61,729,535.32 |

6.3 净资产变动表

会计主体：上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
|-----------|---------------------------------------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 2,422,325,326.22 | 841,797,656.33 | 3,264,122,982.55 |
| 二、本期期初净 | 2,422,325,326.22 | 841,797,656.33 | 3,264,122,982.55 |

| | | | |
|---|---------------------------------|------------------|-------------------|
| 资产 | | | |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -131,686,079.68 | 203,398,312.55 | 71,712,232.87 |
| （一）、综合收益总额 | - | 262,683,038.26 | 262,683,038.26 |
| （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） | -131,686,079.68 | -59,284,725.71 | -190,970,805.39 |
| 其中：1.基金申购款 | 449,281,920.00 | 185,350,206.53 | 634,632,126.53 |
| 2.基金赎回款 | -580,967,999.68 | -244,634,932.24 | -825,602,931.92 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 2,290,639,246.54 | 1,045,195,968.88 | 3,335,835,215.42 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 2,593,446,809.71 | 925,554,064.87 | 3,519,000,874.58 |
| 二、本期期初净资产 | 2,593,446,809.71 | 925,554,064.87 | 3,519,000,874.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 92,954,880.26 | 98,125,540.49 | 191,080,420.75 |
| （一）、综合收益总额 | - | 61,729,535.32 | 61,729,535.32 |
| （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） | 92,954,880.26 | 36,396,005.17 | 129,350,885.43 |
| 其中：1.基金申购款 | 820,397,236.55 | 332,781,401.40 | 1,153,178,637.95 |
| 2.基金赎回款 | -727,442,356.29 | -296,385,396.23 | -1,023,827,752.52 |

| | | | |
|---|------------------|------------------|------------------|
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 2,686,401,689.97 | 1,023,679,605.36 | 3,710,081,295.33 |

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：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证 180 金融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[2011]239 号《关于核准上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，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《上证 180 金融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 566,033,941.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 566,044,541.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,600.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司确定 2011 年 5 月 6 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 金融股指数收盘值为 3,336.396 点，本基金的基金资产净值为 536,366,537.07 元，折算前基金份额总额为 566,044,541.00 份，折算前基金份额净值为 0.948 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.28400990，折算后基金份额总额为 160,761,607.00 份，折算后基金份额净值为 3.336 元。本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2011 年 5 月 9 日完成了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上

交所”)上证债字[2011]第 95 号文审核同意, 本基金于 2011 年 5 月 23 日在上交所挂牌交易。

根据本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2020 年 8 月 17 日公布的《关于上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》, 本基金于 2020 年 8 月 14 日(份额拆分日)进行了基金份额拆分, 份额拆分日经本基金托管人中国银行股份有限公司复核的本基金拆分前的基金份额总额为 869,761,607 份, 基金份额净值为 5.7824 元。本基金基金份额拆分比例为 1:5, 拆分后基金份额总额为 4,348,808,035 份, 拆分后基金份额净值为 1.1565 元, 基金份额累计净值为 1.9462 元。本基金管理人已按照上述拆分比例, 对 2020 年 8 月 13 日(权益登记日)登记在册的各基金份额持有人的基金份额进行了拆分, 并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2020 年 8 月 14 日完成了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 180 金融股指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化; 主要投资范围为标的指数的成份股、备选成份股, 该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%; 本基金可少量投资于非标的指数成分股(含存托凭证)、新股(含存托凭证)、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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%。本基金的业绩比较基准为上证 180 金融股指数。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF, 募集成立了国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国泰上证 180 金融 ETF 联接基金”)。国泰上证 180 金融 ETF 联接基金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 2024 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《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《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《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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市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。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 13,120,966.42 |
| 等于：本金 | 13,120,119.25 |
| 加：应计利息 | 847.17 |
| 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 | 13,120,966.42 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|------|------------------|-----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 3,455,583,656.90 | - | 3,330,328,264.32 | -125,255,392.58 |
| 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 | 3,455,583,656.90 | - | 3,330,328,264.32 | -125,255,392.58 |

