

国泰海通中证 500 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:上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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01月01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.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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	19
§ 5 托管人报告.....	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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	19
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	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
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	83
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.....	84

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.....	84
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	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	84
8.12 投资组合报告附注	84
§ 9 基金份额持有人信息.....	85
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
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	86
§ 10 开放式基金份额变动.....	87
§ 11 重大事件揭示	87
11.1 基金份额持有人大会决议	87
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.....	87
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4 基金投资策略的改变	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	88
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件.....	89
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	92
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.....	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	93

§ 13 备查文件目录	93
13.1 备查文件目录.....	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式.....	93

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	国泰海通中证 500 指数增强		
基金主代码	014155		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 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	上海银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,712,694,524.16 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 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	014155	014156	025007
报告期末下属分级基金的份额总额	1,691,449,234.85 份	1,020,482,300.50 份	762,988.81 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 500 指数增强型证券投资基金由国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金变更而来。

国泰海通中证 500 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。本基金从 2025 年 7 月 24 日起新增 Y 类份额，该类份额首次确认日为 2025 年 7 月 25 日。

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，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，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%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，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，在标的指数成份券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>股票投资策略为本基金的核心策略，主要包括以下几个方面：</p> <p>1) 行业配置</p> <p>本基金在行业配置方面尽量遵循基准指数的行业市值占比，尽量控制投资组合相对于基准指数的行业暴露带来的风险损失。</p>

	<p>2) 个股选择</p> <p>本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证 500 指数的风险偏离度。</p> <p>A、股票池的建立</p> <p>考虑到 Alpha 选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上六成以上的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市时间较短的次新股；在过去一段时间流动性和规模综合排名市场排名相对靠后；被交易所标注 ST、即将退市、业绩有连续亏损风险或者被证监会立案调查或者出具警示函等高风险的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票等。</p> <p>B、选股策略</p> <p>本基金通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过智能化的模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本基金通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价的中短期主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。本基金的选股策略以低中高等不同调仓频率的多因子选股策略为主，多因子策略投资的详细过程需要分成因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等环节。因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交易数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。在多因子模型算法层面，以人工智能选股模型为核心，并基于股票市场的高噪音和时序性的特征，构建多维度阿尔法预测模型。在投资组合层面，均严格控制其相对于基准指数在市场主要风险因子的风险暴露程度，通过配套的风险模型和组合优化模型得到不同调仓频率的投资组合，并在基金中进行相对均衡的配置。</p> <p>本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略和可转换债券、可交换债券的投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税</p>

	后) ×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。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com
客户服务电话	95521	95594
传真	021-38871190	021-68476901
注册地址	上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	上海市黄浦区中山南路 688 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	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码	200011	200120
法定代表人	陶耿	顾建忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gthtzg.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	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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			2024 年			2023 年		
	国泰海 通中证 500 指 数增强 A	国泰海 通中证 500 指 数增强 C	国泰海 通中证 500 指 数增强 Y	国泰海 通中证 500 指 数增强 A	国泰海 通中证 500 指 数增强 C	国泰海 通中证 500 指 数增强 Y	国泰海 通中证 500 指 数增强 A	国泰海 通中证 500 指 数增强 C	国泰海 通中证 500 指 数增强 Y
本期已 实现收 益	442,12 9,189. 54	200,21 7,975. 09	60,859 .63	143,78 7,368. 93	49,426 ,229.5 4	-	52,630 ,033.8 7	- 40,550 ,274.8 9	-
本期利 润	530,30 9,643. 23	226,46 9,484. 67	59,734 .75	119,73 1,104. 39	54,849 ,968.2 4	-	60,810 ,436.6 9	- 47,665 ,725.1 2	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.3254	0.2945	0.1525	0.0866	0.0721	-	0.0526	0.0645	-
本期加 权平均 净值利 润率	28.98%	26.42%	12.05%	9.88%	8.35%	-	-5.62%	-6.97%	-
本期基 金份额 净值增 长率	33.36%	32.84%	15.02%	11.41%	10.95%	-	-2.60%	-2.98%	-
3.1.2 期末数 据和指 标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
期末可 供分配 利润	457,56 5,256. 91	255,35 7,287. 31	209,03 0.70	- 35,725 ,345.3 0	- 24,783 ,419.1 7	-	- 186,95 0,050. 52	- 141,51 2,532. 46	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.2705	0.2502	0.2740	- 0.0236	- 0.0355	-	- 0.1236	- 0.1307	-
期末基 金资产 净值	2,202, 460,54 6.72	1,307, 449,52 6.60	996,10 9.77	1,476, 645,11 3.09	673,86 7,512. 75	-	1,326, 165,05 7.77	941,06 4,756. 65	-
期末基 金份额	1.3021	1.2812	1.3055	0.9764	0.9645	-	0.8764	0.8693	-

净值									
3.1.3 累计期末指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
基金份额累计净值增长率	30.21%	28.12%	15.02%	-2.36%	-3.55%	-	-	-	-
							12.36%	13.07%	-

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）。

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 500 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
过去三个月	1.22%	1.15%	0.71%	1.18%	0.51%	-0.03%
过去六个月	23.13%	1.08%	24.81%	1.11%	-1.68%	-0.03%
过去一年	33.36%	1.22%	28.81%	1.20%	4.55%	0.02%
过去三年	44.71%	1.31%	26.25%	1.30%	18.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	30.21%	1.30%	2.35%	1.29%	27.86%	0.01%

国泰海通中证 500 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
过去三个月	1.12%	1.15%	0.71%	1.18%	0.41%	-0.03%
过去六个月	22.89%	1.08%	24.81%	1.11%	-1.92%	-0.03%
过去一年	32.84%	1.22%	28.81%	1.20%	4.03%	0.02%
过去三年	42.99%	1.31%	26.25%	1.30%	16.74%	0.01%
自基金合同生效起至今	28.12%	1.30%	2.35%	1.29%	25.77%	0.01%

国泰海通中证 500 指数增强 Y 净值表现

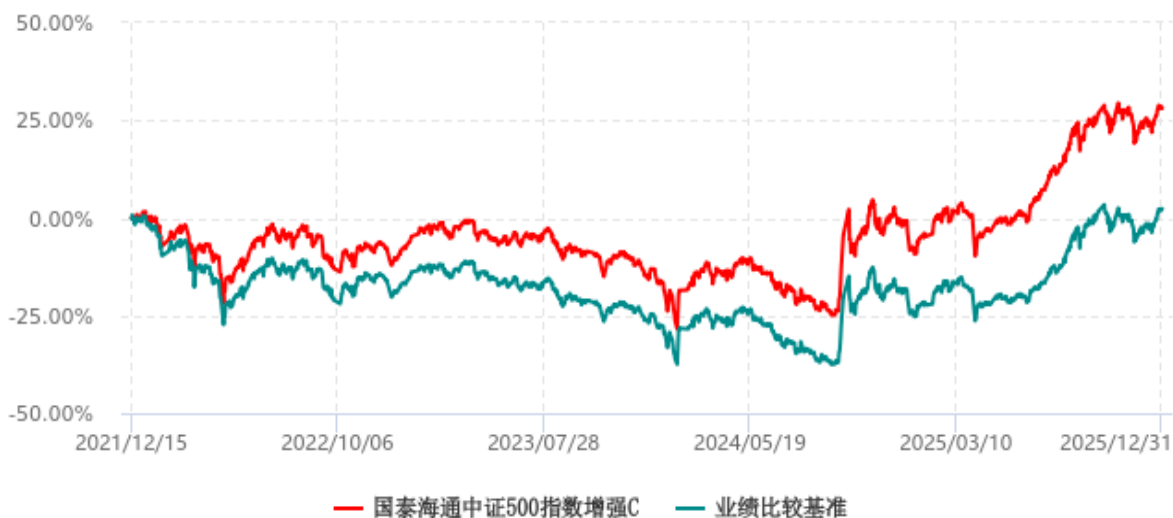
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.37%	1.16%	0.71%	1.18%	0.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	15.02%	1.14%	17.67%	1.18%	-2.65%	-0.04%

