

国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:江苏银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 03 月 31 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。本年度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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月20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。

本报告期自2025年12月02日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 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	72
8.7 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	72

8.8 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.....	72
8.9 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.....	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	73
§ 9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.3 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情况.....	75
§ 10 开放式基金份额变动.....	75
§ 11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件.....	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
12.1 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.....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78

§ 13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式.....	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰海通中证全指指数增强	
基金主代码	025308	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 02 日	
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	710,225,097.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通中证全指指数增强 A	国泰海通中证全指指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025308	025309
报告期末下属分级基金的份额总额	214,398,443.07 份	495,826,654.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证全指指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金的投资策略主要包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：中证全指指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> <p>本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

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		上海国泰海通证券资产管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	田作全
	联系电话	021-38676022	025-58588321
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		95521	95319
传真		021-38871190	025-58588155
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	南京市中华路 26 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	南京市中华路 26 号
邮政编码		200011	210001
法定代表人		陶耿	葛仁余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gthtzc.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日	
	国泰海通中证全指指数增强 A	国泰海通中证全指指数增强 C
本期已实现收益	1,419,859.55	3,124,659.46
本期利润	2,722,258.17	6,136,120.24

加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0124
本期加权平均净值利润率	1.26%	1.23%
本期基金份额净值增长率	1.27%	1.24%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	1,419,859.55	3,124,659.46
期末可供分配基金份额利润	0.0066	0.0063
期末基金资产净值	217,120,701.24	501,962,774.38
期末基金份额净值	1.0127	1.0124
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	1.27%	1.24%

注：（1）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。

（2）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。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

（4）本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

国泰海通中证全指指数增强 A 净值表现

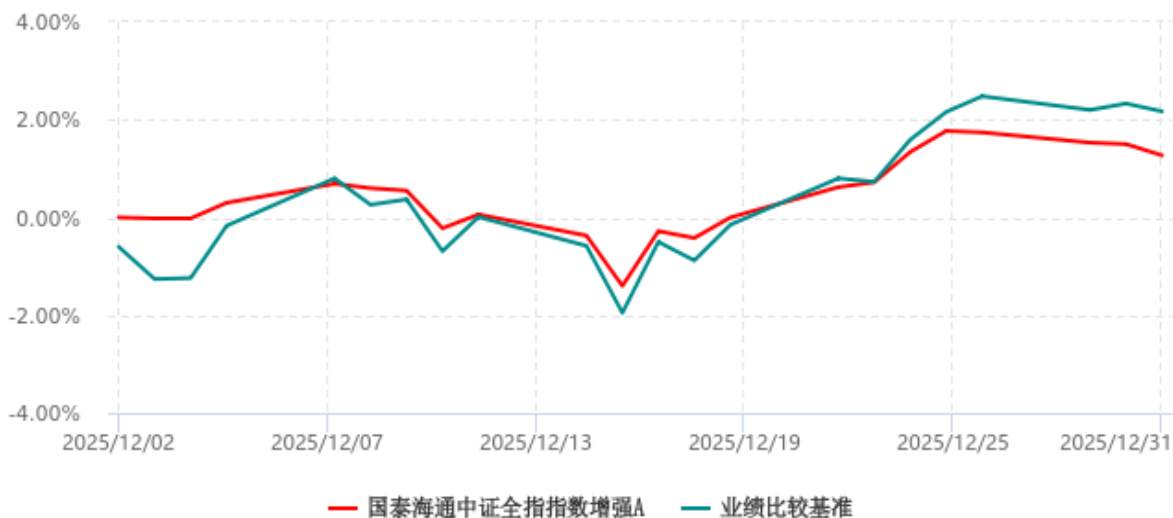
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.27%	0.47%	2.17%	0.75%	-0.90%	-0.28%

国泰海通中证全指指数增强 C 净值表现

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
自基金合同生效起至今	1.24%	0.47%	2.17%	0.75%	-0.93%	-0.28%

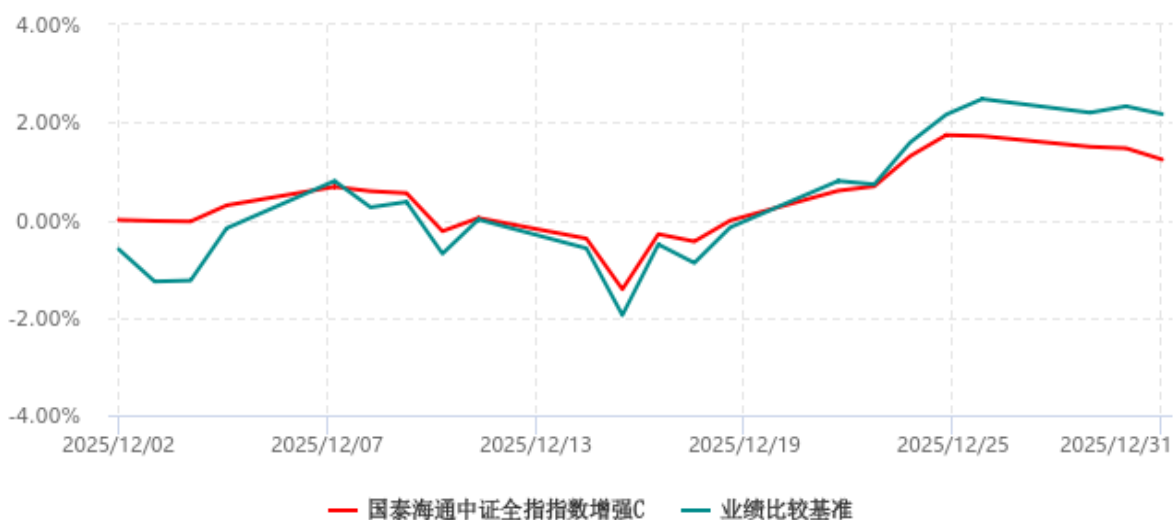
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰海通中证全指指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月02日-2025年12月31日)



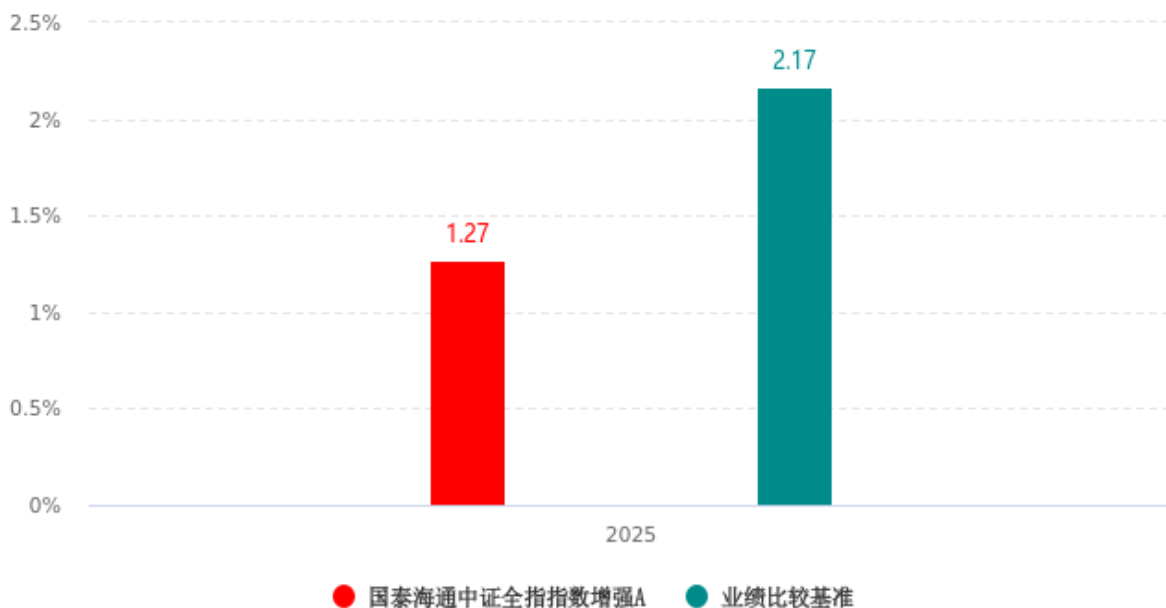
注：1、本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰海通中证全指指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月02日-2025年12月31日)

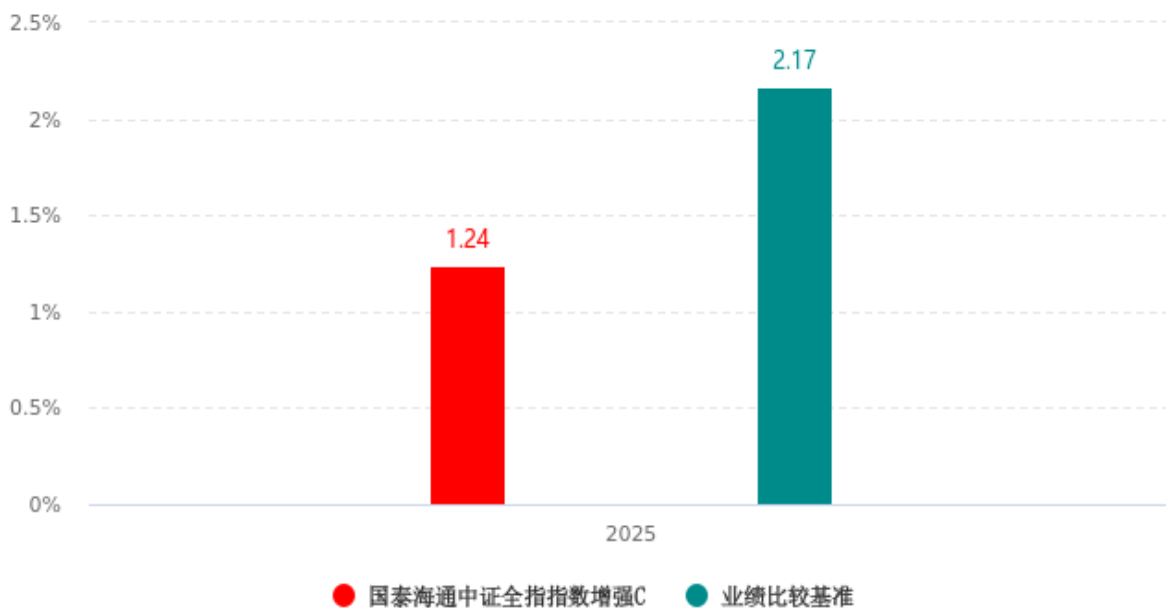


注：1、本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 02 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 02 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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