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |
| 应计转融通出借证券利息 | 4,114.31 |
| 合计 | 4,114.31 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 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 | 202,413.41 |
| 其中：交易所市场 | 202,413.41 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 114,372.44 |
| 应付指数使用费 | 506,453.04 |
| 合计 | 823,238.89 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,439,808,035.00 | 2,422,325,326.22 |
| 本期申购 | 638,000,000.00 | 449,281,920.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -825,000,000.00 | -580,967,999.68 |
| 本期末 | 3,252,808,035.00 | 2,290,639,246.54 |

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 | 1,626,289,077.39 | -784,491,421.06 | 841,797,656.33 |
| 本期期初 | 1,626,289,077.39 | -784,491,421.06 | 841,797,656.33 |
| 本期利润 | -46,641,467.15 | 309,324,505.41 | 262,683,038.26 |
| 本期基金份额交易产生的 | -85,491,672.61 | 26,206,946.90 | -59,284,725.71 |

| | | | |
|----------|------------------|-----------------|------------------|
| 变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 295,029,446.76 | -109,679,240.23 | 185,350,206.53 |
| 基金赎回款 | -380,521,119.37 | 135,886,187.13 | -244,634,932.24 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,494,155,937.63 | -448,959,968.75 | 1,045,195,968.88 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 8,848.22 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 1,592.01 |
| 其他 | 119.43 |
| 合计 | 10,559.66 |

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -5,877,321.30 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -52,467,709.79 |
| 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 | -58,345,031.09 |

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 133,355,719.11 |
| 减：卖出股票成本总额 | 138,938,210.67 |
| 减：交易费用 | 294,829.74 |
| 买卖股票差价收入 | -5,877,321.30 |

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 825,602,931.92 |

| | |
|-------------|----------------|
| 减：现金支付赎回款总额 | -1,873,148.08 |
| 减：赎回股票成本总额 | 879,943,789.79 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | -52,467,709.79 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 22,208,361.57 |
| 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 | 22,208,361.57 |

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 309,324,505.41 |
| ——股票投资 | 309,324,505.41 |
| ——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 | 309,324,505.41 |

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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| ETF 替代损益 | 29,354.69 |
| 合计 | 29,354.69 |

注：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 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 54,700.10 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 1,739.10 |
| 指数使用费 | 506,453.04 |
| 合计 | 622,564.58 |

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000.00 元，且当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。

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 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|------------------|
| 国泰基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国泰上证 180 金融 ETF 联接”） | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 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 2024年1月1日至2024年6月 30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,440,884.22 | 9,087,960.97 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 285.75 | - |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 8,440,598.47 | 9,087,960.97 |

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 2024年1月1日至2024年6月 30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,688,176.86 | 1,817,592.23 |

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | |
|-------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------|------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 278,813,715.00 | 8.57% | 255,813,715.00 | 7.44% |

6.4.10.6 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 | |
|-------|----------------------|----------|----------------------|-----------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 2023年1月1日至2023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 |
| 中国银行 | 13,120,966.42 | 8,848.22 | 15,638,134.67 | 10,981.57 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有基金托管人中国银行的 A 股普通股 21,324,112.00 股，成本总额为人民币 77,875,039.35 元，估值总额为人民币 98,517,397.44 元，占基金资产净值的比例为 2.95%。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有中银国际证券股份有限公司（托管人中国银行实施重大影响的联营企业）的 A 股普通股 1,525,364.00 股，成本总额为人民币 19,045,961.89 元，估值总额为人民币 13,850,305.12 元，占基金资产净值的比例为 0.42%。