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

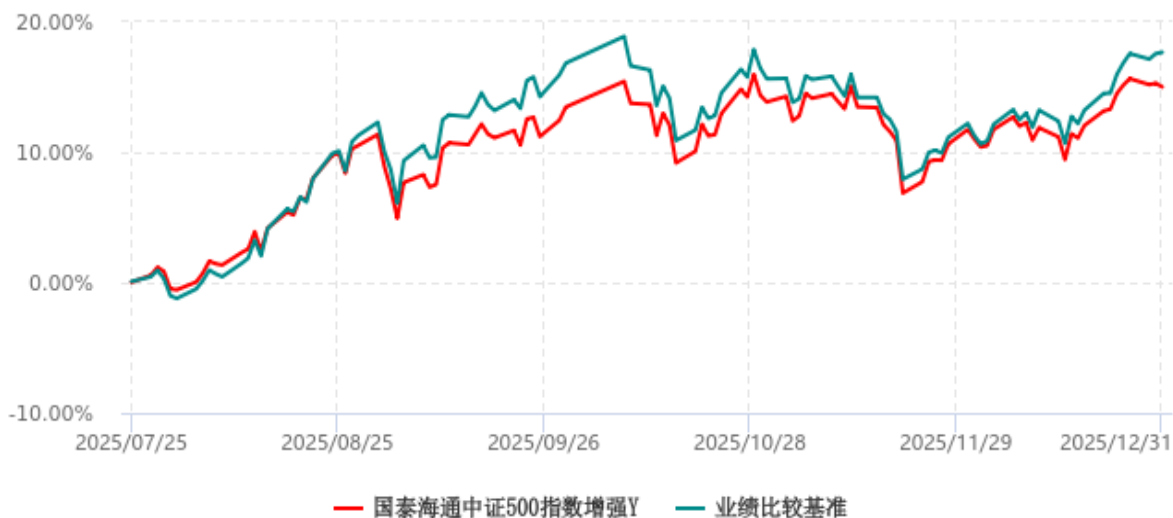
国泰海通中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月15日-2025年12月31日)



国泰海通中证500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
(2021年12月15日-2025年12月31日)

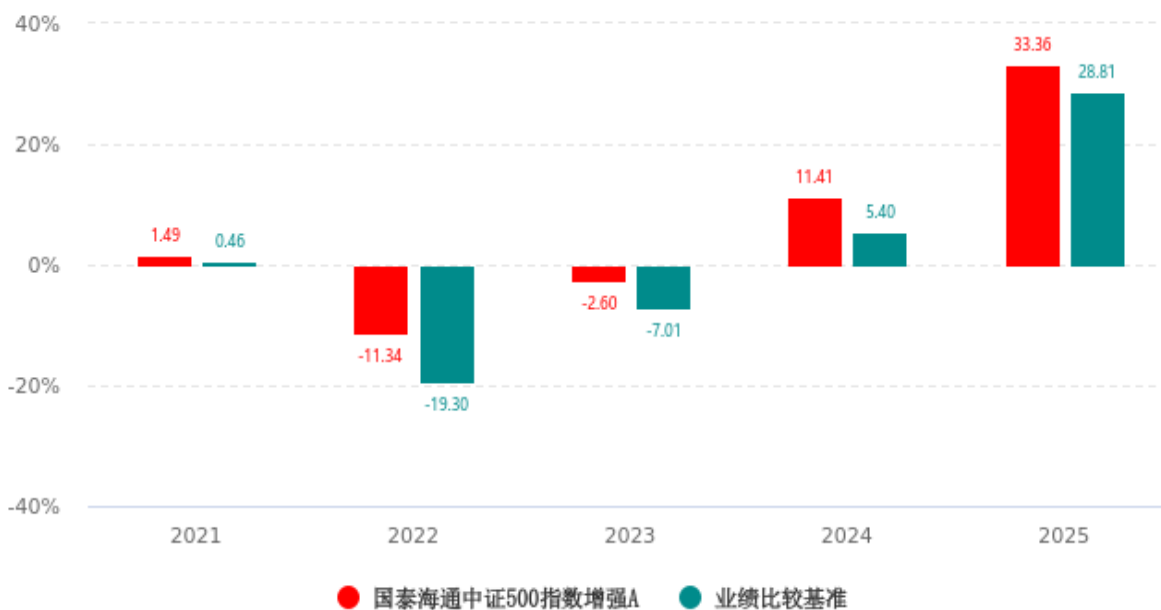


国泰海通中证500指数增强Y累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年07月25日-2025年12月31日)

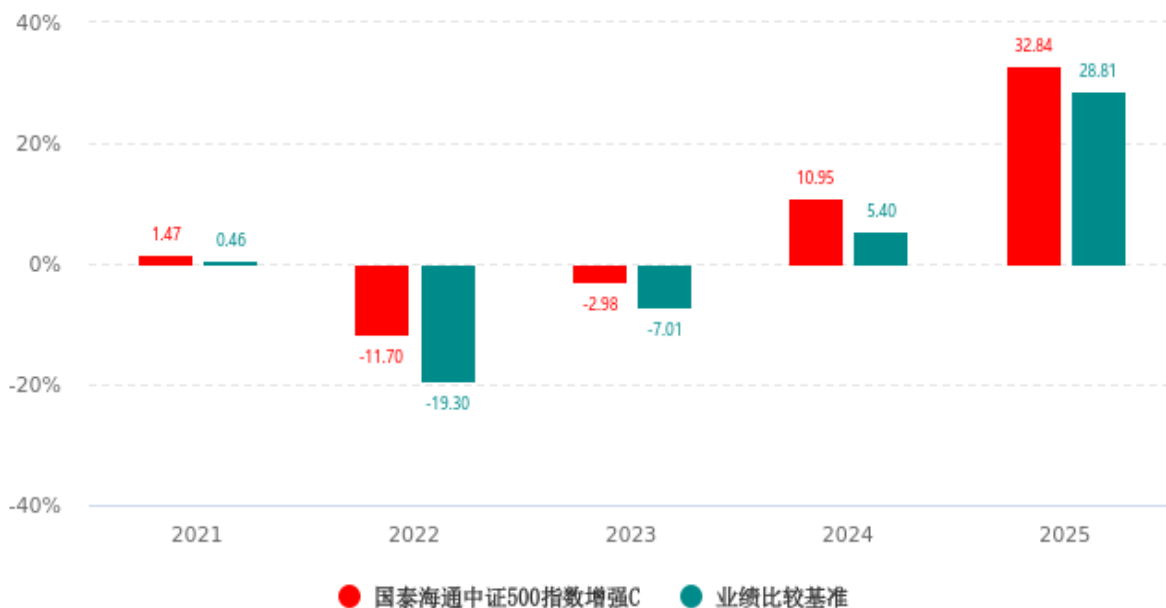


注: Y类份额于2025年7月25日首次申购确认, Y类份额当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

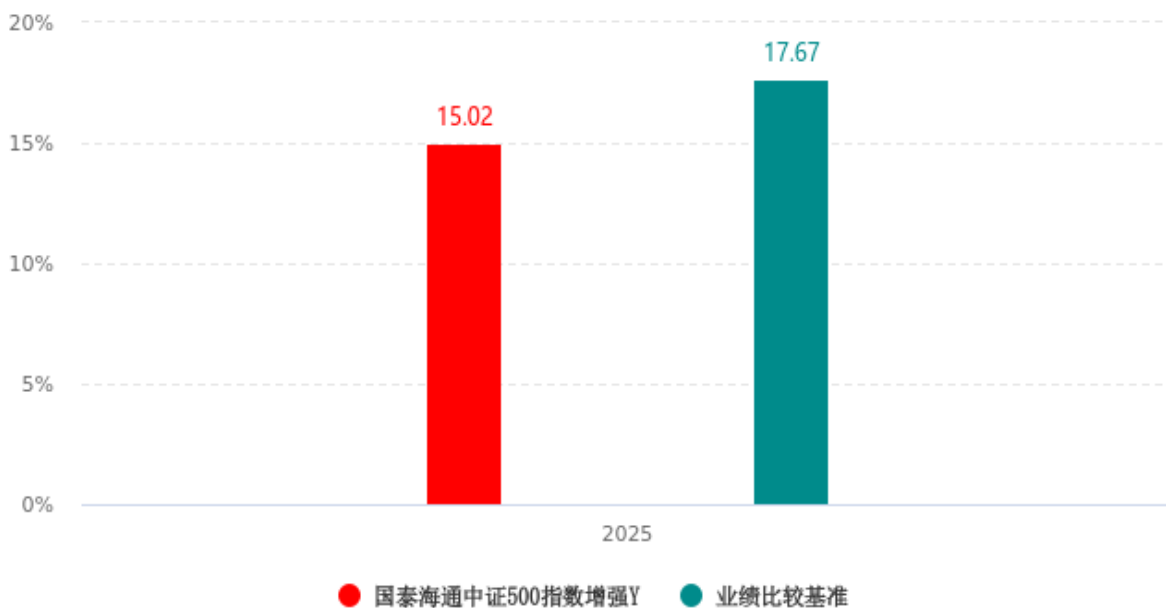
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注: 本基金合同生效日为2021年12月15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 2021 年 12 月 15 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 2021 年 12 月 15 日，Y 类份额于 2025 年 7 月 25 日首次申购确认，Y 类份额当期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	2021-12-15	-	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。	2024-05-16	-	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。