上海国泰海通证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理国泰海通现金管家货币市场基金、国泰海通 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰海通君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰海通中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰海通君得明混合型证券投资基金、国泰海通东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰海通君得利短债债券型证券投资基金、国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰海通 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰海通安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金等 71 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
胡崇海	国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通量化选股混合发起基金经理，国泰海通沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰海通中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理，国泰海通红利量化选股混合基金经理，国泰海通中证 A500 指数增强基金经理，国泰海通上证科创板综合价格指数增强基金经理，国泰海通稳健泰裕债券发起基金经	2025-12-02	-	14 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任本公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通创业板综指增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
邓雅琨	国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证香港科技指数发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通高股息投资指数发起（QDII）基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2025-12-02	-	4 年	邓雅琨，卡耐基梅隆大学计算金融专业，硕士研究生。2021 年 3 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理。
刘晟	国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2025-12-02	-	4 年	刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰海通证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的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% 的次数为 1 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

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

2025 年，A 股市场在全球资本市场波动加剧的背景下表现出独立韧性，整体呈现震荡上行行情，期间在外部冲击后快速修复，科技主线贯穿全年。年初市场情绪相对低迷，受特朗普关税政策预期及海外流动性收紧冲击，北向资金持续流出，指数超预期调整并伴随成交量萎靡。春节后受 DeepSeek 发布影响，叠加春晚催化人形机器人主题，及春季躁动行情演绎，科技板块领涨，推动市场情绪快速修复；随后在获利了结压力下，3 月市场缩量回调。进入二季度，受美国“对等关税”政策冲击，全球资本市场动荡加剧，上证综指在 4 月 7 日单日大幅下挫 7.34%，市场风险偏好骤降。随后国内政策快速响应，市场在稳增长和稳市场政策预期推动下逐步企稳，指数开启估值驱动的快速反弹。三季度，在中美经贸缓和预期与“反内卷”政策预期驱动下，上证综指自 7 月开启单边上行。8 月量价齐升、主题扩散，从 AI 算力带动至全面牛市，市场情绪显著升温，上证综指创出十年新高。9 月，在避险情绪回升、境内外资金降杠杆与对冲基金减仓的扰动下，指数呈震荡分化态势。10 月美关税预期反复，叠加三季报超预期，指数承压后修复并突破 4000 点。11 月步入业绩与政策的空窗期，中上旬高位震荡，由普涨转向结构轮动，中下旬阶段性调整加深。12 月中旬，指数下探至阶段性低位，随后受美联储降息落地、AI 算力调整结束、十五五落地预期强化等催化，叠加年末交易情绪回暖，上证综指以 11 连阳收官并维持在相对高位。全年 A 股市场表现亮眼，中证全指绝对收益可观（涨幅 24.60%），强于主要宽基沪深 300 指数（涨幅 17.66%），落后于

中证 500 指数（涨幅 30.39%）和中证 1000 指数（涨幅 27.49%）。

2025 年市场整体呈现出小盘风格跑赢大盘、成长风格跑赢价值的特点，至年底阶段市场风格才略趋均衡。从主要风险因子的走势来看，成长因子自年初以来一直表现强势，动量因子紧随其后，第四季度表现强劲，而流动性和反转因子则在年内持续为负收益。行业层面，大多数行业在 2025 年录得正收益，其中有色金属板块表现居首，整体上涨 94.7%，这主要得益于美联储降息引发的美元指数下跌、此起彼伏的全球地缘政治风险，以及半导体、新能源等新兴产业对特定有色金属的刚性需求；通信行业以 84.8% 的涨幅次之。全年仅食品饮料和煤炭行业录得负收益。Alpha 表现方面，全年整体上价量因子的表现优于基本面因子。

本基金充分发挥管理人在多基准、多策略上长期布局的优势，在复杂多变的市场环境下一方面对每一个基准的策略做精做细，另一方面强化管理人的量化策略配置能力。在单个策略层面，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强每一个策略表现，我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在策略配置层面，尽量追求高风险偏好的科技成长和低风险偏好的红利价值的动态均衡，并通过适当配置全市场最大化 Alpha 策略和中小市值指数增强策略来达到持仓在大中小市值上的均衡，以此进一步增强投资者的持有体验。作为全市场选股的量化基金，相比于通过控制仓位来做择时操作，我们一方面通过较稳定的仓位运行来最大程度地兑现我们稳定的 Alpha 能力，另一方面主要通过调整风格迥异的策略配置比例来尽量协调波动和收益的关系。值得一提的是，量化投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期耐心持有。我们认为当前市场整体估值依然处于历史相对合理区间，未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段强化量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通中证全指指数增强 A 基金份额净值为 1.0127 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.27%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%；截至报告期末国泰海通中证全指指数增强 C 基金份额净值为 1.0124 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.24%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%。

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 2026 年，预计全球增长仍处于温和区间，通胀在主要经济体继续回落但黏性仍在，货币政策更可能从高位维持转向谨慎渐进的宽松，但大国博弈与地缘扰动仍可能对企业信心、全球贸易与风险偏好造成阶段性冲击。国内方面，政策更强调稳增长、促消费、稳预期与防范重点领域风险的平衡，在房地产调整与地方财政约束仍待修复的背景下，宏观政策预计偏支持取向，货币环境或维持相对宽松，并保留降准降息等政策工具空间。A 股方面，流动性边际改善有较强确定性，若与

盈利企稳形成共振，系统性估值中枢有望更稳定，但监管对杠杆与过度投机的逆周期约束可能更常态化，市场特征或体现为更重基本面、波动中枢偏高、结构性机会主导。行业层面，景气与政策共振的方向仍可能围绕 AI 算力与应用、半导体与高端制造、机器人与航天军工等硬科技链条展开，同时在利率下行与分红回报偏好提升的环境中，高股息资产、部分公用与资源品、金融等或具备配置价值；此外，促消费与服务消费扩容、以及医药创新与出海相关领域也可能在盈利改善与风险偏好回升时贡献结构性机会，但需关注外部贸易摩擦、国内需求修复节奏、地产链条尾部风险及市场拥挤带来的回撤压力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现上海国泰海通证券资产管理有限公司在基金的投资运作、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存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《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违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2600301 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p>

	<p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	虞京京 楚济铭
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
审计报告日期	2026-03-27

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	146,999,930.10
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	572,790,066.06

其中：股票投资		572,790,066.06
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		-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-
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	7.4.7.4	-
资产总计		719,789,996.16
负债和净资产	附注号	本期末 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		-
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		453,384.97

应付托管费		85,009.69
应付销售服务费		158,252.58
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	7.4.7.5	9,873.30
负债合计		706,520.54
净资产：		
实收基金	7.4.7.6	710,225,097.21
未分配利润	7.4.7.7	8,858,378.41
净资产合计		719,083,475.62
负债和净资产总计		719,789,996.16

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 710,225,097.21 份。其中国泰海通中证全指指数增强 A 基金份额净值 1.0127 元，基金份额总额 214,398,443.07 份；国泰海通中证全指指数增强 C 基金份额净值 1.0124 元，基金份额总额 495,826,654.14 份。

2、本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		9,564,898.95
1. 利息收入		137,439.53
其中：存款利息收入	7.4.7.8	137,381.07

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		58.46
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,113,600.02
其中：股票投资收益	7.4.7.9	4,864,543.01
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	7.4.7.10	249,057.01
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	4,313,859.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、营业总支出		706,520.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	453,384.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	85,009.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	158,252.58
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	7.4.7.12	9,873.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,858,378.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,858,378.41
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		8,858,378.41

注：本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，无上年度同期可比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	710,225,097.21	-	710,225,097.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	8,858,378.41	8,858,378.41
（一）、综合收益总额	-	8,858,378.41	8,858,378.41
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	710,225,097.21	8,858,378.41	719,083,475.62

注：本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，无上年度同期可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿

陶耿

王红莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰海通国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2025]1611号)批准,由上海国泰海通证券资产管理有限公司(以下简称“国泰海通资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国泰海通国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发售,基金合同于2025年12月2日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定,首次设立募集规模为710,225,097.21份基金份额,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振字第2500111号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为710,225,097.21份基金份额,其中认购资金利息折合201,095.20份基金份额。本基金的基金管理人为国泰海通资管,托管人为江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)。

根据《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费,将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股(包括存托凭证、下同)、备选成份股(包括存托凭证、下同)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(包括可交换债券、可分离交易债券)、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%,投资于中证全指指数成分股及其备选成分股的资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证全指指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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 7.4.2 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况、自 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、基金投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不

同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准：

(1) 各类基金份额之间由于是否收取销售服务费的不同将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入基金份

额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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》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) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；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。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。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、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。

d) 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) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	100,359,033.59
等于：本金	100,330,964.79
加：应计利息	28,068.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	46,640,896.51
等于：本金	46,640,077.34
加：应计利息	819.17
减：坏账准备	-
合计	146,999,930.10

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	568,476,206.66	-	572,790,066.06	4,313,859.40
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	568,476,206.66	-	572,790,066.06	4,313,859.40

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	9,873.30
合计	9,873.30

7.4.7.6 实收基金

国泰海通中证全指指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	214,398,443.07	214,398,443.07
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	214,398,443.07	214,398,443.07
-----	----------------	----------------

国泰海通中证全指指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	495,826,654.14	495,826,654.14
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	495,826,654.14	495,826,654.14

7.4.7.7 未分配利润

国泰海通中证全指指数增强 A

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,419,859.55	1,302,398.62	2,722,258.17
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,419,859.55	1,302,398.62	2,722,258.17

国泰海通中证全指指数增强 C

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,124,659.46	3,011,460.78	6,136,120.24
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,124,659.46	3,011,460.78	6,136,120.24

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	133,877.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,503.15
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	137,381.07

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	245,599,627.24
减：卖出股票成本总额	240,401,360.93
减：交易费用	333,723.30
买卖股票差价收入	4,864,543.01

7.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	249,057.01
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	249,057.01

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月
------	---

	31 日
1. 交易性金融资产	4,313,859.40
——股票投资	4,313,859.40
——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	4,313,859.40

7.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	-
信息披露费	9,873.30
证券出借违约金	-
合计	9,873.30

7.4.7.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9.2 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
上海国泰海通证券资产管理有限公司(以下简称“国泰海通资管”)	基金管理人
江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)	基金托管人、代销机构
国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、代销机构

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	453,384.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	212,175.48
应支付基金管理人的净管理费	241,209.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	85,009.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰海通中证全指指数 增强 A	国泰海通中证全指指数 增强 C	合计
国泰海通证券	-	2,928.89	2,928.89
江苏银行	-	75,982.19	75,982.19
合计	-	78,911.08	78,911.08

注：本基金份额分为不同的类别，其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2025 年 12 月 02 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	100,359,033.59	133,877.92