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（2024 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 |
| 688692 | 达梦数据 | 2024-06-04 | 6 个月以上 | 新股锁定流通受限 | 86.96 | 174.93 | 175.00 | 15,218.00 | 30,612.75 | - |
| 603285 | 键邦股份 | 2024-06-28 | 1 个月内(含) | 网下中签流通受限 | 18.65 | 18.65 | 1,287.00 | 24,002.55 | 24,002.55 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024-06-26 | 1 个月内(含) | 网下中签流通受限 | 20.56 | 20.56 | 1,051.00 | 21,608.56 | 21,608.56 | - |
| 601033 | 永兴股份 | 2024-01-11 | 6 个月以上 | 新股锁定流通受限 | 16.20 | 15.96 | 1,258.00 | 20,379.60 | 20,077.68 | - |
| 688709 | 成都华微 | 2024-01-31 | 6 个月以上 | 新股锁定 | 15.69 | 18.79 | 1,045.00 | 16,396.05 | 19,635.55 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------|----------------|------------|----------------------|-------|-------|--------|--------------|---------------|---|
| | | | | 流通受限 | | | | | | |
| 60334 1 | 龙旗科技 | 2024-0 2-23 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 26.00 | 37.49 | 298.00 | 7,748. 00 | 11,172 .02 | - |
| 68869 1 | 灿芯股份 | 2024-0 4-02 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 19.86 | 42.51 | 247.00 | 4,905. 42 | 10,499 .97 | - |
| 68869 5 | 中创股份 | 2024-0 3-06 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 22.43 | 31.55 | 186.00 | 4,171. 98 | 5,868. 30 | - |
| 60332 5 | 博隆技术 | 2024-0 1-03 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 72.46 | 68.06 | 66.00 | 4,782. 36 | 4,491. 96 | - |
| 60338 1 | 永臻股份 | 2024-0 6-19 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 23.35 | 25.13 | 178.00 | 4,156. 30 | 4,473. 14 | - |
| 60334 4 | 星德胜 | 2024-0 3-13 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 19.18 | 22.66 | 182.00 | 3,490. 76 | 4,124. 12 | - |
| 60331 2 | 西典新能 | 2024-0 1-04 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 29.02 | 25.36 | 130.00 | 3,772. 60 | 3,296. 80 | - |
| 60308 2 | 北自科技 | 2024-0 1-23 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 21.28 | 29.49 | 107.00 | 2,276. 96 | 3,155. 43 | - |
| 60337 5 | 盛景微 | 2024-0 1-17 | 6 个月 以上 | 新股 锁定 流通 受限 | 38.18 | 38.90 | 72.00 | 2,748. 96 | 2,800. 80 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 出借到期日 | 期末 估值 单价 | 数量(单位: 股) | 期末估值总 额 |
|----|--------|------|---------------------------|----------------|--------------|--------------|
| 1 | 601998 | 中信银行 | 2024年6月26日 -2024年7月10日 | 6.70 | 300,000.00 | 2,010,000.00 |
| 2 | 601998 | 中信银行 | 2024年6月26日 -2024年7月10日 | 6.70 | 300,000.00 | 2,010,000.00 |
| 3 | 601995 | 中金公司 | 2024年6月20日 -2024年7月4日 | 29.61 | 31,400.00 | 929,754.00 |
| 4 | 601696 | 中银证券 | 2024年6月20日 -2024年7月4日 | 9.08 | 85,000.00 | 771,800.00 |
| 5 | 601696 | 中银证券 | 2024年6月20日 -2024年7月4日 | 9.08 | 74,200.00 | 673,736.00 |
| 6 | 601995 | 中金公司 | 2024年6月25日 -2024年7月9日 | 29.61 | 12,900.00 | 381,969.00 |
| 7 | 601995 | 中金公司 | 2024年6月25日 -2024年7月9日 | 29.61 | 12,900.00 | 381,969.00 |
| 8 | 601995 | 中金公司 | 2024年6月25日 -2024年7月9日 | 29.61 | 12,900.00 | 381,969.00 |
| 9 | 601136 | 首创证券 | 2024年6月25日 -2024年7月9日 | 20.46 | 16,000.00 | 327,360.00 |
| 10 | 601136 | 首创证券 | 2024年6月25日 -2024年7月9日 | 20.46 | 16,000.00 | 327,360.00 |
| 11 | 601136 | 首创证券 | 2024年6月21日 -2024年7月5日 | 20.46 | 15,000.00 | 306,900.00 |
| 12 | 601136 | 首创证券 | 2024年6月25日 -2024年7月9日 | 20.46 | 14,600.00 | 298,716.00 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 2024年6月18日 -2024年7月2日 | 34.19 | 7,400.00 | 253,006.00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|------------------------------------|-------|------------|--------------|
| 14 | 601059 | 信达证券 | 2024 年 6 月 20 日 -2024 年 7 月 4 日 | 14.21 | 16,000.00 | 227,360.00 |
| 15 | 601878 | 浙商证券 | 2024 年 6 月 25 日 -2024 年 7 月 9 日 | 10.72 | 12,000.00 | 128,640.00 |
| 16 | 601696 | 中银证券 | 2024 年 6 月 25 日 -2024 年 7 月 9 日 | 9.08 | 3,300.00 | 29,964.00 |
| 合计 | - | - | - | - | 929,600.00 | 9,440,503.00 |