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 500 指数表现较好（涨幅 30.39%），强于沪深 300 指数（涨幅 17.66%）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，第四季度表现尤为强劲，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。

本基金是指数增强型基金，而基准指数中证 500 相对于 A 股的核心资产的宽基来说具有兼具进攻和防御属性，而中证 500 指数增强因兼顾了 Alpha 和 Beta 的需求，近些年也逐渐成为了量化的主战场之一。落实到投资策略层面，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。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，争取以较为稳定的方式增强中证 500 指数。我们的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持有。我们认为中证 500 指数当前估值依然处于历史相对合理区间，成长性良好，指数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增强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 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.3021 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 33.36%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%；截至报告期末国泰海通中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.2812 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 32.84%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%；截至报告期末国泰海通中证 500 指数增强 Y 基金份额净值为 1.3055 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 15.02%，同期业绩比较基准收益率为 17.67%。

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	容诚审字[2026]200Z2702 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 500 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>我们审计了国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“国泰海通中证 500 指数增强基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、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企业会计准则和在财务报表附注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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国泰海通中证 500 指数增强基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度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，我们独立于国泰海通中证 500 指数增强基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时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	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰海通中证 500 指数增强基金的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“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估国泰海通中证 500 指数增强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，除非基金管理人管理层计划清算国泰海通中证 500 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰海通中证 500 指数增强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，就可能导致对国泰海通中证 500 指数增强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国泰海通中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>容诚会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张振波 陈轶杰</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2026-03-26</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰海通中证 500 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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	217,499,632.00	122,062,885.91
结算备付金		26,914,959.39	5,449,442.89
存出保证金		3,855,988.80	3,793,041.60
交易性金融资产	7.4.7.2	3,284,661,235.49	2,002,902,446.73
其中：股票投资		3,284,661,235.49	2,002,902,446.73
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,933,568.83	33,126,160.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		3,540,865,384.51	2,167,333,977.70
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	0.00
应付赎回款		26,151,573.61	14,453,899.43
应付管理人报酬		2,856,300.02	1,810,570.02
应付托管费		428,444.98	271,585.49
应付销售服务费		400,804.72	234,360.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		59,647.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	62,431.08	50,936.03
负债合计		29,959,201.42	16,821,351.86
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,712,694,524.16	2,211,021,390.31
未分配利润	7.4.7.8	798,211,658.93	-60,508,764.47
净资产合计		3,510,906,183.09	2,150,512,625.84
负债和净资产总计		3,540,865,384.51	2,167,333,977.70

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,712,694,524.16 份。其中国泰海通中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.3021 元，基金份额总额 1,691,449,234.85 份；国泰海通中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.2812 元，基金份额总额 1,020,482,300.50 份；国泰海通中证 500 指数增强 Y 基金份额净值 1.3055 元，基金份额总额 762,988.81 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		791,367,887.28	198,914,657.72
1. 利息收入		1,105,154.81	872,423.90
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,063,226.41	872,423.90
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		41,928.40	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		668,910,705.68	215,698,989.01
其中：股票投资收益	7.4.7.10	625,374,360.36	191,141,843.01
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	7.4.7.11	14,000,145.20	-1,687,119.40
股利收益	7.4.7.12	29,536,200.12	26,244,265.40
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	114,430,838.39	-18,632,525.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	6,921,188.40	975,770.65
减：二、营业总支出		34,529,024.63	24,333,585.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	26,849,802.89	18,705,502.29

2. 托管费	7.4.10.2.2	4,027,470.61	2,805,825.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,432,166.20	2,639,031.70
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		51,380.93	13,039.71
8. 其他费用	7.4.7.15	168,204.00	170,186.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		756,838,862.65	174,581,072.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		756,838,862.65	174,581,072.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		756,838,862.65	174,581,072.63

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 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	2,211,021,390.31	-60,508,764.47	2,150,512,625.84
二、本期期初净资产	2,211,021,390.31	-60,508,764.47	2,150,512,625.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	501,673,133.85	858,720,423.40	1,360,393,557.25
（一）、综合收益总额	-	756,838,862.65	756,838,862.65
（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）	501,673,133.85	101,881,560.75	603,554,694.60
其中：1. 基金申购款	3,568,924,044.90	530,931,707.71	4,099,855,752.61
2. 基金赎回款	-	-429,050,146.96	-
	3,067,250,911.05		3,496,301,058.01

(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	2,712,694,524.16	798,211,658.93	3,510,906,183.09
项 目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	2,595,692,397.40	-328,462,582.98	2,267,229,814.42
二、本期期初净资产	2,595,692,397.40	-328,462,582.98	2,267,229,814.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-384,671,007.09	267,953,818.51	-116,717,188.58
（一）、综合收益总额	-	174,581,072.63	174,581,072.63
（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）	-384,671,007.09	93,372,745.88	-291,298,261.21
其中：1. 基金申购款	1,609,541,645.57	-137,194,744.91	1,472,346,900.66
2. 基金赎回款	-	230,567,490.79	-
	1,994,212,652.66		1,763,645,161.87
（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）	-	0.00	-
四、本期期末净资产	2,211,021,390.31	-60,508,764.47	2,150,512,625.84

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

国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金变更而来。国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2021 年 10 月 27 日证监许可【2021】3391 号文注册募集。《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 15 日正式生效。

本基金的基金管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 7 月 24 日起，在原有份额的基础上增设针对个人养老金投资基金业务单独设立的 Y 类基金份额，并相应修改基金合同、招募说明书等法律文件。增加上述份额后，本基金将分设国泰君安中证 500 指数增强 A、国泰君安中证 500 指数增强 C、国泰君安中证 500 指数增强 Y 基金份额，适用不同的管理费及托管费率。

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。2025 年 9 月 29 日，国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金变更为国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金，《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，但不再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；在投资者认购、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；Y 类基金份额是指仅供个人养老金资金购买的基金份额。各类基金份额将分别设置对应的基金代码并分别计算各类基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券(包括存托凭证)、备选成份券(包括存托凭证)、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、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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 500 指数成份券及其备选成份券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和股指期货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。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。

本基金的业绩比较基准为中证 500 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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经

发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)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；或者(3)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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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《中国证监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。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理

标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,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。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	120,437,363.16	60,568,364.02
等于：本金	120,408,574.18	60,552,082.89
加：应计利息	28,788.98	16,281.13
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	97,062,268.84	61,494,521.89
等于：本金	97,060,758.89	61,492,532.93
加：应计利息	1,509.95	1,988.96
减：坏账准备	-	-
合计	217,499,632.00	122,062,885.91

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		3,229,324,003.23	-	3,284,661,235.49	55,337,232.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,229,324,003.23	-	3,284,661,235.49	55,337,232.26
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,059,267,335.96	-	2,002,902,446.73	56,364,889.23
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		2,059,267,335.96	-	2,002,902,446.73	56,364,889.23

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	30,752,855.58	-	-	-
股指期货	30,752,855.58	-	-	-

	8			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,752,855.58	-	-	-
	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
项目	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	33,002,042.50	-	-	-
—股指期货	33,002,042.50	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,002,042.50	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2601	IC2601	5	7,455,200.00	-8,486.00
IC2603	IC2603	7	10,313,240.00	628,510.42
IC2606	IC2606	10	14,364,800.00	760,360.00
合计				1,380,384.42
减：可抵销期货暂收款				1,380,384.42
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14,431.08	936.03
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	-	-
预提审计费	48,000.00	50,000.00
合计	62,431.08	50,936.03