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	筹划发行股份购买资产	78.81	2026-01-15	86.69	1,300	97,276.00	102,453.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	筹划发行股份购买资产	272.72	2026-01-05	278.00	1,200	325,296.87	327,264.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 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。本基金的活期存款存放在本基金的托管行江苏银行股份有限公司，其他银行存款为国金证券股份有限公司保证金，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 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模

式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2025 年 12 月 31 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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所交易，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 7.4.12。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%。

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

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	146,999,930.1 0	-	-	-	146,999,930.1 0
交易性金融 资产	-	-	-	572,790,066.0 6	572,790,066.0 6
资产总计	146,999,930.1 0	-	-	572,790,066.0 6	719,789,996.1 6
负债					
应付管理人 报酬	-	-	-	453,384.97	453,384.97
应付托管费	-	-	-	85,009.69	85,009.69
应付销售服 务费	-	-	-	158,252.58	158,252.58
其他负债	-	-	-	9,873.30	9,873.30
负债总计	-	-	-	706,520.54	706,520.54
利率敏感度 缺口	146,999,930.1 0	-	-	572,083,545.5 2	719,083,475.6 2

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或行权日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	572,790,066.06	79.66
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	572,790,066.06	79.66

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日
第一层次	572,360,349.06
第二层次	429,717.00
第三层次	-
合计	572,790,066.06

7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	572,790,066.06	79.58
	其中：股票	572,790,066.06	79.58
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	146,999,930.10	20.42
8	其他各项资产	-	-
9	合计	719,789,996.16	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净值的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,259,988.00	0.45
B	采矿业	21,231,431.00	2.95
C	制造业	366,695,826.24	50.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,589,143.00	1.33
E	建筑业	5,438,757.00	0.76
F	批发和零售业	16,131,901.00	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	14,802,180.00	2.06
H	住宿和餐饮业	1,723,212.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,096,781.62	6.97
J	金融业	49,205,197.20	6.84
K	房地产业	5,654,290.00	0.79
L	租赁和商务服务业	7,457,166.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	11,412,635.00	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	7,092,768.00	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	341,303.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,176,623.00	0.30
S	综合	480,864.00	0.07

	合计	572,790,066.06	79.66
--	----	----------------	-------

8.2.2 报告期末（积极投资）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。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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

8.3.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	66,333	24,361,457.58	3.39
2	300308	中际旭创	18,100	11,041,000.00	1.54
3	300502	新易盛	18,200	7,842,016.00	1.09
4	300274	阳光电源	33,900	5,798,256.00	0.81
5	688256	寒武纪	3,800	5,151,090.00	0.72
6	300433	蓝思科技	169,300	5,124,711.00	0.71
7	300394	天孚通信	23,400	4,750,902.00	0.66
8	300604	长川科技	46,700	4,731,177.00	0.66
9	688041	海光信息	20,681	4,641,023.21	0.65
10	688981	中芯国际	36,000	4,421,880.00	0.61
11	601398	工商银行	520,500	4,127,565.00	0.57
12	601077	渝农商行	614,500	3,969,670.00	0.55
13	600019	宝钢股份	518,300	3,861,335.00	0.54
14	601229	上海银行	381,600	3,854,160.00	0.54
15	600188	兖矿能源	277,900	3,654,385.00	0.51
16	300760	迈瑞医疗	19,100	3,637,595.00	0.51
17	300438	鹏辉能源	64,200	3,416,724.00	0.48
18	300033	同花顺	10,600	3,415,108.00	0.47
19	300008	天海防务	394,300	3,111,027.00	0.43
20	601898	中煤能源	248,300	3,088,852.00	0.43
21	300127	银河磁体	100,300	3,042,099.00	0.42
22	688336	三生国健	50,005	2,978,797.85	0.41
23	002004	华邦健康	622,000	2,973,160.00	0.41

24	601225	陕西煤业	138,900	2,961,348.00	0.41
25	688396	华润微	54,500	2,880,870.00	0.40
26	601939	建设银行	306,000	2,839,680.00	0.39
27	300709	精研科技	56,600	2,669,256.00	0.37
28	601009	南京银行	232,100	2,652,903.00	0.37
29	300775	三角防务	84,800	2,577,920.00	0.36
30	601998	中信银行	328,200	2,527,140.00	0.35
31	301526	国际复材	351,500	2,460,500.00	0.34
32	000895	双汇发展	92,800	2,456,416.00	0.34
33	600795	国电电力	484,300	2,440,872.00	0.34
34	601169	北京银行	444,300	2,434,764.00	0.34
35	600598	北大荒	161,800	2,418,910.00	0.34
36	000990	诚志股份	303,300	2,402,136.00	0.33
37	300034	钢研高纳	122,000	2,388,760.00	0.33
38	600016	民生银行	613,000	2,347,790.00	0.33
39	300358	楚天科技	239,600	2,345,684.00	0.33
40	301408	华人健康	126,000	2,338,560.00	0.33
41	302132	中航成飞	29,600	2,338,400.00	0.33
42	300735	光弘科技	93,900	2,334,354.00	0.32
43	301529	福赛科技	20,400	2,307,240.00	0.32
44	688385	复旦微电	31,100	2,292,070.00	0.32
45	601318	中国平安	33,500	2,291,400.00	0.32
46	300171	东富龙	145,200	2,279,640.00	0.32
47	301150	中一科技	54,100	2,271,659.00	0.32
48	688365	光云科技	131,600	2,220,092.00	0.31
49	688629	华丰科技	21,800	2,181,308.00	0.30
50	601107	四川成渝	357,700	2,174,816.00	0.30
51	300132	青松股份	242,900	2,115,659.00	0.29
52	601857	中国石油	202,100	2,103,861.00	0.29
53	300299	富春股份	291,900	2,072,490.00	0.29
54	300570	太辰光	17,900	2,068,345.00	0.29
55	600267	海正药业	204,700	2,024,483.00	0.28
56	300620	光库科技	13,700	2,014,585.00	0.28
57	300172	中电环保	368,800	2,009,960.00	0.28
58	300139	晓程科技	65,300	1,982,508.00	0.28
59	601988	中国银行	344,900	1,976,277.00	0.27
60	002758	浙农股份	195,900	1,972,713.00	0.27
61	300014	亿纬锂能	29,800	1,959,648.00	0.27
62	300476	胜宏科技	6,800	1,955,544.00	0.27
63	600015	华夏银行	284,100	1,951,767.00	0.27
64	300129	泰胜风能	185,200	1,937,192.00	0.27
65	600007	中国国贸	97,500	1,932,450.00	0.27
66	300219	鸿利智汇	261,000	1,881,810.00	0.26

67	688772	珠海冠宇	86,800	1,868,804.00	0.26
68	301038	深水规院	79,300	1,859,585.00	0.26
69	600039	四川路桥	185,600	1,846,720.00	0.26
70	600018	上港集团	340,600	1,846,052.00	0.26
71	688779	五矿新能	244,600	1,832,054.00	0.25
72	300206	理邦仪器	142,800	1,826,412.00	0.25
73	688062	迈威生物	46,900	1,804,243.00	0.25
74	688208	道通科技	48,065	1,768,792.00	0.25
75	601298	青岛港	211,600	1,764,744.00	0.25
76	601117	中国化学	224,600	1,691,238.00	0.24
77	600526	菲达环保	310,500	1,664,280.00	0.23
78	300043	星辉娱乐	290,800	1,643,020.00	0.23
79	000726	鲁泰 A	230,600	1,641,872.00	0.23
80	688700	东威科技	46,400	1,636,992.00	0.23
81	301365	矩阵股份	68,600	1,635,424.00	0.23
82	688158	优刻得	58,217	1,635,315.53	0.23
83	300059	东方财富	70,400	1,631,872.00	0.23
84	300945	曼卡龙	100,700	1,627,312.00	0.23
85	301175	中科环保	275,300	1,627,023.00	0.23
86	300017	网宿科技	158,600	1,625,650.00	0.23
87	300221	银禧科技	155,500	1,604,760.00	0.22
88	300101	振芯科技	56,300	1,600,609.00	0.22
89	688347	华虹公司	14,800	1,596,476.00	0.22
90	600031	三一重工	75,500	1,595,315.00	0.22
91	300296	利亚德	251,600	1,590,112.00	0.22
92	300867	圣元环保	82,900	1,580,074.00	0.22
93	603259	药明康德	17,100	1,549,944.00	0.22
94	300726	宏达电子	30,100	1,532,391.00	0.21
95	000019	深粮控股	218,700	1,519,965.00	0.21
96	000601	韶能股份	319,000	1,499,300.00	0.21
97	600742	富维股份	149,500	1,495,000.00	0.21
98	300548	长芯博创	10,400	1,476,800.00	0.21
99	300016	北陆药业	184,200	1,462,548.00	0.20
100	002111	威海广泰	137,800	1,449,656.00	0.20
101	300805	电声股份	135,900	1,433,745.00	0.20
102	301611	珂玛科技	16,600	1,423,118.00	0.20
103	300917	特发服务	36,200	1,415,420.00	0.20
104	300259	新天科技	317,600	1,410,144.00	0.20
105	300753	爱朋医疗	50,800	1,409,700.00	0.20
106	300277	海联讯	107,600	1,404,180.00	0.20
107	002398	垒知集团	249,700	1,403,314.00	0.20
108	300513	恒实科技	147,500	1,399,775.00	0.19
109	688499	利元亨	24,099	1,390,994.28	0.19

