

国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金

2025 年第 4 季度报告

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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 01 月 22 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年01月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年10月01日起至2025年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国泰海通中证 1000 指数增强 |
| 基金主代码 | 015867 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 08 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,378,720,992.88 份 |
| 投资目标 | 本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 1000 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 | 1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率 \times 95% + 同期银行活期存款利率（税后） \times 5% |
| 风险收益特征 | 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。 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。 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 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 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015867 | 015868 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 704,044,432.55 份 | 674,676,560.33 份 |

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金由国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金变更而来。国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2025 年 10 月 01 日-2025 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|--|--------------------|
| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益 | 25,269,854.90 | 22,543,477.25 |
| 2. 本期利润 | 10,250,174.71 | 10,812,667.27 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0138 | 0.0151 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,041,215,775.23 | 984,434,814.45 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4789 | 1.4591 |

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。

3.2 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 1000 指数增强 A 净值表现

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.13% | 1.12% | 0.28% | 1.07% | 0.85% | 0.05% |
| 过去六个月 | 24.04% | 1.08% | 18.49% | 1.06% | 5.55% | 0.02% |
| 过去一年 | 40.31% | 1.35% | 26.12% | 1.32% | 14.19% | 0.03% |
| 过去三年 | 63.40% | 1.50% | 20.34% | 1.48% | 43.06% | 0.02% |
| 自基金合同 | 47.89% | 1.46% | 4.61% | 1.46% | 43.28% | 0.00% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

国泰海通中证 1000 指数增强 C 净值表现

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 1. 02% | 1. 12% | 0. 28% | 1. 07% | 0. 74% | 0. 05% |
| 过去六个月 | 23. 79% | 1. 08% | 18. 49% | 1. 06% | 5. 30% | 0. 02% |
| 过去一年 | 39. 75% | 1. 35% | 26. 12% | 1. 32% | 13. 63% | 0. 03% |
| 过去三年 | 61. 46% | 1. 49% | 20. 34% | 1. 48% | 41. 12% | 0. 01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 45. 91% | 1. 46% | 4. 61% | 1. 46% | 41. 30% | 0. 00% |

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

国泰海通中证1000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

(2022年08月16日-2025年12月31日)



— 国泰海通中证1000指数增强A — 业绩比较基准

国泰海通中证1000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
(2022年08月16日-2025年12月31日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | 2022-08-16 | - | 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 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|--|
| | 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。 | | | | 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。 |
| 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。 | 2024-08-21 | - | 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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。

4.3.2 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 0 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在市场方面，2025 年第四季度 A 股市场在宏观政策博弈与地缘政治扰动的双重影响下，整体呈现震荡抬升，承压后修复的节奏。10 月 9 日上证指数站上 3900 点关口，市场对“指数突破——增量资金——估值重估”的正反馈预期较强，中旬受美关税威胁加剧，市场避险情绪升温。10 月下旬，

美政府对华释放缓和信号，叠加三季报业绩超预期，10 月 29 日上证综指突破 4000 点。11 月市场步入业绩与政策的空窗期，中上旬指数高位震荡，由普涨转向结构轮动。中下旬阶段性调整加深，一方面美联储政策路径预期反复、地缘风险升温压制风险偏好，另一方面 AI 算力等高弹性板块分歧加大、获利回吐带来波动。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，开启持续修复，12 月 17 日起走出一轮连阳行情，至年末录得 11 连阳，两市成交额突破两万亿。第四季度，中证 1000 指数表现一般（涨幅 0.27%），强于沪深 300 指数（跌幅 0.23%），相较中证 500 指数（涨幅 0.72%）略显落后。

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，直到四季度呈震荡态势，动量因子则在第四季度表现强劲，四季度末尤为明显。从行业层面看，四季度行业涨跌分化依然明显。有色金属板块表现居首（涨幅 16.2%）；石油石化股票受益于行业“反内卷”、落后产能出清等因素带来利润提升，表现突出（涨幅 15.3%）；上季度领先的通信行业在四季度延续强势，涨幅第三（涨幅 13.6%），中际旭创、新易盛等龙头个股依旧表现突出。与此同时，上季度逆势下跌的银行板块在四季度亦实现了正收益。不过从整体来看，仍有部分行业呈下跌态势，消费、白酒等板块持续走弱，计算机、电子及创新药等赛道亦出现较为明显的回调。从 Alpha 表现方面来看，四季度整体上量价因子和价值因子的表现较好，质量、成长类的因子表现一般。