7.4.7.7 实收基金

国泰海通中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,512,370,458.39	1,512,370,458.39
本期申购	1,710,722,651.25	1,710,722,651.25
本期赎回（以“-”号填列）	-1,531,643,874.79	-1,531,643,874.79
本期末	1,691,449,234.85	1,691,449,234.85

国泰海通中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	698,650,931.92	698,650,931.92
本期申购	1,857,217,931.02	1,857,217,931.02
本期赎回（以“-”号填列）	-1,535,386,562.44	-1,535,386,562.44
本期末	1,020,482,300.50	1,020,482,300.50

国泰海通中证 500 指数增强 Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	983,462.63	983,462.63
本期赎回（以“-”号填列）	-220,473.82	-220,473.82
本期末	762,988.81	762,988.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰海通中证 500 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
上年度末	10,773,685.35	-46,499,030.65	-35,725,345.30
本期期初	10,773,685.35	-46,499,030.65	-35,725,345.30
本期利润	442,129,189.54	88,180,453.69	530,309,643.23
本期基金份额交易产生的变动数	4,662,382.02	11,764,631.92	16,427,013.94
其中：基金申购款	186,301,061.72	51,443,882.76	237,744,944.48
基金赎回款	-181,638,679.70	-39,679,250.84	-221,317,930.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	457,565,256.91	53,446,054.96	511,011,311.87

国泰海通中证 500 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
上年度末	-3,452,836.96	-21,330,582.21	-24,783,419.17
本期期	-3,452,836.96	-21,330,582.21	-24,783,419.17

初			
本期利润	200,217,975.09	26,251,509.58	226,469,484.67
本期基金份额交易产生的变动数	58,592,149.18	26,689,011.42	85,281,160.60
其中：基金申购款	232,863,138.00	60,089,294.95	292,952,432.95
基金赎回款	-174,270,988.82	-33,400,283.53	-207,671,272.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	255,357,287.31	31,609,938.79	286,967,226.10

国泰海通中证 500 指数增强 Y

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
本期期初	-	-	-
本期利润	60,859.63	-1,124.88	59,734.75
本期基金份额交易产生的变动数	148,171.07	25,215.14	173,386.21
其中：基金申购款	199,496.17	34,834.11	234,330.28
基金赎回款	-51,325.10	-9,618.97	-60,944.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	209,030.70	24,090.26	233,120.96

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	660,586.55	510,160.24
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	76,242.65	104,481.44
结算备付金利息收入	326,397.21	257,782.22

其他	-	-
合计	1,063,226.41	872,423.90

7.4.7.10 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 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	26,082,666,664.03	20,772,849,770.32
减：卖出股票成本总额	25,437,114,666.88	20,565,716,279.00
减：交易费用	20,177,636.79	15,991,648.31
买卖股票差价收入	625,374,360.36	191,141,843.01

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	14,700,653.08	-1,468,551.62
减：其他衍生工具收益应缴纳 增值税	428,174.37	108,664.28
减：交易费用	272,333.51	109,903.50
合计	14,000,145.20	-1,687,119.40

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	29,536,200.12	26,244,265.40
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	29,536,200.12	26,244,265.40

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	111,702,121.49	-17,153,117.46
——股票投资	111,702,121.49	-17,153,117.46

——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	2,773,746.92	-1,479,408.38
——权证投资	-	-
——期货投资	2,773,746.92	-
期货投资	-	-1,479,408.38
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	45,030.02	-
合计	114,430,838.39	-18,632,525.84

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,828,607.26	975,770.65
转换费收入	92,581.14	-
合计	6,921,188.40	975,770.65

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	204.00	186.00
合计	168,204.00	170,186.00

7.4.7.16 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件

的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

基金管理人股东国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，公司名称由国泰君安证券股份有限公司变更为国泰海通证券股份有限公司。

基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司 2025 年 7 月 25 日发布《关于公司法定名称、住所变更的公告》，公司名称由上海国泰君安证券资产管理有限公司变更为上海国泰海通证券资产管理有限公司。

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
上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日
-------	--------------------------------	--------------------------

	月 31 日		至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	52,687,200,367.41	100.00%	41,223,379,611.79	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	3,758,737.53	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	2,961,339.29	100.00%	0.00	0.00%

注：1. 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

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 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	26,849,802.89	18,705,502.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,035,893.85	7,014,131.83
应支付基金管理人的净管理费	16,813,909.04	11,691,370.46

注：本基金的各类基金份额管理费按各类基金份额前一日基金资产净值的管理费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为各类基金份额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。

本基金管理费年费率为 1.00%。本基金可对 Y 类基金份额适用的管理费率进行一定的优惠，具体详见招募说明书或相关公告。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,027,470.61	2,805,825.39

注：本基金各类基金份额的托管费按各类基金份额前一日基金资产净值的托管费的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为各类基金份额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。

本基金托管费年费率为 0.15%。本基金可对 Y 类基金份额适用的托管费率进行一定的优惠，具体详见招募说明书或相关公告。

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 01 月 01 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	国泰海通中证	国泰海通中证	合计

	500 指数增强 A	500 指数增强 C	500 指数增强 Y	
国泰海通证券	-	792,258.96	-	792,258.96
国泰海通资管	-	698,979.86	-	698,979.86
上海银行	-	134,459.36	-	134,459.36
合计	-	1,625,698.18	-	1,625,698.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y	合计
上海银行	-	3,253.48	-	3,253.48
国泰海通证券	-	862,100.40	-	862,100.40
国泰海通资管	-	1,098,162.98	-	1,098,162.98
合计	-	1,963,516.86	-	1,963,516.86

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，其中，A 类、Y 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.4%。

销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

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

R 为 C 类基金份额适用的销售服务费率

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本报告期内及上年度可比期间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，本基金本报告期末及上年度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 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券	97,062,268.84	76,242.65	61,494,521.89	104,481.44
上海银行	120,437,363.16	660,586.55	60,568,364.02	510,160.24

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。
2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025年11月26日	1-6个月 (含)	科创板打新限售	114.28	416.18	344	39,312.32	143,165.92	-
001280	中国铀业	2025年11月25日	1-6个月 (含)	主板打新限售	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
688809	强一股份	2025年12月23日	1-6个月 (含)	科创板打新限售	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-
688802	沐曦股份	2025年12月09日	1-6个月 (含)	科创板打新限售	104.66	399.31	102	10,675.32	40,729.62	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	1-6个月 (含)	主板打新限售	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	1-6个月 (含)	科创板打新限售	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688796	百奥赛图	2025年12月02日	1-6个月 (含)	科创板打新限售	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
301632	广东建科	2025年08月05日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉芯城	2025年09月23日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301491	汉桑科	2025年07月29日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-

	技	日		售						
001369	双欣环保	2025年12月23日	1-6个月(含)	主板打新限售	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
301609	山大电力	2025年07月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025年12月24日	1-6个月(含)	创业板打新限售	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
688790	昂瑞微	2025年12月09日	1-6个月(含)	科创板打新限售	83.06	117.19	86	7,143.16	10,078.34	-
301667	纳百川	2025年12月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025年12月17日	1-6个月(含)	科创板打新限售	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	1-6个月(含)	主板打新限售	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
301668	昊创瑞通	2025年09月15日	1-6个月(含)	创业板打新限售	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	1-6个月(含)	创业板打新限售	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
601026	道生天合	2025年10月09日	1-6个月(含)	主板打新限售	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
301575	艾芬达	2025年09月03日	1-6个月(含)	创业板打新限售	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-

		日		售						
603406	天富龙	2025年07月30日	1-6个月(含)	主板打新限售	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
001388	信通电子	2025年06月24日	1-6个月(含)	主板打新限售	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025年08月27日	1-6个月(含)	主板打新限售	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	1-6个月(含)	主板打新限售	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

注: 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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上海银行股份有限公司，其他银行存款为国泰海通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（2024 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约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、流通受限制的投资品种比

例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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%。