110	688111	金山办公	4,516	1,386,728.12	0.19
111	688222	成都先导	59,000	1,383,550.00	0.19
112	301082	久盛电气	77,100	1,380,090.00	0.19
113	600546	山煤国际	136,500	1,377,285.00	0.19
114	300768	迪普科技	73,900	1,369,367.00	0.19
115	601665	齐鲁银行	237,000	1,360,380.00	0.19
116	000157	中联重科	156,800	1,353,184.00	0.19
117	002091	江苏国泰	149,400	1,349,082.00	0.19
118	601088	中国神华	33,200	1,344,600.00	0.19
119	301073	君亭酒店	51,300	1,336,878.00	0.19
120	300644	南京聚隆	36,100	1,332,451.00	0.19
121	301536	星宸科技	22,200	1,330,002.00	0.18
122	002916	深南电路	5,700	1,324,053.00	0.18
123	600814	杭州解百	163,200	1,321,920.00	0.18
124	600300	维维股份	371,900	1,305,369.00	0.18
125	301236	软通动力	27,400	1,299,582.00	0.18
126	601899	紫金矿业	37,700	1,299,519.00	0.18
127	001389	广合科技	15,500	1,265,265.00	0.18
128	688387	信科移动	97,900	1,262,910.00	0.18
129	002222	福晶科技	22,400	1,262,016.00	0.18
130	688023	安恒信息	24,500	1,259,545.00	0.18
131	600519	贵州茅台	900	1,239,462.00	0.17
132	601326	秦港股份	354,200	1,236,158.00	0.17
133	688148	芳源股份	140,300	1,230,431.00	0.17
134	688322	奥比中光	13,700	1,228,479.00	0.17
135	002142	宁波银行	43,280	1,215,735.20	0.17
136	600585	海螺水泥	55,600	1,215,416.00	0.17
137	600887	伊利股份	42,300	1,209,780.00	0.17
138	688280	精进电动	137,300	1,194,510.00	0.17
139	300381	溢多利	183,200	1,194,464.00	0.17
140	603365	水星家纺	56,700	1,192,968.00	0.17
141	300973	立高食品	27,600	1,186,800.00	0.17
142	300905	宝丽迪	36,400	1,173,172.00	0.16
143	301316	慧博云通	26,200	1,170,616.00	0.16
144	688001	华兴源创	38,509	1,162,201.62	0.16
145	300289	利德曼	166,600	1,161,202.00	0.16
146	600380	健康元	100,100	1,156,155.00	0.16
147	300774	倍杰特	60,700	1,153,300.00	0.16
148	301308	江波龙	4,700	1,150,748.00	0.16
149	600573	惠泉啤酒	96,300	1,148,859.00	0.16
150	300434	金石亚药	111,000	1,141,080.00	0.16
151	002281	光迅科技	16,300	1,140,185.00	0.16
152	301138	华研精机	29,300	1,136,840.00	0.16

153	300662	科锐国际	44,700	1,132,251.00	0.16
154	002950	奥美医疗	103,600	1,131,312.00	0.16
155	002440	闰土股份	150,300	1,122,741.00	0.16
156	300509	新美星	86,200	1,106,808.00	0.15
157	300201	海伦哲	161,200	1,100,996.00	0.15
158	300248	新开普	88,500	1,098,285.00	0.15
159	300407	凯发电气	95,300	1,078,796.00	0.15
160	301116	益客食品	98,700	1,078,791.00	0.15
161	688331	荣昌生物	13,800	1,073,502.00	0.15
162	300771	智莱科技	69,200	1,072,600.00	0.15
163	300408	三环集团	23,400	1,070,550.00	0.15
164	300063	天龙集团	123,500	1,058,395.00	0.15
165	688141	杰华特	24,300	1,055,349.00	0.15
166	688435	英方软件	22,500	1,052,325.00	0.15
167	688608	恒玄科技	4,620	1,048,462.80	0.15
168	300698	万马科技	24,700	1,040,611.00	0.14
169	688443	智翔金泰	37,900	1,032,396.00	0.14
170	600908	无锡银行	173,300	1,027,669.00	0.14
171	600309	万华化学	13,400	1,027,512.00	0.14
172	600999	招商证券	61,700	1,026,688.00	0.14
173	600690	海尔智家	39,100	1,020,119.00	0.14
174	002811	郑中设计	68,100	1,010,604.00	0.14
175	000755	山西高速	201,000	1,009,020.00	0.14
176	300741	华宝股份	54,200	1,007,036.00	0.14
177	688146	中船特气	24,800	1,001,920.00	0.14
178	301158	德石股份	44,700	999,939.00	0.14
179	300240	飞力达	132,100	996,034.00	0.14
180	002010	传化智联	171,200	994,672.00	0.14
181	688275	万润新能	13,150	991,510.00	0.14
182	300047	天源迪科	78,800	988,940.00	0.14
183	300382	斯莱克	63,400	986,504.00	0.14
184	002116	中国海诚	95,600	982,768.00	0.14
185	002614	奥佳华	134,200	981,002.00	0.14
186	002558	巨人网络	22,600	978,354.00	0.14
187	002414	高德红外	66,400	974,088.00	0.14
188	600011	华能国际	130,200	971,292.00	0.14
189	688484	南芯科技	23,800	967,708.00	0.13
190	688220	翱捷科技	11,700	966,537.00	0.13
191	300450	先导智能	19,300	964,614.00	0.13
192	688182	灿勤科技	32,300	953,496.00	0.13
193	300113	顺网科技	47,000	951,280.00	0.13
194	002174	游族网络	77,000	942,480.00	0.13
195	603185	弘元绿能	30,700	936,350.00	0.13

196	600757	长江传媒	105,400	935,952.00	0.13
197	601187	厦门银行	126,000	924,840.00	0.13
198	300747	锐科激光	34,200	924,426.00	0.13
199	300418	昆仑万维	22,100	921,570.00	0.13
200	600782	新钢股份	236,200	916,456.00	0.13
201	300458	全志科技	21,800	916,254.00	0.13
202	600100	同方股份	102,600	915,192.00	0.13
203	002940	昂利康	27,200	911,744.00	0.13
204	688255	凯尔达	24,800	908,424.00	0.13
205	300702	天宇股份	37,200	877,920.00	0.12
206	301518	长华化学	24,600	875,022.00	0.12
207	002556	辉隆股份	143,100	864,324.00	0.12
208	002033	丽江股份	94,400	863,760.00	0.12
209	301511	德福科技	23,600	844,644.00	0.12
210	301509	金凯生科	24,700	834,366.00	0.12
211	300283	温州宏丰	109,400	823,782.00	0.11
212	300995	奇德新材	19,900	822,069.00	0.11
213	688521	芯原股份	6,000	821,820.00	0.11
214	002734	利民股份	51,500	820,910.00	0.11
215	000501	武商集团	80,800	817,696.00	0.11
216	300932	三友联众	68,100	816,519.00	0.11
217	600028	中国石化	131,700	813,906.00	0.11
218	002967	广电计量	36,900	812,169.00	0.11
219	300503	昊志机电	12,600	802,872.00	0.11
220	688008	澜起科技	6,800	801,040.00	0.11
221	300872	天阳科技	38,500	791,560.00	0.11
222	601126	四方股份	26,000	782,080.00	0.11
223	300696	爱乐达	24,400	778,604.00	0.11
224	601997	贵阳银行	131,700	773,079.00	0.11
225	688135	利扬芯片	27,400	760,624.00	0.11
226	688162	巨一科技	24,600	757,680.00	0.11
227	301022	海泰科	22,800	754,452.00	0.10
228	603986	兆易创新	3,500	749,875.00	0.10
229	688584	上海合晶	33,784	741,220.96	0.10
230	300596	利安隆	17,500	738,675.00	0.10
231	301128	强瑞技术	7,300	736,643.00	0.10
232	600075	新疆天业	147,600	730,620.00	0.10
233	603587	地素时尚	54,200	724,112.00	0.10
234	600027	华电国际	144,500	716,720.00	0.10
235	688373	盟科药业	118,500	715,740.00	0.10
236	600389	江山股份	28,200	712,896.00	0.10
237	688525	佰维存储	6,200	711,698.00	0.10
238	300207	欣旺达	27,200	711,280.00	0.10

239	688343	云天励飞	9,300	707,544.00	0.10
240	002625	光启技术	14,500	707,020.00	0.10
241	002365	永安药业	46,700	696,764.00	0.10
242	000166	申万宏源	131,800	694,586.00	0.10
243	301607	富特科技	17,300	693,903.00	0.10
244	688249	晶合集成	20,900	693,671.00	0.10
245	300454	深信服	6,000	690,960.00	0.10
246	300619	金银河	15,700	689,230.00	0.10
247	688031	星环科技	6,329	684,734.51	0.10
248	300214	日科化学	101,900	680,692.00	0.09
249	600282	南钢股份	129,000	678,540.00	0.09
250	300118	东方日升	46,100	675,826.00	0.09
251	002367	康力电梯	83,300	671,398.00	0.09
252	002137	实益达	77,500	664,950.00	0.09
253	688333	铂力特	5,900	657,909.00	0.09
254	300567	精测电子	7,200	656,640.00	0.09
255	300681	英搏尔	26,200	656,572.00	0.09
256	300328	宜安科技	38,300	653,781.00	0.09
257	603167	渤海轮渡	69,000	650,670.00	0.09
258	688678	福立旺	26,900	650,442.00	0.09
259	603496	恒为科技	23,800	649,264.00	0.09
260	300858	科拓生物	38,700	648,999.00	0.09
261	688088	虹软科技	13,100	648,450.00	0.09
262	601890	亚星锚链	63,000	648,270.00	0.09
263	603967	中创物流	46,800	642,564.00	0.09
264	300765	新诺威	17,800	642,046.00	0.09
265	300884	狄耐克	43,100	637,880.00	0.09
266	002697	红旗连锁	107,200	636,768.00	0.09
267	601319	中国人保	71,100	636,345.00	0.09
268	300871	回盛生物	30,600	634,338.00	0.09
269	002386	天原股份	115,600	627,708.00	0.09
270	300065	海兰信	34,500	626,865.00	0.09
271	002593	日上集团	106,000	626,460.00	0.09
272	300693	盛弘股份	16,300	623,964.00	0.09
273	300553	集智股份	15,400	622,006.00	0.09
274	002878	元隆雅图	33,900	617,658.00	0.09
275	300153	科泰电源	21,200	616,284.00	0.09
276	600897	厦门空港	35,800	615,760.00	0.09
277	300719	安达维尔	33,700	610,307.00	0.08
278	688108	赛诺医疗	31,400	604,136.00	0.08
279	002624	完美世界	36,800	603,152.00	0.08
280	600741	华域汽车	30,000	600,000.00	0.08
281	601919	中远海控	39,400	598,092.00	0.08