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

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 180 金融股指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 金融股指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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国银行，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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2023 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 2024 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且不计息，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 2024 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 | 13,120,966.42 | - | - | - | 13,120,966.42 |
| 结算备付金 | 7,669.41 | - | - | - | 7,669.41 |
| 存出保证金 | 5,835.66 | - | - | - | 5,835.66 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,330,328,264.32 | 3,330,328,264.32 |
| 其他资产 | - | - | - | 4,114.31 | 4,114.31 |
| 资产总计 | 13,134,471.49 | - | - | 3,330,332,378.63 | 3,343,466,850. |

| | | | | | |
|-----------------------------|---------------|-------|-------|------------------|------------------|
| | | | | | 12 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 5,161,131.05 | 5,161,131.05 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,372,027.95 | 1,372,027.95 |
| 应付托管费 | - | - | - | 274,405.60 | 274,405.60 |
| 应交税费 | - | - | - | 831.21 | 831.21 |
| 其他负债 | - | - | - | 823,238.89 | 823,238.89 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,631,634.70 | 7,631,634.70 |
| 利率敏感度缺口 | 13,134,471.49 | - | - | 3,322,700,743.93 | 3,335,835,215.42 |
| 上年度末 2023 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 | 7,211,969.38 | - | - | - | 7,211,969.38 |
| 结算备付金 | 9,589.51 | - | - | - | 9,589.51 |
| 存出保证金 | 100,828.19 | - | - | - | 100,828.19 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,258,701,598.76 | 3,258,701,598.76 |
| 应收清算款 | - | - | - | 511,184.21 | 511,184.21 |
| 应收股利 | - | - | - | 896.00 | 896.00 |
| 其他资产 | - | - | - | 22,772.45 | 22,772.45 |
| 资产总计 | 7,322,387.08 | - | - | 3,259,236,451.42 | 3,266,558,838.50 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,368,917.52 | 1,368,917.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | 273,783.49 | 273,783.49 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,390.83 | 2,390.83 |
| 其他负债 | - | - | - | 790,764.11 | 790,764.11 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,435,855.95 | 2,435,855.95 |
| 利率敏感度缺口 | 7,322,387.08 | - | - | 3,256,800,595.47 | 3,264,122,982.55 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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 2024 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%(2023 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(2023 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, 包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 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 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 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 | 3,330,328,264. 32 | 99.83 | 3,258,701,598 .76 | 99.83 |
| 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 | 3,330,328,264. 32 | 99.83 | 3,258,701,598 .76 | 99.83 |

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：人民币万元） | |
| | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 16,651 | 增加约 16,170 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少约 16,651 | 减少约 16,170 |