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、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	217,499,632.00	-	-	-	217,499,632.00
结算备付金	26,914,959.39	-	-	-	26,914,959.39
存出保证金	-	-	-	3,855,988.80	3,855,988.80
交易性金融资产	-	-	-	3,284,661,235.49	3,284,661,235.49
应收申购款	-	-	-	7,933,568.83	7,933,568.83
资产总计	244,414,591.39	-	-	3,296,450,793.12	3,540,865,384.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,151,573.61	26,151,573.61
应付管理人报酬	-	-	-	2,856,300.02	2,856,300.02
应付托管费	-	-	-	428,444.98	428,444.98
应付销售服务费	-	-	-	400,804.72	400,804.72
应交税费	-	-	-	59,647.01	59,647.01
其他负债	-	-	-	62,431.08	62,431.08
负债总计	-	-	-	29,959,201.42	29,959,201.42
利率敏感度缺口	244,414,591.39	-	-	3,266,491,591.70	3,510,906,183.09
上年度末 2024 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	122,062,885.91	-	-	-	122,062,885.91
结算备付金	5,449,442.89	-	-	-	5,449,442.89
存出保证金	3,793,041.60	-	-	-	3,793,041.60
交易性金	-	-	-	2,002,902,446.7	2,002,902,446.7

融资产				3	3
应收申购款	-	-	-	33,126,160.57	33,126,160.57
资产总计	131,305,370.40	-	-	2,036,028,607.30	2,167,333,977.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,453,899.43	14,453,899.43
应付管理人报酬	-	-	-	1,810,570.02	1,810,570.02
应付托管费	-	-	-	271,585.49	271,585.49
应付销售服务费	-	-	-	234,360.89	234,360.89
其他负债	-	-	-	50,936.03	50,936.03
负债总计	-	-	-	16,821,351.86	16,821,351.86
利率敏感度缺口	131,305,370.40	-	-	2,019,207,255.44	2,150,512,625.84

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% (2024 年 12 月 31 日: 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 (2024 年 12 月 31 日：同)。

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		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,284,661,235.49	93.56	2,002,902,446.73	93.14
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,284,661,235.49	93.56	2,002,902,446.73	93.14

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	175,608,317.90	107,601,000.16
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-175,608,317.90	-107,601,000.16

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	3,284,097,214.67	2,002,406,248.10
第二层次	-	27,736.50
第三层次	564,020.82	468,462.13
合计	3,284,661,235.49	2,002,902,446.73

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	468,462.13	468,462.13
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	335,947.09	335,947.09
转出第三层次	-	877,229.92	877,229.92
当期利得或损失总额	-	636,841.52	636,841.52
其中：计入损益的利得或损失	-	636,841.52	636,841.52
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	564,020.82	564,020.82
期末仍持有的第三层次金融资产计入	-	339,978.38	339,978.38

本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	484,521.85	484,521.85
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,029,021.54	1,029,021.54
转出第三层次	-	1,305,285.49	1,305,285.49
当期利得或损失总额	-	260,204.23	260,204.23
其中：计入损益的利得或损失	-	260,204.23	260,204.23
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	468,462.13	468,462.13
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	267,717.89	267,717.89

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	564,020.82	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18%-307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限	468,462.13	平均价格亚式期权	预期波动率	34.23%-574.44%	负相关

股票		模型			
----	--	----	--	--	--

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	3,284,661,235.49	92.76
	其中：股票	3,284,661,235.49	92.76
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	244,414,591.39	6.90
8	其他各项资产	11,789,557.63	0.33
9	合计	3,540,865,384.51	100.00

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	36,367,370.00	1.04
B	采矿业	94,667,688.57	2.70
C	制造业	1,894,602,212.92	53.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,840,437.10	2.27
E	建筑业	18,271,708.00	0.52
F	批发和零售业	34,292,701.61	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	12,590,527.48	0.36
H	住宿和餐饮业	23,587,018.00	0.67
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,490,133.62	6.62
J	金融业	177,655,231.68	5.06
K	房地产业	8,379,751.24	0.24
L	租赁和商务服务业	19,986,872.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	6,032,039.91	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	280,955.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,417,490.00	0.07
S	综合	275,889.00	0.01
	合计	2,641,738,026.13	75.24

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

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	1,756,624.41	0.05
B	采矿业	11,575,246.72	0.33
C	制造业	464,325,033.53	13.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,005,930.75	0.91
E	建筑业	45,125.00	0.00
F	批发和零售业	15,844,015.94	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	15,589,794.00	0.44
H	住宿和餐饮业	620,228.00	0.02

I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,312,380.44	1.23
J	金融业	17,316,530.52	0.49
K	房地产业	2,687,220.00	0.08
L	租赁和商务服务业	8,506,845.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	27,921,708.05	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	528,255.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	387,472.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	473,556.00	0.01
S	综合	27,244.00	0.00
	合计	642,923,209.36	18.31

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	300604	长川科技	453,600	45,954,216.00	1.31
2	002281	光迅科技	632,900	44,271,355.00	1.26
3	002414	高德红外	2,777,987	40,753,069.29	1.16
4	600392	盛和资源	1,882,201	40,523,787.53	1.15
5	002558	巨人网络	897,000	38,831,130.00	1.11
6	002624	完美世界	2,319,000	38,008,410.00	1.08
7	600598	北大荒	2,432,600	36,367,370.00	1.04
8	300017	网宿科技	3,497,000	35,844,250.00	1.02
9	002603	以岭药业	2,042,280	34,861,719.60	0.99

10	600685	中船防务	1,219,100	34,683,395.0 0	0.99
11	600380	健康元	2,980,100	34,420,155.0 0	0.98
12	600549	厦门钨业	814,035	33,424,277.1 0	0.95
13	000729	燕京啤酒	2,952,310	33,154,441.3 0	0.94
14	600988	赤峰黄金	1,038,900	32,455,236.0 0	0.92
15	001389	广合科技	396,200	32,341,806.0 0	0.92
16	000933	神火股份	1,146,760	31,501,497.2 0	0.90
17	002156	通富微电	814,100	30,691,570.0 0	0.87
18	601991	大唐发电	8,785,400	30,661,046.0 0	0.87
19	688322	奥比中光	338,870	30,386,472.9 0	0.87
20	688336	三生国健	506,262	30,158,027.3 4	0.86
21	600884	杉杉股份	2,197,188	29,684,009.8 8	0.85
22	000783	长江证券	3,602,100	29,357,115.0 0	0.84
23	000060	中金岭南	4,950,575	28,960,863.7 5	0.82
24	002085	万丰奥威	1,794,800	28,734,748.0 0	0.82
25	300458	全志科技	661,820	27,816,294.6 0	0.79
26	001696	宗申动力	1,253,800	27,194,922.0 0	0.77
27	301308	江波龙	107,600	26,344,784.0 0	0.75
28	002185	华天科技	2,368,800	25,985,736.0 0	0.74
29	002312	川发龙蟒	2,319,231	25,349,194.8 3	0.72
30	300570	太辰光	219,100	25,317,005.0 0	0.72
31	688629	华丰科技	251,849	25,200,010.9 4	0.72

32	600801	华新建材	1,018,400	24,991,536.0 0	0.71
33	688608	恒玄科技	108,731	24,675,413.1 4	0.70
34	600126	杭钢股份	3,007,460	24,540,873.6 0	0.70
35	002008	大族激光	591,900	24,380,361.0 0	0.69
36	601555	东吴证券	2,690,700	24,377,742.0 0	0.69
37	002273	水晶光电	946,792	23,783,415.0 4	0.68
38	600909	华安证券	3,494,930	23,695,625.4 0	0.67
39	600754	锦江酒店	933,400	23,587,018.0 0	0.67
40	688385	复旦微电	310,014	22,848,031.8 0	0.65
41	603341	龙旗科技	540,200	22,828,852.0 0	0.65
42	601918	新集能源	3,437,467	22,721,656.8 7	0.65
43	603486	科沃斯	280,874	22,660,914.3 2	0.65
44	000039	中集集团	2,238,900	22,590,501.0 0	0.64
45	600517	国网英大	3,736,200	22,454,562.0 0	0.64
46	002080	中材科技	604,700	21,974,798.0 0	0.63
47	689009	九号公司	385,626	21,436,949.3 4	0.61
48	002195	岩山科技	2,987,281	21,179,822.2 9	0.60
49	300735	光弘科技	843,972	20,981,143.9 2	0.60
50	000733	振华科技	393,700	20,633,817.0 0	0.59
51	600808	马钢股份	4,869,149	20,547,808.7 8	0.59
52	000513	丽珠集团	594,714	20,493,844.4 4	0.58
53	300454	深信服	172,468	19,861,414.8 8	0.57