282	300999	金龙鱼	20,700	594,918.00	0.08
283	002195	岩山科技	83,800	594,142.00	0.08
284	002587	奥拓电子	87,800	593,528.00	0.08
285	688183	生益电子	6,173	590,694.37	0.08
286	002603	以岭药业	34,600	590,622.00	0.08
287	002293	罗莱生活	57,400	589,498.00	0.08
288	600660	福耀玻璃	9,100	589,407.00	0.08
289	002028	思源电气	3,800	587,442.00	0.08
290	001914	招商积余	54,900	586,332.00	0.08
291	600717	天津港	130,200	581,994.00	0.08
292	301026	浩通科技	20,500	580,970.00	0.08
293	000729	燕京啤酒	51,400	577,222.00	0.08
294	002023	海特高新	42,600	576,804.00	0.08
295	600571	信雅达	36,100	573,268.00	0.08
296	002612	朗姿股份	27,900	570,276.00	0.08
297	688202	美迪西	10,100	569,640.00	0.08
298	601600	中国铝业	46,500	568,230.00	0.08
299	002204	大连重工	74,100	566,865.00	0.08
300	688191	智洋创新	17,600	566,368.00	0.08
301	002487	大金重工	10,900	566,037.00	0.08
302	688237	超卓航科	11,560	563,550.00	0.08
303	688095	福昕软件	6,300	562,401.00	0.08
304	002755	奥赛康	34,200	558,486.00	0.08
305	002626	金达威	28,200	555,822.00	0.08
306	600366	宁波韵升	40,200	554,358.00	0.08
307	001979	招商蛇口	64,000	552,960.00	0.08
308	002946	新乳业	29,600	548,488.00	0.08
309	601918	新集能源	82,400	544,664.00	0.08
310	000555	神州信息	32,700	541,185.00	0.08
311	300801	泰和科技	19,500	538,785.00	0.07
312	000050	深天马 A	59,600	538,188.00	0.07
313	301109	军信股份	35,700	535,500.00	0.07
314	000919	金陵药业	66,600	529,470.00	0.07
315	300898	熊猫乳品	19,600	527,828.00	0.07
316	300624	万兴科技	7,400	522,810.00	0.07
317	300485	赛升药业	49,400	522,652.00	0.07
318	300409	道氏技术	23,200	521,768.00	0.07
319	300347	泰格医药	9,200	521,640.00	0.07
320	688046	药康生物	33,700	517,632.00	0.07
321	601818	光大银行	147,900	516,171.00	0.07
322	688591	泰凌微	12,117	515,699.52	0.07
323	300759	康龙化成	18,100	514,583.00	0.07
324	002242	九阳股份	49,200	513,648.00	0.07

325	600787	中储股份	91,100	511,982.00	0.07
326	600478	科力远	74,000	509,860.00	0.07
327	001337	四川黄金	18,100	504,266.00	0.07
328	300380	安硕信息	11,900	492,303.00	0.07
329	301558	三态股份	59,800	487,370.00	0.07
330	600785	新华百货	35,400	479,670.00	0.07
331	300664	鹏鹞环保	88,800	475,968.00	0.07
332	301338	凯格精机	5,400	475,794.00	0.07
333	603687	大胜达	49,700	473,641.00	0.07
334	300375	鹏翎股份	90,000	473,400.00	0.07
335	002461	珠江啤酒	50,500	469,145.00	0.07
336	601083	锦江航运	41,900	467,604.00	0.07
337	600926	杭州银行	30,000	458,400.00	0.06
338	300546	雄帝科技	17,400	455,706.00	0.06
339	600353	旭光电子	28,200	454,584.00	0.06
340	003031	中瓷电子	6,200	453,592.00	0.06
341	600150	中国船舶	13,600	452,336.00	0.06
342	600288	大恒科技	30,000	449,400.00	0.06
343	600739	辽宁成大	40,100	448,318.00	0.06
344	688512	慧智微	40,166	448,252.56	0.06
345	000768	中航西飞	17,600	446,688.00	0.06
346	000333	美的集团	5,700	445,455.00	0.06
347	000933	神火股份	16,200	445,014.00	0.06
348	300515	三德科技	22,600	444,316.00	0.06
349	002097	山河智能	35,700	443,037.00	0.06
350	600808	马钢股份	104,600	441,412.00	0.06
351	002931	锋龙股份	13,900	440,630.00	0.06
352	002275	桂林三金	31,200	439,920.00	0.06
353	600176	中国巨石	25,400	434,340.00	0.06
354	300403	汉宇集团	30,000	432,300.00	0.06
355	301286	侨源股份	10,200	431,358.00	0.06
356	600346	恒力石化	19,100	430,323.00	0.06
357	601328	交通银行	59,300	429,925.00	0.06
358	688561	奇安信	12,037	428,276.46	0.06
359	600710	苏美达	39,500	426,995.00	0.06
360	688321	微芯生物	14,500	423,690.00	0.06
361	688668	鼎通科技	3,400	421,600.00	0.06
362	002016	世荣兆业	72,700	420,206.00	0.06
363	603107	上海汽配	28,200	418,206.00	0.06
364	000949	新乡化纤	75,900	417,450.00	0.06
365	600276	恒瑞医药	7,000	416,990.00	0.06
366	000983	山西焦煤	64,900	416,658.00	0.06
367	000011	深物业 A	46,200	416,262.00	0.06

368	300390	天华新能	7,600	415,036.00	0.06
369	600517	国网英大	68,400	411,084.00	0.06
370	600335	国机汽车	63,100	410,781.00	0.06
371	000651	格力电器	10,200	410,244.00	0.06
372	301095	广立微	5,700	408,747.00	0.06
373	300602	飞荣达	12,300	407,868.00	0.06
374	000725	京东方 A	96,800	407,528.00	0.06
375	688311	盟升电子	8,909	406,250.40	0.06
376	300708	聚灿光电	45,600	404,928.00	0.06
377	600801	华新建材	16,400	402,456.00	0.06
378	688536	思瑞浦	2,500	399,700.00	0.06
379	301339	通行宝	27,400	398,396.00	0.06
380	000513	丽珠集团	11,500	396,290.00	0.06
381	600392	盛和资源	18,400	396,152.00	0.06
382	300087	荃银高科	33,600	392,448.00	0.05
383	000959	首钢股份	79,800	391,020.00	0.05
384	600572	康恩贝	87,500	390,250.00	0.05
385	002258	利尔化学	29,300	382,365.00	0.05
386	002489	浙江永强	99,600	381,468.00	0.05
387	002818	富森美	34,300	381,073.00	0.05
388	688609	九联科技	37,100	378,791.00	0.05
389	002286	保龄宝	42,300	378,162.00	0.05
390	300733	西菱动力	19,900	373,921.00	0.05
391	000001	平安银行	32,700	373,107.00	0.05
392	600160	巨化股份	9,700	372,674.00	0.05
393	688458	美芯晟	9,364	371,188.96	0.05
394	600873	梅花生物	36,500	369,745.00	0.05
395	002863	今飞凯达	62,700	368,049.00	0.05
396	688209	英集芯	18,300	364,902.00	0.05
397	300018	中元股份	33,100	364,100.00	0.05
398	600057	厦门象屿	42,300	360,396.00	0.05
399	301110	青木科技	5,400	357,372.00	0.05
400	603682	锦和商管	54,200	357,178.00	0.05
401	688388	嘉元科技	8,700	356,526.00	0.05
402	601066	中信建投	13,300	356,041.00	0.05
403	688506	百利天恒	1,100	355,410.00	0.05
404	002406	远东传动	44,500	353,330.00	0.05
405	688720	艾森股份	5,000	351,900.00	0.05
406	002560	通达股份	34,700	349,776.00	0.05
407	002550	千红制药	44,300	348,198.00	0.05
408	688362	甬矽电子	10,700	346,787.00	0.05
409	301382	蜂助手	9,700	343,768.00	0.05
410	600258	首旅酒店	20,500	343,375.00	0.05

411	002926	华西证券	37,000	343,360.00	0.05
412	300980	祥源新材	10,500	342,615.00	0.05
413	002128	电投能源	12,200	340,502.00	0.05
414	601949	中国出版	52,600	339,270.00	0.05
415	688166	博瑞医药	6,900	338,514.00	0.05
416	300806	斯迪克	11,000	338,140.00	0.05
417	300145	南方泵业	71,000	335,120.00	0.05
418	300927	江天化学	14,300	333,333.00	0.05
419	688199	久日新材	14,093	332,172.01	0.05
420	300378	鼎捷数智	7,300	330,398.00	0.05
421	688012	中微公司	1,200	327,264.00	0.05
422	002803	吉宏股份	20,000	327,200.00	0.05
423	002101	广东鸿图	26,500	326,480.00	0.05
424	603013	亚普股份	13,200	325,644.00	0.05
425	301358	湖南裕能	5,000	323,300.00	0.04
426	688235	百济神州	1,200	322,320.00	0.04
427	301305	朗坤科技	14,300	321,321.00	0.04
428	000425	徐工机械	27,700	320,766.00	0.04
429	301048	金鹰重工	28,000	319,200.00	0.04
430	002042	华孚时尚	74,700	317,475.00	0.04
431	002746	仙坛股份	52,100	316,247.00	0.04
432	600740	山西焦化	84,000	315,840.00	0.04
433	600036	招商银行	7,500	315,750.00	0.04
434	000100	TCL 科技	68,600	311,444.00	0.04
435	300913	兆龙互连	5,900	310,517.00	0.04
436	601728	中国电信	49,100	309,330.00	0.04
437	000581	威孚高科	15,000	309,300.00	0.04
438	688219	会通股份	24,900	309,258.00	0.04
439	002027	分众传媒	41,800	308,066.00	0.04
440	688187	时代电气	6,000	307,740.00	0.04
441	600126	杭钢股份	37,400	305,184.00	0.04
442	688543	国科军工	4,901	304,205.07	0.04
443	000902	新洋丰	19,300	301,466.00	0.04
444	601368	绿城水务	60,400	299,584.00	0.04
445	002415	海康威视	10,000	298,400.00	0.04
446	300400	劲拓股份	15,000	297,000.00	0.04
447	300940	南极光	10,400	295,984.00	0.04
448	688009	中国通号	54,100	295,927.00	0.04
449	003015	日久光电	18,900	294,840.00	0.04
450	688128	中国电研	10,100	293,708.00	0.04
451	000833	粤桂股份	15,000	291,900.00	0.04
452	300654	世纪天鸿	29,300	290,363.00	0.04
453	002185	华天科技	26,400	289,608.00	0.04

454	600549	厦门钨业	7,000	287,420.00	0.04
455	603115	海星股份	15,300	286,263.00	0.04
456	300971	博亚精工	11,700	286,182.00	0.04
457	688602	康鹏科技	32,800	284,704.00	0.04
458	603697	有友食品	22,900	280,525.00	0.04
459	688590	新致软件	15,000	279,900.00	0.04
460	002172	澳洋健康	70,400	279,488.00	0.04
461	600642	申能股份	35,900	279,302.00	0.04
462	688631	莱斯信息	4,100	279,128.00	0.04
463	300363	博腾股份	12,000	278,880.00	0.04
464	600654	中安科	73,900	278,603.00	0.04
465	600469	风神股份	40,100	278,294.00	0.04
466	600170	上海建工	103,600	274,540.00	0.04
467	301217	铜冠铜箔	7,900	270,812.00	0.04
468	603367	辰欣药业	15,500	268,460.00	0.04
469	600590	泰豪科技	28,400	267,244.00	0.04
470	000830	鲁西化工	16,100	266,777.00	0.04
471	603917	合力科技	18,000	266,220.00	0.04
472	688084	晶品特装	3,200	264,960.00	0.04
473	688661	和林微纳	5,100	263,976.00	0.04
474	688660	电气风电	15,500	263,655.00	0.04
475	600547	山东黄金	6,800	263,228.00	0.04
476	300348	长亮科技	17,000	263,160.00	0.04
477	000060	中金岭南	44,600	260,910.00	0.04
478	300684	中石科技	5,300	260,866.00	0.04
479	002156	通富微电	6,900	260,130.00	0.04
480	601991	大唐发电	73,500	256,515.00	0.04
481	300979	华利集团	5,100	256,071.00	0.04
482	688601	力芯微	6,000	255,540.00	0.04
483	603296	华勤技术	2,800	254,072.00	0.04
484	300598	诚迈科技	5,500	252,835.00	0.04
485	300130	新国都	9,100	252,343.00	0.04
486	300953	震裕科技	1,500	252,030.00	0.04
487	002077	大港股份	16,900	251,303.00	0.03
488	300921	南凌科技	10,900	250,373.00	0.03
489	002436	兴森科技	11,800	249,806.00	0.03
490	600884	杉杉股份	18,300	247,233.00	0.03
491	002008	大族激光	6,000	247,140.00	0.03
492	300732	设研院	32,600	244,500.00	0.03
493	002117	东港股份	17,700	244,437.00	0.03
494	301270	汉仪股份	6,500	242,970.00	0.03
495	300124	汇川技术	3,200	241,056.00	0.03
496	002537	海联金汇	26,600	240,996.00	0.03