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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 3,330,162,444.69 | 3,255,878,942.83 |
| 第二层次 | 45,611.11 | - |
| 第三层次 | 120,208.52 | 2,822,655.93 |
| 合计 | 3,330,328,264.32 | 3,258,701,598.76 |

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 2024 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(2023 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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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 634,632,126.53 元，其中包括以股票支付的申购款 628,409,925.96 元和以现金支付的申购款 6,222,200.57 元(于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 1,153,178,637.95 元，其中包括以股票支付的申购款 1,126,212,276.81 元和以现金支付的申购款 26,966,361.14 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 | 3,330,328,264.32 | 99.61 |
| | 其中：股票 | 3,330,328,264.32 | 99.61 |
| 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 | 13,128,635.83 | 0.39 |
| 8 | 其他各项资产 | 9,949.97 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 3,343,466,850.12 | 100.00 |

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 9,440,503.00 元，占基金资产净值比例为 0.28%。

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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 3,330,162,444.69 | 99.83 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,330,162,444.69 | 99.83 |

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|-----------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 98,760.93 | 0.00 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 46,981.02 | 0.00 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 20,077.68 | 0.00 |
| 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 | 165,819.63 | 0.00 |
|----|------------|------|

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 | 601318 | 中国平安 | 10,889,413 | 450,386,121.68 | 13.50 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 12,521,041 | 428,094,391.79 | 12.83 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 14,712,296 | 259,230,655.52 | 7.77 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 27,795,998 | 207,636,105.06 | 6.22 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 35,460,627 | 202,125,573.90 | 6.06 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 9,875,969 | 180,038,914.87 | 5.40 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 32,296,773 | 140,813,930.28 | 4.22 |
| 8 | 600919 | 江苏银行 | 14,853,535 | 110,361,765.05 | 3.31 |
| 9 | 601988 | 中国银行 | 21,324,112 | 98,517,397.44 | 2.95 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 11,878,868 | 97,763,083.64 | 2.93 |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 3,461,917 | 96,449,007.62 | 2.89 |
| 12 | 601169 | 北京银行 | 14,972,846 | 87,441,420.64 | 2.62 |
| 13 | 600837 | 海通证券 | 9,770,197 | 83,632,886.32 | 2.51 |
| 14 | 600016 | 民生银行 | 21,525,481 | 81,581,572.99 | 2.45 |
| 15 | 601688 | 华泰证券 | 5,178,040 | 64,155,915.60 | 1.92 |
| 16 | 601211 | 国泰君安 | 4,559,094 | 61,775,723.70 | 1.85 |
| 17 | 601818 | 光大银行 | 18,780,726 | 59,534,901.42 | 1.78 |
| 18 | 601658 | 邮储银行 | 11,229,807 | 56,935,121.49 | 1.71 |
| 19 | 601628 | 中国人寿 | 1,685,946 | 52,348,623.30 | 1.57 |
| 20 | 600999 | 招商证券 | 3,754,156 | 52,220,309.96 | 1.57 |
| 21 | 601939 | 建设银行 | 6,795,083 | 50,283,614.20 | 1.51 |
| 22 | 601916 | 浙商银行 | 15,252,200 | 42,096,072.00 | 1.26 |
| 23 | 600958 | 东方证券 | 5,290,628 | 40,208,772.80 | 1.21 |
| 24 | 601901 | 方正证券 | 4,999,500 | 38,646,135.00 | 1.16 |
| 25 | 601377 | 兴业证券 | 6,989,545 | 35,367,097.70 | 1.06 |
| 26 | 601788 | 光大证券 | 1,975,932 | 28,888,125.84 | 0.87 |
| 27 | 601995 | 中金公司 | 887,078 | 26,266,379.58 | 0.79 |
| 28 | 601336 | 新华保险 | 843,352 | 25,325,860.56 | 0.76 |
| 29 | 601066 | 中信建投 | 1,315,100 | 25,302,524.00 | 0.76 |
| 30 | 601881 | 中国银河 | 2,196,800 | 23,857,248.00 | 0.72 |
| 31 | 601555 | 东吴证券 | 4,024,100 | 23,742,190.00 | 0.71 |
| 32 | 601878 | 浙商证券 | 1,961,953 | 21,032,136.16 | 0.63 |
| 33 | 601998 | 中信银行 | 3,108,200 | 20,824,940.00 | 0.62 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 34 | 601319 | 中国人保 | 3,233,400 | 16,652,010.00 | 0.50 |
| 35 | 601696 | 中银证券 | 1,687,864 | 15,325,805.12 | 0.46 |
| 36 | 601059 | 信达证券 | 983,836 | 13,980,309.56 | 0.42 |
| 37 | 601136 | 首创证券 | 553,265 | 11,319,801.90 | 0.34 |