54	600739	辽宁成大	1,722,249	19,254,743.8 2	0.55
55	300100	双林股份	485,800	19,247,396.0 0	0.55
56	000959	首钢股份	3,906,500	19,141,850.0 0	0.55
57	002773	康弘药业	628,800	18,845,136.0 0	0.54
58	002926	华西证券	2,026,846	18,809,130.8 8	0.54
59	600873	梅花生物	1,804,800	18,282,624.0 0	0.52
60	600435	北方导航	1,181,800	18,223,356.0 0	0.52
61	000997	新大陆	633,100	17,929,392.0 0	0.51
62	688772	珠海冠宇	810,580	17,451,787.4 0	0.50
63	600170	上海建工	6,582,500	17,443,625.0 0	0.50
64	688387	信科移动	1,303,437	16,814,337.3 0	0.48
65	002402	和而泰	429,632	16,807,203.8 4	0.48
66	002155	湖南黄金	785,430	16,564,718.7 0	0.47
67	002461	珠江啤酒	1,779,125	16,528,071.2 5	0.47
68	603529	爱玛科技	551,390	16,376,283.0 0	0.47
69	000830	鲁西化工	985,900	16,336,363.0 0	0.47
70	603659	璞泰来	595,400	16,278,236.0 0	0.46
71	688347	华虹公司	150,829	16,269,924.2 3	0.46
72	003031	中瓷电子	219,600	16,065,936.0 0	0.46
73	000987	越秀资本	1,965,800	16,001,612.0 0	0.46
74	601665	齐鲁银行	2,758,800	15,835,512.0 0	0.45
75	600487	亨通光电	634,900	15,701,077.0 0	0.45

76	688220	翱捷科技	185,954	15,361,659.94	0.44
77	000960	锡业股份	549,801	15,328,451.88	0.44
78	688235	百济神州	56,707	15,231,500.20	0.43
79	000539	粤电力 A	3,283,800	14,514,396.00	0.41
80	000050	深天马 A	1,586,217	14,323,539.51	0.41
81	300567	精测电子	156,400	14,263,680.00	0.41
82	600021	上海电力	705,000	14,114,100.00	0.40
83	300450	先导智能	279,600	13,974,408.00	0.40
84	301536	星辰科技	231,200	13,851,192.00	0.39
85	002444	巨星科技	395,200	13,444,704.00	0.38
86	002436	兴森科技	616,000	13,040,720.00	0.37
87	301611	珂玛科技	151,600	12,996,668.00	0.37
88	600166	福田汽车	4,438,100	12,959,252.00	0.37
89	601108	财通证券	1,470,500	12,822,760.00	0.37
90	600298	安琪酵母	285,402	12,483,483.48	0.36
91	600096	云天化	359,600	12,014,236.00	0.34
92	688525	佰维存储	104,463	11,991,307.77	0.34
93	688778	厦钨新能	153,904	11,907,552.48	0.34
94	600602	云赛智联	617,400	11,539,206.00	0.33
95	002056	横店东磁	561,100	10,941,450.00	0.31
96	300058	蓝色光标	937,700	10,802,304.00	0.31
97	002153	石基信息	967,400	10,476,942.00	0.30

98	603979	金诚信	129,700	9,876,655.00	0.28
99	300395	菲利华	96,000	9,628,800.00	0.27
100	600906	财达证券	1,423,400	9,494,078.00	0.27
101	603596	伯特利	179,700	9,213,219.00	0.26
102	600060	海信视像	378,500	9,189,980.00	0.26
103	000785	居然智家	3,145,400	9,184,568.00	0.26
104	600118	中国卫星	95,700	9,086,715.00	0.26
105	600282	南钢股份	1,619,414	8,518,117.64	0.24
106	300496	中科创达	125,200	8,451,000.00	0.24
107	002340	格林美	1,003,800	8,391,768.00	0.24
108	603379	三美股份	135,000	8,197,200.00	0.23
109	688561	奇安信	225,381	8,019,055.98	0.23
110	002517	恺英网络	357,600	7,820,712.00	0.22
111	688295	中复神鹰	217,160	7,125,019.60	0.20
112	600583	海油工程	1,290,500	7,084,845.00	0.20
113	600007	中国国贸	355,600	7,047,992.00	0.20
114	600704	物产中大	1,258,255	7,008,480.35	0.20
115	600062	华润双鹤	381,840	6,983,853.60	0.20
116	300136	信维通信	111,500	6,913,000.00	0.20
117	000887	中鼎股份	290,700	6,747,147.00	0.19
118	300054	鼎龙股份	177,400	6,670,240.00	0.19
119	300763	锦浪科技	91,100	6,505,451.00	0.19
120	300373	扬杰科技	95,259	6,477,612.00	0.18
121	688183	生益电子	67,443	6,453,620.67	0.18
122	601216	君正集团	1,329,000	6,405,780.00	0.18
123	000062	深圳华强	248,112	6,108,517.44	0.17
124	688002	睿创微纳	58,401	5,886,820.80	0.17
125	600642	申能股份	733,900	5,709,742.00	0.16
126	002064	华峰化学	499,500	5,494,500.00	0.16
127	002410	广联达	429,020	5,397,071.60	0.15
128	001286	陕西能源	567,000	5,278,770.00	0.15
129	603766	隆鑫通用	327,100	5,269,581.00	0.15
130	000932	华菱钢铁	907,500	5,100,150.00	0.15
131	600004	白云机场	505,500	4,782,030.00	0.14
132	603728	鸣志电器	65,120	4,711,432.00	0.13
133	002430	杭氧股份	157,500	4,704,525.00	0.13
134	600737	中粮糖业	273,300	4,703,493.00	0.13
135	002532	天山铝业	288,100	4,661,458.00	0.13
136	002851	麦格米特	51,400	4,629,598.00	0.13
137	002202	金风科技	226,700	4,624,680.00	0.13
138	688166	博瑞医药	93,500	4,587,110.00	0.13
139	300285	国瓷材料	165,900	4,547,319.00	0.13
140	300390	天华新能	82,100	4,483,481.00	0.13

141	603858	步长制药	283,723	4,437,427.72	0.13
142	301358	湖南裕能	65,600	4,241,696.00	0.12
143	000951	中国重汽	249,800	4,221,620.00	0.12
144	002294	信立泰	83,700	4,147,335.00	0.12
145	003022	联泓新科	206,260	4,086,010.60	0.12
146	300346	南大光电	95,200	4,084,080.00	0.12
147	002508	老板电器	207,580	4,016,673.00	0.11
148	600578	京能电力	776,916	3,962,271.60	0.11
149	688180	君实生物	115,565	3,947,700.40	0.11
150	605589	圣泉集团	136,900	3,874,270.00	0.11
151	002299	圣农发展	232,900	3,852,166.00	0.11
152	600499	科达制造	271,800	3,769,866.00	0.11
153	300037	新宙邦	71,400	3,741,360.00	0.11
154	603707	健友股份	410,000	3,702,300.00	0.11
155	601866	中远海发	1,395,400	3,516,408.00	0.10
156	688018	乐鑫科技	20,488	3,482,960.00	0.10
157	688297	中无人机	72,406	3,476,936.12	0.10
158	600141	兴发集团	96,200	3,326,596.00	0.09
159	000831	中国稀土	70,300	3,264,732.00	0.09
160	601228	广州港	1,000,877	3,242,841.48	0.09
161	600143	金发科技	161,500	3,155,710.00	0.09
162	601717	中创智领	126,400	3,103,120.00	0.09
163	600546	山煤国际	306,500	3,092,585.00	0.09
164	600098	广州发展	468,225	3,062,191.50	0.09
165	601965	中国汽研	183,200	3,041,120.00	0.09
166	600363	联创光电	47,700	3,007,962.00	0.09
167	300223	北京君正	25,400	2,693,416.00	0.08
168	300003	乐普医疗	161,300	2,550,153.00	0.07
169	600863	内蒙华电	566,500	2,537,920.00	0.07
170	300012	华测检测	180,651	2,447,821.05	0.07
171	300001	特锐德	92,900	2,385,672.00	0.07
172	688819	天能股份	68,896	2,288,725.12	0.07
173	000921	海信家电	91,700	2,275,077.00	0.06
174	002841	视源股份	56,600	2,243,058.00	0.06
175	300558	贝达药业	47,600	2,222,444.00	0.06
176	300888	稳健医疗	56,762	2,147,874.08	0.06
177	002261	拓维信息	60,000	1,986,000.00	0.06
178	603160	汇顶科技	24,500	1,935,500.00	0.06
179	601061	中信金属	133,400	1,920,960.00	0.05
180	600967	内蒙一机	113,000	1,898,400.00	0.05
181	002984	森麒麟	84,100	1,780,397.00	0.05
182	000519	中兵红箭	96,600	1,759,086.00	0.05
183	601019	山东出版	203,400	1,757,376.00	0.05