497	301439	泓淋电力	16,100	240,051.00	0.03
498	600685	中船防务	8,400	238,980.00	0.03
499	603569	长久物流	31,000	237,150.00	0.03
500	300341	麦克奥迪	14,500	236,930.00	0.03
501	300036	超图软件	13,000	236,080.00	0.03
502	600738	丽尚国潮	45,700	235,812.00	0.03
503	002402	和而泰	6,000	234,720.00	0.03
504	600104	上汽集团	15,400	234,388.00	0.03
505	688428	诺诚健华	11,300	231,876.00	0.03
506	300832	新产业	4,100	230,625.00	0.03
507	002399	海普瑞	19,300	227,547.00	0.03
508	600030	中信证券	7,900	226,809.00	0.03
509	300269	联建光电	34,100	223,696.00	0.03
510	300489	光智科技	4,400	223,520.00	0.03
511	002011	盾安环境	17,300	219,364.00	0.03
512	000993	闽东电力	18,300	219,234.00	0.03
513	601138	工业富联	3,500	217,175.00	0.03
514	300102	乾照光电	7,800	214,968.00	0.03
515	300787	海能实业	18,200	213,850.00	0.03
516	601216	君正集团	44,000	212,080.00	0.03
517	000792	盐湖股份	7,500	211,200.00	0.03
518	002761	浙江建投	24,500	209,965.00	0.03
519	301230	泓博医药	7,000	209,090.00	0.03
520	600704	物产中大	37,300	207,761.00	0.03
521	688372	伟测科技	1,900	207,271.00	0.03
522	000783	长江证券	25,400	207,010.00	0.03
523	300473	德尔股份	6,900	205,482.00	0.03
524	601901	方正证券	26,200	204,360.00	0.03
525	600415	小商品城	12,800	204,160.00	0.03
526	603341	龙旗科技	4,800	202,848.00	0.03
527	600686	金龙汽车	11,400	202,236.00	0.03
528	002246	北化股份	10,900	196,418.00	0.03
529	300920	润阳科技	4,200	193,494.00	0.03
530	002404	嘉欣丝绸	27,600	193,476.00	0.03
531	002511	中顺洁柔	22,500	192,600.00	0.03
532	000539	粤电力 A	43,000	190,060.00	0.03
533	000421	南京公用	27,500	190,025.00	0.03
534	600805	悦达投资	34,800	188,964.00	0.03
535	002250	联化科技	14,100	188,658.00	0.03
536	000039	中集集团	18,600	187,674.00	0.03
537	600320	振华重工	36,300	186,945.00	0.03
538	603787	新日股份	13,200	185,592.00	0.03
539	603799	华友钴业	2,700	184,302.00	0.03

540	600115	中国东航	30,500	183,000.00	0.03
541	000597	东北制药	35,000	182,700.00	0.03
542	301000	肇民科技	4,600	181,102.00	0.03
543	300136	信维通信	2,895	179,490.00	0.02
544	600602	云赛智联	9,600	179,424.00	0.02
545	601038	一拖股份	12,600	178,542.00	0.02
546	300882	万胜智能	9,400	176,720.00	0.02
547	300049	福瑞医科	2,500	176,025.00	0.02
548	688143	长盈通	3,500	175,735.00	0.02
549	688136	科兴制药	5,500	174,185.00	0.02
550	600971	恒源煤电	27,900	174,096.00	0.02
551	000589	贵州轮胎	33,400	173,012.00	0.02
552	601881	中国银河	11,000	172,920.00	0.02
553	002054	德美化工	23,300	171,954.00	0.02
554	603236	移远通信	1,800	171,738.00	0.02
555	601022	宁波远洋	18,700	171,479.00	0.02
556	300873	海晨股份	7,800	171,366.00	0.02
557	601519	大智慧	13,300	171,171.00	0.02
558	002273	水晶光电	6,800	170,816.00	0.02
559	688303	大全能源	6,300	168,966.00	0.02
560	002966	苏州银行	20,300	168,287.00	0.02
561	688327	云从科技	11,600	166,692.00	0.02
562	600968	海油发展	43,300	166,272.00	0.02
563	300193	佳士科技	18,500	165,575.00	0.02
564	603638	艾迪精密	8,600	162,798.00	0.02
565	300859	西域旅游	4,400	162,668.00	0.02
566	300310	宜通世纪	27,400	161,934.00	0.02
567	002824	和胜股份	8,300	161,020.00	0.02
568	002772	众兴菌业	10,800	157,572.00	0.02
569	600183	生益科技	2,200	157,102.00	0.02
570	301507	民生健康	10,200	156,672.00	0.02
571	300435	中泰股份	7,000	155,540.00	0.02
572	601200	上海环境	19,300	155,365.00	0.02
573	603585	苏利股份	8,200	154,652.00	0.02
574	603486	科沃斯	1,900	153,292.00	0.02
575	601999	出版传媒	22,300	153,201.00	0.02
576	300554	三超新材	6,600	153,054.00	0.02
577	600273	嘉化能源	17,500	152,950.00	0.02
578	002488	金固股份	17,400	152,946.00	0.02
579	301052	果麦文化	4,000	152,760.00	0.02
580	600153	建发股份	16,500	152,625.00	0.02
581	301321	翰博高新	8,000	152,400.00	0.02
582	300140	节能环境	22,500	152,325.00	0.02

583	000422	湖北宜化	10,700	152,047.00	0.02
584	002467	二六三	24,800	151,032.00	0.02
585	300491	通合科技	6,000	150,780.00	0.02
586	603387	基蛋生物	17,900	149,823.00	0.02
587	600062	华润双鹤	8,100	148,149.00	0.02
588	601166	兴业银行	7,000	147,420.00	0.02
589	600020	中原高速	34,400	146,544.00	0.02
590	600909	华安证券	21,400	145,092.00	0.02
591	600082	海泰发展	35,700	144,942.00	0.02
592	300045	华力创通	5,000	144,550.00	0.02
593	002317	众生药业	7,600	144,248.00	0.02
594	688028	沃尔德	2,232	144,053.28	0.02
595	002669	康达新材	9,400	142,880.00	0.02
596	000338	潍柴动力	8,300	142,760.00	0.02
597	002153	石基信息	13,100	141,873.00	0.02
598	300346	南大光电	3,300	141,570.00	0.02
599	002636	金安国纪	8,400	140,364.00	0.02
600	300009	安科生物	14,600	139,722.00	0.02
601	002051	中工国际	15,400	139,678.00	0.02
602	002722	物产金轮	9,300	139,593.00	0.02
603	688036	传音控股	2,100	138,936.00	0.02
604	002463	沪电股份	1,900	138,833.00	0.02
605	603323	苏农银行	27,400	138,370.00	0.02
606	601369	陕鼓动力	13,800	138,138.00	0.02
607	688123	聚辰股份	1,100	138,138.00	0.02
608	603511	爱慕股份	8,900	137,861.00	0.02
609	002736	国信证券	10,500	137,760.00	0.02
610	600210	紫江企业	18,700	137,445.00	0.02
611	301055	张小泉	7,000	137,270.00	0.02
612	600212	绿能慧充	16,900	136,045.00	0.02
613	688377	迪威尔	3,700	135,790.00	0.02
614	600388	龙净环保	8,300	135,373.00	0.02
615	300357	我武生物	4,700	133,245.00	0.02
616	300942	易瑞生物	14,000	131,740.00	0.02
617	002090	金智科技	11,100	130,980.00	0.02
618	300739	明阳电路	7,100	130,498.00	0.02
619	600961	株冶集团	7,900	127,190.00	0.02
620	002714	牧原股份	2,500	126,450.00	0.02
621	300866	安克创新	1,100	125,829.00	0.02
622	603043	广州酒家	7,100	125,173.00	0.02
623	002675	东诚药业	9,100	125,034.00	0.02
624	688107	安路科技	4,600	125,028.00	0.02
625	600416	湘电股份	7,900	124,662.00	0.02

626	600094	大名城	29,900	124,384.00	0.02
627	300442	润泽科技	2,300	121,440.00	0.02
628	600619	海立股份	5,700	120,270.00	0.02
629	300215	电科院	18,900	120,204.00	0.02
630	000030	富奥股份	20,900	119,966.00	0.02
631	600050	中国联通	23,400	119,574.00	0.02
632	600017	日照港	39,700	119,100.00	0.02
633	300925	法本信息	5,600	118,944.00	0.02
634	300389	艾比森	7,300	118,479.00	0.02
635	688098	申联生物	13,300	118,104.00	0.02
636	300779	惠城环保	900	117,099.00	0.02
637	002085	万丰奥威	7,300	116,873.00	0.02
638	603005	晶方科技	4,200	116,172.00	0.02
639	002312	川发龙蟒	10,400	113,672.00	0.02
640	000828	东莞控股	10,500	112,980.00	0.02
641	600989	宝丰能源	5,700	111,891.00	0.02
642	300251	光线传媒	6,800	111,384.00	0.02
643	002901	大博医疗	2,300	108,951.00	0.02
644	600853	龙建股份	25,100	108,683.00	0.02
645	000823	超声电子	8,000	108,480.00	0.02
646	002364	中恒电气	4,100	108,404.00	0.02
647	300001	特锐德	4,200	107,856.00	0.01
648	603956	威派格	16,600	107,236.00	0.01
649	688201	信安世纪	7,300	106,799.00	0.01
650	300817	双飞集团	5,000	106,050.00	0.01
651	300223	北京君正	1,000	106,040.00	0.01
652	002389	航天彩虹	4,400	105,512.00	0.01
653	600298	安琪酵母	2,400	104,976.00	0.01
654	002521	齐峰新材	12,400	103,168.00	0.01
655	002049	紫光国微	1,300	102,453.00	0.01
656	603008	喜临门	5,000	102,400.00	0.01
657	600676	交运股份	17,400	102,312.00	0.01
658	002074	国轩高科	2,600	101,686.00	0.01
659	003013	地铁设计	7,100	100,607.00	0.01
660	002948	青岛银行	22,400	100,352.00	0.01
661	301486	致尚科技	800	99,240.00	0.01
662	603171	税友股份	1,800	99,234.00	0.01
663	688579	山大地纬	9,200	99,176.00	0.01
664	300224	正海磁材	6,400	98,944.00	0.01
665	688153	唯捷创芯	2,600	97,864.00	0.01
666	601018	宁波港	26,900	97,647.00	0.01
667	600662	外服控股	19,400	97,388.00	0.01
668	000930	中粮科技	16,600	95,782.00	0.01