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

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 | 688692 | 达梦数据 | 175 | 30,612.75 | 0.00 |
| 2 | 603285 | 键邦股份 | 1,287 | 24,002.55 | 0.00 |
| 3 | 603350 | 安乃达 | 1,051 | 21,608.56 | 0.00 |
| 4 | 601033 | 永兴股份 | 1,258 | 20,077.68 | 0.00 |
| 5 | 688709 | 成都华微 | 1,045 | 19,635.55 | 0.00 |
| 6 | 603341 | 龙旗科技 | 298 | 11,172.02 | 0.00 |
| 7 | 688691 | 灿芯股份 | 247 | 10,499.97 | 0.00 |
| 8 | 688695 | 中创股份 | 186 | 5,868.30 | 0.00 |
| 9 | 603325 | 博隆技术 | 66 | 4,491.96 | 0.00 |
| 10 | 603381 | 永臻股份 | 178 | 4,473.14 | 0.00 |
| 11 | 603344 | 星德胜 | 182 | 4,124.12 | 0.00 |
| 12 | 603312 | 西典新能 | 130 | 3,296.80 | 0.00 |
| 13 | 603082 | 北自科技 | 107 | 3,155.43 | 0.00 |
| 14 | 603375 | 盛景微 | 72 | 2,800.80 | 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 | 601916 | 浙商银行 | 44,072,506.00 | 1.35 |
| 2 | 601901 | 方正证券 | 42,417,062.00 | 1.30 |
| 3 | 601998 | 中信银行 | 36,328,686.00 | 1.11 |
| 4 | 601059 | 信达证券 | 10,348,365.00 | 0.32 |
| 5 | 601136 | 首创证券 | 5,527,905.00 | 0.17 |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 1,290,493.00 | 0.04 |
| 7 | 601328 | 交通银行 | 1,222,782.00 | 0.04 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 1,031,244.00 | 0.03 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 983,708.00 | 0.03 |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 967,928.00 | 0.03 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 866,830.00 | 0.03 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 600016 | 民生银行 | 796,187.00 | 0.02 |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 724,187.00 | 0.02 |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 608,992.00 | 0.02 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 598,790.00 | 0.02 |
| 16 | 601169 | 北京银行 | 472,513.00 | 0.01 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 386,073.00 | 0.01 |
| 18 | 601988 | 中国银行 | 382,195.00 | 0.01 |
| 19 | 600999 | 招商证券 | 301,304.00 | 0.01 |
| 20 | 601658 | 邮储银行 | 278,120.00 | 0.01 |