184	002353	杰瑞股份	24,700	1,749,501.00	0.05
185	002966	苏州银行	204,600	1,696,134.00	0.05
186	603444	吉比特	3,997	1,694,128.45	0.05
187	600885	宏发股份	51,449	1,564,049.60	0.04
188	002372	伟星新材	148,600	1,549,898.00	0.04
189	600528	中铁工业	189,100	1,546,838.00	0.04
190	688475	萤石网络	48,461	1,459,160.71	0.04
191	002595	豪迈科技	15,900	1,343,709.00	0.04
192	600663	陆家嘴	168,364	1,331,759.24	0.04
193	000703	恒逸石化	123,400	1,329,018.00	0.04
194	002465	海格通信	83,700	1,318,275.00	0.04
195	300627	华测导航	36,200	1,263,742.00	0.04
196	600968	海油发展	322,500	1,238,400.00	0.04
197	300748	金力永磁	35,500	1,210,905.00	0.03
198	601168	西部矿业	41,300	1,141,532.00	0.03
199	601128	常熟银行	159,400	1,122,176.00	0.03
200	601608	中信重工	165,900	1,093,281.00	0.03
201	300474	景嘉微	15,100	1,085,237.00	0.03
202	000709	河钢股份	393,280	908,476.80	0.03
203	300207	欣旺达	34,299	896,918.85	0.03
204	600352	浙江龙盛	83,804	893,350.64	0.03
205	603345	安井食品	10,800	856,224.00	0.02
206	688099	晶晨股份	9,810	855,726.30	0.02
207	000528	柳工	71,390	847,399.30	0.02
208	600970	中材国际	79,700	828,083.00	0.02
209	000423	东阿阿胶	16,400	804,912.00	0.02
210	300146	汤臣倍健	66,400	797,464.00	0.02
211	600535	天士力	52,442	790,300.94	0.02
212	301498	乖宝宠物	11,900	775,285.00	0.02
213	688425	铁建重工	148,600	753,402.00	0.02
214	300339	润和软件	13,900	688,050.00	0.02
215	300144	宋城演艺	80,600	660,114.00	0.02
216	688114	华大智造	10,600	644,056.00	0.02
217	688301	奕瑞科技	6,369	643,969.59	0.02
218	000429	粤高速 A	52,400	617,272.00	0.02
219	000738	航发控制	28,200	600,942.00	0.02
220	688248	南网科技	12,139	543,098.86	0.02
221	002152	广电运通	34,144	471,528.64	0.01
222	300699	光威复材	11,900	469,574.00	0.01
223	300751	迈为股份	2,200	453,178.00	0.01
224	000400	许继电气	17,500	449,925.00	0.01
225	601198	东兴证券	32,000	444,160.00	0.01
226	688213	思特威	4,468	424,862.12	0.01

227	000009	中国宝安	42,384	417,482.40	0.01
228	600901	江苏金租	67,100	410,652.00	0.01
229	688599	天合光能	24,000	397,200.00	0.01
230	600765	中航重机	20,000	383,200.00	0.01
231	600390	五矿资本	68,300	379,065.00	0.01
232	002138	顺络电子	9,300	330,429.00	0.01
233	600038	中直股份	8,800	317,944.00	0.01
234	002683	广东宏大	5,900	282,020.00	0.01
235	300140	节能环境	41,500	280,955.00	0.01
236	600673	东阳光	12,300	275,889.00	0.01
237	000088	盐田港	61,200	272,340.00	0.01
238	600497	驰宏锌锗	34,800	254,388.00	0.01
239	688192	迪哲医药	4,200	241,920.00	0.01
240	002409	雅克科技	3,200	237,120.00	0.01
241	601699	潞安环能	17,800	210,040.00	0.01
242	600109	国金证券	19,300	179,490.00	0.01
243	002265	建设工业	6,000	160,920.00	0.00
244	603565	中谷物流	15,900	159,636.00	0.00
245	603338	浙江鼎力	2,600	147,264.00	0.00
246	601099	太平洋	32,000	131,520.00	0.00
247	688582	芯动联科	1,798	118,865.78	0.00
248	601233	桐昆股份	6,300	108,423.00	0.00
249	688728	格科微	7,220	107,866.80	0.00
250	300073	当升科技	1,800	104,040.00	0.00
251	601997	贵阳银行	4,500	26,415.00	0.00
252	600299	安迪苏	900	8,073.00	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

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	300008	天海防务	2,919,780	23,037,064.20	0.66
2	688208	道通科技	598,559	22,026,971.20	0.63
3	002593	日上集团	2,512,500	14,848,875.00	0.42
4	002940	昂利康	412,500	13,827,000.00	0.39
5	002734	利民股份	859,200	13,695,648.00	0.39
6	000686	东北证券	1,412,936	13,168,563.5	0.38

				2	
7	688343	云天励飞	167,800	12,766,224.0 0	0.36
8	300299	富春股份	1,783,500	12,662,850.0 0	0.36
9	688148	芳源股份	1,435,024	12,585,160.4 8	0.36
10	002950	奥美医疗	1,117,300	12,200,916.0 0	0.35
11	002931	锋龙股份	371,100	11,763,870.0 0	0.34
12	002468	申通快递	862,500	11,574,750.0 0	0.33
13	300172	中电环保	2,064,275	11,250,298.7 5	0.32
14	002222	福晶科技	195,700	11,025,738.0 0	0.31
15	603185	弘元绿能	345,300	10,531,650.0 0	0.30
16	300438	鹏辉能源	194,200	10,335,324.0 0	0.29
17	603236	移远通信	105,100	10,027,591.0 0	0.29
18	600031	三一重工	454,500	9,603,585.00	0.27
19	603259	药明康德	105,600	9,571,584.00	0.27
20	002246	北化股份	513,100	9,246,062.00	0.26
21	300139	晓程科技	282,700	8,582,772.00	0.24
22	002811	郑中设计	569,100	8,445,444.00	0.24
23	600795	国电电力	1,631,600	8,223,264.00	0.23
24	000017	深中华 A	989,200	7,785,004.00	0.22
25	688373	盟科药业	1,278,036	7,719,337.44	0.22
26	688280	精进电动	862,220	7,501,314.00	0.21
27	600267	海正药业	744,234	7,360,474.26	0.21
28	002365	永安药业	487,100	7,267,532.00	0.21
29	000949	新乡化纤	1,221,100	6,716,050.00	0.19
30	002440	闰土股份	885,439	6,614,229.33	0.19
31	600573	惠泉啤酒	544,900	6,500,657.00	0.19
32	300283	温州宏丰	853,300	6,425,349.00	0.18
33	688331	荣昌生物	81,724	6,357,309.96	0.18
34	603005	晶方科技	229,200	6,339,672.00	0.18
35	300127	银河磁体	205,600	6,235,848.00	0.18
36	603367	辰欣药业	340,600	5,899,192.00	0.17
37	300696	爱乐达	182,900	5,836,339.00	0.17