669	300791	仙乐健康	3,700	95,682.00	0.01
670	300850	新强联	2,300	95,151.00	0.01
671	300315	掌趣科技	19,000	93,860.00	0.01
672	600988	赤峰黄金	3,000	93,720.00	0.01
673	001696	宗申动力	4,300	93,267.00	0.01
674	603267	鸿远电子	1,700	92,531.00	0.01
675	002162	悦心健康	19,700	91,802.00	0.01
676	688798	艾为电子	1,200	91,332.00	0.01
677	000065	北方国际	7,200	89,712.00	0.01
678	600737	中粮糖业	5,200	89,492.00	0.01
679	002254	泰和新材	8,900	89,178.00	0.01
680	002394	联发股份	5,600	88,816.00	0.01
681	601555	东吴证券	9,800	88,788.00	0.01
682	300908	仲景食品	3,200	88,640.00	0.01
683	002314	南山控股	31,000	88,350.00	0.01
684	300100	双林股份	2,200	87,164.00	0.01
685	600638	新黄浦	13,400	86,698.00	0.01
686	688131	皓元医药	1,200	86,496.00	0.01
687	002349	精华制药	11,900	86,394.00	0.01
688	002987	京北方	4,000	86,120.00	0.01
689	000026	飞亚达	5,200	85,176.00	0.01
690	603118	共进股份	7,400	85,100.00	0.01
691	002038	双鹭药业	11,500	84,755.00	0.01
692	603659	璞泰来	3,100	84,754.00	0.01
693	300541	先进数通	5,600	84,336.00	0.01
694	601108	财通证券	9,600	83,712.00	0.01
695	688472	阿特斯	5,600	83,496.00	0.01
696	003025	思进智能	5,800	83,346.00	0.01
697	300238	冠昊生物	6,000	83,100.00	0.01
698	603858	步长制药	5,300	82,892.00	0.01
699	301021	英诺激光	1,700	82,705.00	0.01
700	301606	绿联科技	1,400	82,236.00	0.01
701	688475	萤石网络	2,700	81,297.00	0.01
702	603039	泛微网络	1,500	80,310.00	0.01
703	002826	易明医药	4,300	79,034.00	0.01
704	600461	洪城环境	8,500	78,795.00	0.01
705	688227	品高股份	1,200	78,012.00	0.01
706	688231	隆达股份	3,000	78,000.00	0.01
707	300247	融捷健康	15,200	77,976.00	0.01
708	688778	厦钨新能	1,000	77,370.00	0.01
709	002352	顺丰控股	2,000	76,640.00	0.01
710	601163	三角轮胎	5,300	75,737.00	0.01
711	601866	中远海发	29,800	75,096.00	0.01

712	300651	金陵体育	3,600	73,368.00	0.01
713	300997	欢乐家	2,800	73,220.00	0.01
714	601678	滨化股份	16,900	71,656.00	0.01
715	600097	开创国际	6,200	70,432.00	0.01
716	688167	炬光科技	400	70,028.00	0.01
717	688456	有研粉材	900	69,930.00	0.01
718	002119	康强电子	4,200	69,174.00	0.01
719	300613	富瀚微	1,500	69,090.00	0.01
720	688390	固德威	1,100	68,343.00	0.01
721	300138	晨光生物	5,500	68,255.00	0.01
722	603987	康德莱	7,900	67,940.00	0.01
723	601658	邮储银行	12,300	67,035.00	0.01
724	000811	冰轮环境	3,600	66,672.00	0.01
725	002375	亚厦股份	17,500	66,325.00	0.01
726	002773	康弘药业	2,200	65,934.00	0.01
727	600780	通宝能源	11,400	64,752.00	0.01
728	000686	东北证券	6,900	64,308.00	0.01
729	600528	中铁工业	7,700	62,986.00	0.01
730	000404	长虹华意	9,300	62,961.00	0.01
731	300066	三川智慧	10,100	62,923.00	0.01
732	002786	银宝山新	7,300	62,780.00	0.01
733	002941	新疆交建	3,900	61,815.00	0.01
734	300244	迪安诊断	3,900	61,815.00	0.01
735	000715	中兴商业	9,800	61,642.00	0.01
736	601766	中国中车	9,000	61,380.00	0.01
737	002358	森源电气	11,300	61,246.00	0.01
738	300428	立中集团	2,600	60,710.00	0.01
739	601019	山东出版	7,000	60,480.00	0.01
740	300505	川金诺	2,700	60,453.00	0.01
741	601238	广汽集团	7,300	59,568.00	0.01
742	600206	有研新材	2,900	58,957.00	0.01
743	002391	长青股份	9,800	58,114.00	0.01
744	300141	和顺电气	4,600	57,822.00	0.01
745	603538	美诺华	3,000	57,720.00	0.01
746	301025	读客文化	5,900	57,643.00	0.01
747	600223	福瑞达	7,800	57,408.00	0.01
748	000910	大亚圣象	7,600	56,696.00	0.01
749	300692	中赋科技	6,700	56,280.00	0.01
750	002311	海大集团	1,000	55,380.00	0.01
751	603566	普莱柯	4,400	54,692.00	0.01
752	603351	威尔药业	2,100	54,642.00	0.01
753	301210	金杨精密	1,500	54,600.00	0.01
754	300041	回天新材	4,900	54,292.00	0.01

755	601699	潞安环能	4,600	54,280.00	0.01
756	300146	汤臣倍健	4,500	54,045.00	0.01
757	301071	力量钻石	1,500	53,760.00	0.01
758	600965	福成股份	8,900	52,955.00	0.01
759	601956	东贝集团	7,400	52,762.00	0.01
760	000600	建投能源	6,000	51,180.00	0.01
761	603556	海兴电力	1,400	50,960.00	0.01
762	600941	中国移动	500	50,525.00	0.01
763	600774	汉商集团	5,500	50,270.00	0.01
764	300395	菲利华	500	50,150.00	0.01
765	002292	奥飞娱乐	5,600	49,560.00	0.01
766	300573	兴齐眼药	700	49,203.00	0.01
767	600114	东睦股份	1,600	48,880.00	0.01
768	601963	重庆银行	4,500	48,735.00	0.01
769	301568	思泰克	1,000	48,530.00	0.01
770	601000	唐山港	12,500	48,000.00	0.01
771	300988	津荣天宇	2,100	47,775.00	0.01
772	600080	金花股份	6,300	47,502.00	0.01
773	300496	中科创达	700	47,250.00	0.01
774	002468	申通快递	3,500	46,970.00	0.01
775	300184	力源信息	4,700	46,953.00	0.01
776	600729	重庆百货	1,800	46,800.00	0.01
777	688312	燕麦科技	1,400	46,452.00	0.01
778	301487	盟固利	2,100	46,053.00	0.01
779	600761	安徽合力	2,200	45,958.00	0.01
780	688063	派能科技	800	45,456.00	0.01
781	300697	电工合金	2,700	45,306.00	0.01
782	688181	八亿时空	1,400	45,248.00	0.01
783	688486	龙迅股份	600	44,586.00	0.01
784	300682	朗新科技	2,900	44,109.00	0.01
785	000785	居然智家	15,100	44,092.00	0.01
786	300498	温氏股份	2,600	43,888.00	0.01
787	688549	中巨芯	4,800	43,776.00	0.01
788	600754	锦江酒店	1,700	42,959.00	0.01
789	688613	奥精医疗	2,100	42,651.00	0.01
790	603530	神马电力	1,000	41,080.00	0.01
791	603288	海天味业	1,100	40,722.00	0.01
792	002350	北京科锐	5,000	40,700.00	0.01
793	002080	中材科技	1,100	39,974.00	0.01
794	688819	天能股份	1,198	39,797.56	0.01
795	603817	海峡环保	5,600	39,704.00	0.01
796	688612	威迈斯	1,200	39,564.00	0.01
797	300416	苏试试验	2,200	39,248.00	0.01

798	002508	老板电器	2,000	38,700.00	0.01
799	601872	招商轮船	4,300	38,614.00	0.01
800	601788	光大证券	2,200	38,610.00	0.01
801	601010	文峰股份	14,100	38,493.00	0.01
802	002969	嘉美包装	3,000	37,980.00	0.01
803	000932	华菱钢铁	6,700	37,654.00	0.01
804	300318	博晖创新	6,000	37,620.00	0.01
805	600728	佳都科技	5,600	37,408.00	0.01
806	002668	TCL 智家	3,600	37,368.00	0.01
807	688281	华秦科技	500	36,900.00	0.01
808	300058	蓝色光标	3,200	36,864.00	0.01
809	002324	普利特	2,300	36,777.00	0.01
810	600071	凤凰光学	1,700	36,550.00	0.01
811	300342	天银机电	1,100	36,443.00	0.01
812	301185	鸥玛软件	1,900	36,290.00	0.01
813	000960	锡业股份	1,300	36,244.00	0.01
814	603565	中谷物流	3,600	36,144.00	0.01
815	600982	宁波能源	8,300	36,022.00	0.01
816	600278	东方创业	4,700	35,720.00	0.00
817	688295	中复神鹰	1,000	32,810.00	0.00
818	603466	风语筑	3,500	32,760.00	0.00
819	301299	卓创资讯	600	32,628.00	0.00
820	688600	皖仪科技	1,300	32,565.00	0.00
821	600354	敦煌种业	4,900	31,703.00	0.00
822	000900	现代投资	7,700	31,493.00	0.00
823	002572	索菲亚	2,300	31,303.00	0.00
824	600325	华发股份	7,400	31,228.00	0.00
825	300943	春晖智控	1,500	31,170.00	0.00
826	688656	浩欧博	200	30,760.00	0.00
827	601086	国芳集团	3,000	30,510.00	0.00
828	002849	威星智能	1,900	30,210.00	0.00
829	000543	皖能电力	3,700	29,415.00	0.00
830	300475	香农芯创	200	28,868.00	0.00
831	002184	海得控制	2,200	28,798.00	0.00
832	300272	开能健康	3,800	28,424.00	0.00
833	603980	吉华集团	5,600	28,224.00	0.00
834	301366	一博科技	800	28,216.00	0.00
835	300650	太龙股份	1,700	28,152.00	0.00
836	603999	读者传媒	4,000	28,120.00	0.00
837	600382	广东明珠	3,900	27,807.00	0.00
838	600063	皖维高新	4,700	27,683.00	0.00
839	688049	炬芯科技	521	27,404.60	0.00
840	300373	扬杰科技	400	27,200.00	0.00