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 | 601998 | 中信银行 | 30,525,156.00 | 0.94 |
| 2 | 600919 | 江苏银行 | 29,944,689.00 | 0.92 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 15,382,514.00 | 0.47 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 7,828,894.00 | 0.24 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 7,605,180.00 | 0.23 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 4,546,631.00 | 0.14 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 3,528,645.00 | 0.11 |
| 8 | 601328 | 交通银行 | 3,469,052.00 | 0.11 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 3,121,313.00 | 0.10 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 2,597,146.00 | 0.08 |
| 11 | 601988 | 中国银行 | 1,782,825.00 | 0.05 |
| 12 | 688347 | 华虹公司 | 1,774,658.14 | 0.05 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 1,704,585.00 | 0.05 |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 1,623,802.00 | 0.05 |
| 15 | 601169 | 北京银行 | 1,579,747.00 | 0.05 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 1,507,335.00 | 0.05 |
| 17 | 600837 | 海通证券 | 1,424,292.00 | 0.04 |
| 18 | 601211 | 国泰君安 | 1,210,350.00 | 0.04 |
| 19 | 601818 | 光大银行 | 1,060,414.00 | 0.03 |
| 20 | 601658 | 邮储银行 | 996,767.00 | 0.03 |

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 | 152,774,234.65 |
|---------------|----------------|

| | |
|---------------|----------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 133,355,719.11 |
|---------------|----------------|

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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“农业银行”、“工商银行”、“招商银行”、“中国银行”、“交通银行”、“浦发银行”、“兴业银行”、“中信证券”、“江苏银行”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

农业银行及其下属分支机构因项目贷款管理严重不审慎；管理不善导致金融许可证遗失；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料个人贷款管理不到位，信贷资金流入限制性领域；贷前调查不到位，未发现客户资金交易流水造假；固定资产贷款发放不审慎；贷款五级分类不准确；贷款资金未按约定用途使用等原因，受到监管机构公开处罚。

工商银行及其下属分支机构由于未严格审核银行承兑汇票业务贸易背景，严重违反审慎经营规则；迟报案件确认报告；贷款三查不到位，未发现借款人按揭首付款未实际缴付；贷前调查不尽职、贷后管理不到位未注册取得基金从业资格的人员销售基金；小微企业划型不准确；主承销的多期债务融资工具发行定价严重偏离市场合理水平，干扰了市场秩序等原因，受到监管机构公开处罚。

招商银行及其下属分支机构因理财业务未能有效穿透识别底层资产、信息披露不规范；未按规定承担小微企业押品评估费；未按规定承担房屋抵押登记费；未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费；小微企业规模划型依据不足；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为等受到金管局及派出机构、地方外管局、央行分支机构罚款、警告、没收违法所得等处罚。

中国银行及下属分支机构因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；信贷资金用途管控不到位，贷款资金回流至母公司；信用卡汽车分期业务管理不审慎；员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则；员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则；违规报送统计报表等原因，受到监管机构公开处罚。

交通银行及下属分支机构因个人经营性贷款“三查”不到位；小微业务统一授信管理不到位；超授权为金融机构开办表外融资；未按规定办理经常项目外汇业务；贷前调查不审慎，超过实际资金需求发放贷款，导致信贷资金回流至借款人；票据业务办理不审慎，严重违反审慎经营规则；未严格执行受托支付管理、贷后管理不到位等原因，受到监管机构公开处罚。

浦发银行下属分支机构因数据治理存在缺陷；授信业务管理不到位；房地产贷款业务管理不审慎；并购贷款管理不审慎；贷款“三查”不尽职导致贷款资金违规流入限制性领域；贸易背景真实性审查不到位；现金清分外包风险管控存在重大缺陷；现金管理活动严重不审慎；虚增存款业务规模；贷款业务浮利分费；贷前调查不尽职、贷后管理不到位；未对集团客户统一授信；违反规定办理资本项目资金收付；票据业务贸易背景真实性审核不严等原因，受到监管机构公开处罚。

兴业银行及下属分支机构因通过不正当方式虚增存贷款；贷后管理不到位，个人经营性贷款违规用

于购买理财产品；贷前调查未尽职，未发现个人收入流水造假；流动贷款资金偿还委托贷款；衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；债券交易超授权；通过资产管理产品开展不正当交易；债券投资五级分类不准确；债券投资风险管理未独立于当地分支行，受到监管机构公开处罚。