本基金坚持体系化的量化投资逻辑，力求排除市场短期情绪的干扰，保持策略的一致性与纪律性。我们通过持续挖掘有效的阿尔法因子、迭代优化模型架构，并有机整合基本面信号与实时量价数据，借助机器学习进行因子的动态优选与组合风险精细控制，以追求持续稳健的超额收益。基于多源信号间的低相关性结构，我们注重发挥其互补与协同效应，并依据市场环境进行灵活调整。中证 1000 指数作为 A 股小盘成长风格的代表，其成分股具备更高的业绩弹性与成长空间，相应的波动也更为显著，因此在指数增强策略中，我们更注重在控制跟踪误差与波动的前提下，积极捕捉中小盘股中潜在的阿尔法机会。我们将持续通过科学的量化方法优化模型表现，力求在承担适度波动的同时，为客户实现长期收益的增强。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.4789 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%；截至报告期末国泰海通中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.4591 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,874,389,343.89 | 91.25 |
| | 其中：股票 | 1,874,389,343.89 | 91.25 |
| 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 | 171,027,285.17 | 8.33 |
| 8 | 其他资产 | 8,613,968.45 | 0.42 |
| 9 | 合计 | 2,054,030,597.51 | 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%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 1,728,800.44 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 31,991,784.22 | 1.58 |
| C | 制造业 | 1,080,973,556.16 | 53.36 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,172,622.90 | 0.80 |
| E | 建筑业 | 17,132,668.26 | 0.85 |
| F | 批发和零售业 | 62,291,381.04 | 3.08 |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 46,015,344.01 | 2.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 5,400,200.00 | 0.27 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 200,672,000.52 | 9.91 |
| J | 金融业 | 23,024,661.00 | 1.14 |
| K | 房地产业 | 11,759,325.00 | 0.58 |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,154,138.57 | 0.65 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 22,404,537.86 | 1.11 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 20,303,179.45 | 1.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 567,430.00 | 0.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,046,742.00 | 0.05 |
| S | 综合 | 6,295,310.00 | 0.31 |
| | 合计 | 1,560,933,681.43 | 77.06 |

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,235,209.00 | 0.16 |
| B | 采矿业 | 1,904,580.72 | 0.09 |
| C | 制造业 | 212,899,071.64 | 10.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,861,831.00 | 0.98 |
| E | 建筑业 | 1,827,456.00 | 0.09 |
| F | 批发和零售业 | 10,723,591.90 | 0.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 251,868.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 26,755,968.45 | 1.32 |
| J | 金融业 | 5,226,433.00 | 0.26 |
| K | 房地产业 | 1,917,141.65 | 0.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 11,579,221.00 | 0.57 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 11,923,487.10 | 0.59 |
| N | 水利、环境和公共设 | 482,733.00 | 0.02 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| | 施管理业 | | |
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,279,415.00 | 0.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,587,655.00 | 0.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 313,455,662.46 | 15.47 |

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 002222 | 福晶科技 | 300,400 | 16,924,536.00 | 0.84 |
| 2 | 300548 | 长芯博创 | 104,826 | 14,885,292.00 | 0.73 |
| 3 | 300620 | 光库科技 | 95,100 | 13,984,455.00 | 0.69 |
| 4 | 300008 | 天海防务 | 1,725,500 | 13,614,195.00 | 0.67 |
| 5 | 300127 | 银河磁体 | 441,800 | 13,399,794.00 | 0.66 |
| 6 | 300438 | 鹏辉能源 | 248,900 | 13,246,458.00 | 0.65 |
| 7 | 001337 | 四川黄金 | 440,000 | 12,258,400.00 | 0.61 |
| 8 | 600100 | 同方股份 | 1,337,800 | 11,933,176.00 | 0.59 |
| 9 | 000019 | 深粮控股 | 1,694,785 | 11,778,755.75 | 0.58 |
| 10 | 601126 | 四方股份 | 386,000 | 11,610,880.00 | 0.57 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002940 | 昂利康 | 250,400 | 8,393,408.00 | 0.41 |
| 2 | 002734 | 利民股份 | 403,700 | 6,434,978.00 | 0.32 |
| 3 | 002281 | 光迅科技 | 88,700 | 6,204,565.00 | 0.31 |
| 4 | 300604 | 长川科技 | 56,300 | 5,703,753.00 | 0.28 |
| 5 | 002137 | 实益达 | 624,600 | 5,359,068.00 | 0.26 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|--------|--------|----------|---------------|------------|------|
| IM2602 | IM2602 | 13 | 19,515,080.00 | -46,800.00 | - |
| IM2603 | IM2603 | 8 | 11,902,400.00 | 273,890.55 | - |
| IM2606 | IM2606 | 5 | 7,204,600.00 | -24,920.00 | - |

| | |
|-------------------|-------------|
| 公允价值变动总额合计（元） | 202,170.55 |
| 股指期货投资本期收益（元） | 567,275.21 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | -251,479.08 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货，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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 4,634,649.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 3,979,318.85 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 8,613,968.45 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C |
|-------------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 771,323,134.67 | 759,760,228.27 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 142,651,401.85 | 276,852,755.77 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 209,930,103.97 | 361,936,423.71 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | — | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 704,044,432.55 | 674,676,560.33 |

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | | |
|--|--------------------|--------------------|
| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C |
|--|--------------------|--------------------|

| | | |
|---------------------------|---------------|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 12,418,753.88 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 12,418,753.88 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | - | - |

注：本报告期期末基金管理人持有的本基金份额占基金总份额比例，分类基金比例的分母采用基金分类份额计算。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额 (份) | 交易金额 (元) | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|--------------------|------|
| 1 | 赎回 | 2025-12-02 | 5,000,000.00 | - 7,247,500.00 | - |
| 2 | 赎回 | 2025-12-09 | 5,000,000.00 | - 7,276,500.00 | - |
| 3 | 赎回 | 2025-12-10 | 2,418,753.88 | - 3,503,323.12 | - |
| 合计 | | | 12,418,753.88 | - 18,027,323.12 | |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复;
- 2、《国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》;
- 5、法律意见书;
- 6、管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、托管人业务资格批件、营业执照;
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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>。

9.3 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
二〇二六年一月二十二日