841	601577	长沙银行	2,800	27,160.00	0.00
842	688788	科思科技	400	26,936.00	0.00
843	603063	禾望电气	800	26,456.00	0.00
844	300803	指南针	200	26,174.00	0.00
845	300993	玉马科技	1,700	25,024.00	0.00
846	600061	国投资本	3,200	24,480.00	0.00
847	000090	天健集团	6,600	24,420.00	0.00
848	002705	新宝股份	1,700	24,242.00	0.00
849	301200	大族数控	200	23,754.00	0.00
850	002233	塔牌集团	2,600	23,426.00	0.00
851	002981	朝阳科技	800	22,856.00	0.00
852	002282	博深股份	3,100	22,785.00	0.00
853	300414	中光防雷	1,500	22,425.00	0.00
854	002284	亚太股份	1,500	22,395.00	0.00
855	300508	维宏股份	600	22,140.00	0.00
856	000767	晋控电力	7,900	22,120.00	0.00
857	300829	金丹科技	1,300	21,567.00	0.00
858	002397	梦洁股份	5,200	20,956.00	0.00
859	601336	新华保险	300	20,910.00	0.00
860	605158	华达新材	2,600	20,904.00	0.00
861	002483	润邦股份	2,900	20,706.00	0.00
862	688515	裕太微	200	20,510.00	0.00
863	000899	赣能股份	2,000	19,800.00	0.00
864	688577	浙海德曼	200	19,372.00	0.00
865	300611	美力科技	700	19,082.00	0.00
866	002020	京新药业	1,000	18,980.00	0.00
867	600108	亚盛集团	5,900	18,585.00	0.00
868	300420	五洋自控	4,500	17,955.00	0.00
869	301165	锐捷网络	200	17,760.00	0.00
870	603678	火炬电子	500	17,660.00	0.00
871	300303	聚飞光电	2,500	17,100.00	0.00
872	688259	创耀科技	400	16,720.00	0.00
873	603126	中材节能	2,400	16,128.00	0.00
874	603006	联明股份	1,200	15,744.00	0.00
875	002671	龙泉股份	2,900	15,196.00	0.00
876	002248	华东数控	1,300	14,989.00	0.00
877	603915	国茂股份	800	14,728.00	0.00
878	002905	金逸影视	1,300	14,690.00	0.00
879	300595	欧普康视	1,000	14,690.00	0.00
880	002307	北新路桥	2,900	14,645.00	0.00
881	688006	杭可科技	500	14,645.00	0.00
882	301381	赛维时代	700	14,413.00	0.00
883	301297	富乐德	400	14,320.00	0.00

884	002064	华峰化学	1,300	14,300.00	0.00
885	002493	荣盛石化	1,200	14,052.00	0.00
886	300031	宝通科技	600	13,638.00	0.00
887	603707	健友股份	1,500	13,545.00	0.00
888	600023	浙能电力	2,700	13,365.00	0.00
889	600425	青松建化	3,200	13,312.00	0.00
890	688403	汇成股份	800	13,104.00	0.00
891	002155	湖南黄金	600	12,654.00	0.00
892	002928	华夏航空	1,100	12,155.00	0.00
893	603379	三美股份	200	12,144.00	0.00
894	300711	广哈通信	500	11,610.00	0.00
895	002545	东方铁塔	600	11,070.00	0.00
896	601100	恒立液压	100	10,991.00	0.00
897	000576	甘化科工	1,000	10,530.00	0.00
898	002576	通达动力	600	10,440.00	0.00
899	603002	宏昌电子	1,400	10,346.00	0.00
900	300706	阿石创	300	10,179.00	0.00
901	688595	芯海科技	300	9,840.00	0.00
902	002060	广东建工	2,700	9,720.00	0.00
903	688799	华纳药厂	200	9,540.00	0.00
904	002096	易普力	700	9,324.00	0.00
905	000888	峨眉山 A	700	9,184.00	0.00
906	002912	中新赛克	300	9,042.00	0.00
907	688039	当虹科技	200	8,950.00	0.00
908	603529	爱玛科技	300	8,910.00	0.00
909	300160	秀强股份	1,600	8,704.00	0.00
910	600120	浙江东方	1,400	8,638.00	0.00
911	601800	中国交建	1,000	8,240.00	0.00
912	600987	航民股份	1,100	7,579.00	0.00
913	688371	菲沃泰	400	7,388.00	0.00
914	002327	富安娜	1,100	7,381.00	0.00
915	601808	中海油服	500	7,020.00	0.00
916	002419	天虹股份	1,200	6,636.00	0.00
917	301051	信濠光电	300	5,880.00	0.00
918	001286	陕西能源	600	5,586.00	0.00
919	605020	永和股份	200	5,378.00	0.00
920	002003	伟星股份	500	5,300.00	0.00
921	601288	农业银行	500	3,840.00	0.00
922	002731	萃华珠宝	200	2,512.00	0.00
923	003022	联泓新科	100	1,981.00	0.00
924	002777	久远银海	100	1,794.00	0.00
925	605599	菜百股份	100	1,637.00	0.00
926	688298	东方生物	27	632.61	0.00

8.3.2 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股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	25,962,746.17	3.61
2	300308	中际旭创	10,952,565.00	1.52
3	300502	新易盛	7,624,404.00	1.06
4	300274	阳光电源	6,395,533.00	0.89
5	300394	天孚通信	6,227,688.85	0.87
6	688256	寒武纪	5,459,095.96	0.76
7	300433	蓝思科技	5,312,611.00	0.74
8	688041	海光信息	4,844,837.81	0.67
9	601398	工商银行	4,688,125.00	0.65
10	300604	长川科技	4,507,481.00	0.63
11	688981	中芯国际	4,283,532.65	0.60
12	601229	上海银行	4,134,398.00	0.57
13	600019	宝钢股份	4,019,400.00	0.56
14	601077	渝农商行	4,015,151.00	0.56
15	300760	迈瑞医疗	3,967,149.00	0.55
16	300570	太辰光	3,902,401.00	0.54
17	300438	鹏辉能源	3,874,597.00	0.54
18	600188	兖矿能源	3,793,721.50	0.53
19	300476	胜宏科技	3,734,067.00	0.52
20	601088	中国神华	3,730,627.00	0.52

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300442	润泽科技	3,619,452.00	0.50
2	300045	华力创通	2,689,847.55	0.37
3	601088	中国神华	2,335,254.00	0.32
4	600628	新世界	2,102,732.00	0.29
5	300664	鹏鹞环保	2,039,844.00	0.28

6	300493	润欣科技	1,891,838.29	0.26
7	300476	胜宏科技	1,884,958.00	0.26
8	300228	富瑞特装	1,854,026.00	0.26
9	300570	太辰光	1,842,664.00	0.26
10	300468	四方精创	1,829,970.00	0.25
11	300917	特发服务	1,826,138.00	0.25
12	300102	乾照光电	1,748,949.00	0.24
13	300739	明阳电路	1,746,732.00	0.24
14	300095	华伍股份	1,698,697.00	0.24
15	688270	臻镭科技	1,687,969.92	0.23
16	600575	淮河能源	1,654,042.00	0.23
17	301017	漱玉平民	1,630,273.00	0.23
18	301396	宏景科技	1,607,553.00	0.22
19	002697	红旗连锁	1,523,519.00	0.21
20	300620	光库科技	1,471,177.00	0.20

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	808,877,567.59
卖出股票收入（成交）总额	245,599,627.24

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可参与股指期货交易。若本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金可参与国债期货交易。若本基金参与国债期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他各项资产构成。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
国泰海通中证全指指数增强 A	1,930	111,087.28	1,264,700.54	0.59%	213,133,742.53	99.41%
国泰海通中证全指指数增强 C	6,573	75,433.84	4,798,287.19	0.97%	491,028,366.95	99.03%
合计	8,503	83,526.41	6,062,987.73	0.85%	704,162,109.48	99.15%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国泰海通中证全指指数增强 A	499,519.94	0.2330%
	国泰海通中证全指指数增强 C	20.01	0.0000%
	合计	499,539.95	0.0703%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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情况

项目	份额级别	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	国泰海通中证全指指数增强 A	10~50
	国泰海通中证全指指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通中证全指指数增强 A	10~50
	国泰海通中证全指指数增强 C	0
	合计	10~50

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和研究部门负责人）和基金经理的，其持有份额总量的数量区间分别计算在内。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通中证全指指数增强 A	国泰海通中证全指指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 02 日）基金份额总额	214,398,443.07	495,826,654.14
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	214,398,443.07	495,826,654.14

注：本报告期内本基金份额无份额变动情况。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陶耿同志担任公司董事长，谢乐斌同志不再担任公司董事长，生效日期为 2025 年 4 月 25 日。

2025 年 9 月 30 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、公司章程（2025 年 7 月修订）规定，公司不再设职工监事，原公司第二届第二次职工代表大会选举产生的职工监事王红莲不再任职公司职工监事。

2025 年 10 月 14 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据公司章程规定，经公司股东国泰海通证券股份有限公司研究决定，董博阳同志不再担任公司监事职务。

2025 年 12 月 25 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，左秀海同志担任公司副总裁，生效日期为 2025 年 12 月 24 日。

2、本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 0.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为自合同生效日至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

托管人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	江苏银行股份有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 01 月 24 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会江苏监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、其他问题（信息披露等）
受到处罚的依据	《证券投资基金托管业务管理办法》第八条、第三十七条等
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改、已验收
其他	无

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
国金证券股份有限公司	2	1,054,477,194.83	100.00%	143,302.04	100.00%	-
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

11.8 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	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-11-07
2	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2025-11-07
3	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2025-11-07
4	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2025-11-07
5	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2025-11-07
6	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报	2025-11-07
7	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-11-07
8	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-12-03
9	关于调整旗下部分开放式基金在部分销售机构最低认购、申购金额、最低追加申购金额、最低赎回份额和最低持有限额的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-12-09
10	上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-12-25
11	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<https://www.gthtzg.com>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰海通证券资产管理有限公司
二〇二六年三月三十一日