中信证券及其下属分支机构因知悉客户融券目的是定增套利，配合其提供融券服务；保荐公司上市当年即亏损；担任重大资产重组财务顾问过程违规；担任保荐机构过程违规；机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等受到证监会及派出机构、沪深交易所罚款、没收违法所得、警告、监管谈话、警示函等处罚。

江苏银行及下属分支机构因代客衍生交易产品管理不到位；员工行为管理不到位；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；对金融产品作出虚假或者引人误解的宣传；违反账户管理规定；违反流通人民币管理规定；违反人民币反假有关规定；占压财政存款或者资金；违反国库科目设置和使用规定；未按规定履行客户身份识别义务等原因，受到监管机构公开处罚。

该情况发生后，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规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 | 5,835.66 |
| 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 | 4,114.31 |

| | | |
|---|----|----------|
| 9 | 合计 | 9,949.97 |
|---|----|----------|

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的 公允价值 | 占基金资产净 值比例(%) | 流通受限情 况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|----------------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 253,006.00 | 0.01 | 转融通证券 出借业务的 股票 |

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 | 688692 | 达梦数据 | 30,612.75 | 0.00 | 新股锁定 |
| 2 | 603285 | 键邦股份 | 24,002.55 | 0.00 | 网下中签 |
| 3 | 603350 | 安乃达 | 21,608.56 | 0.00 | 网下中签 |
| 4 | 601033 | 永兴股份 | 20,077.68 | 0.00 | 新股锁定 |
| 5 | 688709 | 成都华微 | 19,635.55 | 0.00 | 新股锁定 |

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有 的基金份 额 | 持有人结构 | | | | | |
|--------------|-------------------|----------------------|------------|--------------------|------------|--------------------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | | 金融 ETF 联接 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份 额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比 例 |
| 8,713 | 373,328.1 3 | 2,709,316, 830.00 | 83.29% | 264,677, 490.00 | 8.14% | 278,813,715 .00 | 8.57% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|--|------------------|----------|
| 1 | 中央汇金投资有限责任公司 | 2,563,560,500.00 | 78.81% |
| 2 | 中国银河证券股份有限公司 | 19,669,522.00 | 0.60% |
| 3 | 中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红 | 16,569,500.00 | 0.51% |
| 4 | 中国民生银行股份有限公司—广发核心优选六个月持有期混合型基金中基金（FOF） | 9,157,300.00 | 0.28% |
| 5 | 广发证券股份有限公司 | 7,668,816.00 | 0.24% |
| 6 | 孙小航 | 6,750,000.00 | 0.21% |
| 7 | 方正证券股份有限公司 | 6,214,304.00 | 0.19% |
| 8 | 李烨 | 6,024,300.00 | 0.19% |
| 9 | 招商证券股份有限公司 | 5,998,263.00 | 0.18% |
| 10 | 中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金 | 5,788,000.00 | 0.18% |
| - | 国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 278,813,715.00 | 8.57% |

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

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（2011 年 3 月 31 日）基金份额总额 | 566,044,541.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,439,808,035.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 638,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 825,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 3,252,808,035.00 |

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：

2024 年 3 月 27 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二十六次会议审议通过，周向勇先生离任公司总经理、转任董事长并代为履行总经理职务。

2024 年 7 月 25 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二十九次会议审议通过，聘任李昇先生担任本基金管理人总经理。

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：

经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合

伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中金财富 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2 | 198,051,918.77 | 69.45% | 145,744.29 | 69.45% | - |
| 银河证券 | 2 | 87,133,315.34 | 30.55% | 64,120.43 | 30.55% | - |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

10.7.2 基金租用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 |
| 中金财富 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |

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高级管理人员变更公 | 《中国证券报》 | 2024-03-27 |

| | | |
|---|--|--|
| 告 | | |
|---|--|--|

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 | 2024年01月01日至2024年06月30日 | 2,563,560.50 | - | - | 2,563,560.50 | 78.81% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于核准上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金募集的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

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

基金托管人住所或办公场所。

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

二〇二四年八月三十日