38	002250	联化科技	417,200	5,582,136.00	0.16
39	300358	楚天科技	546,600	5,351,214.00	0.15
40	600100	同方股份	589,000	5,253,880.00	0.15
41	002004	华邦健康	1,098,800	5,252,264.00	0.15
42	688108	赛诺医疗	272,621	5,245,228.04	0.15
43	300726	宏达电子	102,100	5,197,911.00	0.15
44	000993	闽东电力	424,900	5,090,302.00	0.14
45	002560	通达股份	469,675	4,734,324.00	0.13
46	000421	南京公用	673,700	4,655,267.00	0.13
47	002286	保龄宝	501,200	4,480,728.00	0.13
48	300043	星辉娱乐	758,900	4,287,785.00	0.12
49	300153	科泰电源	143,100	4,159,917.00	0.12
50	002204	大连重工	537,000	4,108,050.00	0.12
51	603682	锦和商管	622,800	4,104,252.00	0.12
52	002398	垒知集团	689,500	3,874,990.00	0.11
53	601126	四方股份	125,100	3,763,008.00	0.11
54	601890	亚星锚链	343,900	3,538,731.00	0.10
55	688443	智翔金泰	128,870	3,510,418.80	0.10
56	300045	华力创通	116,300	3,362,233.00	0.10
57	002614	奥佳华	458,500	3,351,635.00	0.10
58	688222	成都先导	136,559	3,202,308.55	0.09
59	600288	大恒科技	211,500	3,168,270.00	0.09
60	302132	中航成飞	39,900	3,152,100.00	0.09
61	002386	天原股份	572,690	3,109,706.70	0.09
62	300898	熊猫乳品	111,812	3,011,097.16	0.09
63	300277	海联讯	226,002	2,949,326.10	0.08
64	002967	广电计量	133,900	2,947,139.00	0.08
65	300509	新美星	223,200	2,865,888.00	0.08
66	002090	金智科技	241,900	2,854,420.00	0.08
67	601326	秦港股份	817,800	2,854,122.00	0.08
68	600120	浙江东方	446,500	2,754,905.00	0.08
69	301365	矩阵股份	114,100	2,720,144.00	0.08
70	002669	康达新材	174,300	2,649,360.00	0.08
71	002587	奥拓电子	391,400	2,645,864.00	0.08
72	301408	华人健康	140,900	2,615,104.00	0.07
73	300018	中元股份	225,800	2,483,800.00	0.07
74	300805	电声股份	232,900	2,457,095.00	0.07
75	688365	光云科技	144,082	2,430,663.34	0.07
76	300945	曼卡龙	146,400	2,365,824.00	0.07
77	002137	实益达	274,600	2,356,068.00	0.07
78	002625	光启技术	48,000	2,340,480.00	0.07
79	688062	迈威生物	59,204	2,277,577.88	0.06
80	002314	南山控股	790,600	2,253,210.00	0.06

81	300775	三角防务	73,600	2,237,440.00	0.06
82	688231	隆达股份	84,739	2,203,214.00	0.06
83	000601	韶能股份	449,400	2,112,180.00	0.06
84	688609	九联科技	206,456	2,107,915.76	0.06
85	600785	新华百货	154,400	2,092,120.00	0.06
86	601898	中煤能源	162,600	2,022,744.00	0.06
87	301551	无线传媒	63,000	1,987,650.00	0.06
88	002097	山河智能	158,100	1,962,021.00	0.06
89	002358	森源电气	360,700	1,954,994.00	0.06
90	002758	浙农股份	194,000	1,953,580.00	0.06
91	002863	今飞凯达	332,300	1,950,601.00	0.06
92	002054	德美化工	255,600	1,886,328.00	0.05
93	600212	绿能慧充	227,500	1,831,375.00	0.05
94	300407	凯发电气	161,400	1,827,048.00	0.05
95	600354	敦煌种业	271,503	1,756,624.41	0.05
96	002488	金固股份	198,600	1,745,694.00	0.05
97	002406	远东传动	216,600	1,719,804.00	0.05
98	002878	元隆雅图	93,200	1,698,104.00	0.05
99	688779	五矿新能	224,130	1,678,733.70	0.05
100	300513	恒实科技	174,500	1,656,005.00	0.05
101	002117	东港股份	117,200	1,618,532.00	0.05
102	300620	光库科技	11,000	1,617,550.00	0.05
103	000019	深粮控股	229,700	1,596,415.00	0.05
104	600590	泰豪科技	169,500	1,594,995.00	0.05
105	603585	苏利股份	80,200	1,512,572.00	0.04
106	002942	新农股份	76,900	1,478,018.00	0.04
107	600309	万华化学	18,500	1,418,580.00	0.04
108	688661	和林微纳	25,575	1,323,762.00	0.04
109	002248	华东数控	114,500	1,320,185.00	0.04
110	300394	天孚通信	6,500	1,319,695.00	0.04
111	002174	游族网络	105,400	1,290,096.00	0.04
112	600619	海立股份	60,900	1,284,990.00	0.04
113	301138	华研精机	33,100	1,284,280.00	0.04
114	300719	安达维尔	69,600	1,260,456.00	0.04
115	002404	嘉欣丝绸	176,300	1,235,863.00	0.04
116	603697	有友食品	100,100	1,226,225.00	0.03
117	300871	回盛生物	57,700	1,196,121.00	0.03
118	601022	宁波远洋	126,600	1,160,922.00	0.03
119	002042	华孚时尚	264,900	1,125,825.00	0.03
120	688031	星环科技	10,400	1,125,176.00	0.03
121	000725	京东方 A	265,600	1,118,176.00	0.03
122	688396	华润微	20,600	1,088,916.00	0.03
123	002111	威海广泰	102,400	1,077,248.00	0.03

124	600019	宝钢股份	143,000	1,065,350.00	0.03
125	300129	泰胜风能	100,800	1,054,368.00	0.03
126	000554	泰山石油	160,200	1,038,096.00	0.03
127	002803	吉宏股份	61,500	1,006,140.00	0.03
128	600571	信雅达	63,200	1,003,616.00	0.03
129	300727	润禾材料	28,100	1,001,484.00	0.03
130	002091	江苏国泰	109,900	992,397.00	0.03
131	301038	深水规院	42,300	991,935.00	0.03
132	300221	银禧科技	95,700	987,624.00	0.03
133	002487	大金重工	18,600	965,898.00	0.03
134	603166	福达股份	61,100	959,270.00	0.03
135	002916	深南电路	4,100	952,389.00	0.03
136	688591	泰凌微	21,200	902,272.00	0.03
137	688499	利元亨	15,500	894,660.00	0.03
138	001337	四川黄金	31,100	866,446.00	0.02
139	002849	威星智能	50,700	806,130.00	0.02
140	002317	众生药业	42,300	802,854.00	0.02
141	301021	英诺激光	16,500	802,725.00	0.02
142	600366	宁波韵升	57,900	798,441.00	0.02
143	300034	钢研高纳	38,600	755,788.00	0.02
144	300269	联建光电	113,200	742,592.00	0.02
145	300206	理邦仪器	55,500	709,845.00	0.02
146	002946	新乳业	37,100	687,463.00	0.02
147	300132	青松股份	78,600	684,606.00	0.02
148	002255	海陆重工	54,100	682,742.00	0.02
149	600389	江山股份	26,500	669,920.00	0.02
150	603008	喜临门	32,600	667,648.00	0.02
151	300456	赛微电子	11,800	660,328.00	0.02
152	688136	科兴制药	20,576	651,641.92	0.02
153	600738	丽尚国潮	126,100	650,676.00	0.02
154	301073	君亭酒店	23,800	620,228.00	0.02
155	600919	江苏银行	58,200	605,280.00	0.02
156	002755	奥赛康	36,600	597,678.00	0.02
157	601086	国芳集团	58,500	594,945.00	0.02
158	300553	集智股份	14,400	581,616.00	0.02
159	002697	红旗连锁	97,700	580,338.00	0.02
160	002550	千红制药	71,500	561,990.00	0.02
161	300502	新易盛	1,300	560,144.00	0.02
162	300016	北陆药业	70,100	556,594.00	0.02
163	300548	长芯博创	3,800	539,600.00	0.02
164	603799	华友钴业	7,600	518,776.00	0.01
165	688275	万润新能	6,758	509,553.20	0.01
166	300033	同花顺	1,500	483,270.00	0.01

167	300681	英搏尔	18,900	473,634.00	0.01
168	301052	果麦文化	12,400	473,556.00	0.01
169	688636	智明达	10,933	468,369.72	0.01
170	002162	悦心健康	99,700	464,602.00	0.01
171	603901	永创智能	31,900	452,980.00	0.01
172	300917	特发服务	11,100	434,010.00	0.01
173	600576	祥源文旅	68,800	429,312.00	0.01
174	688660	电气风电	24,100	409,941.00	0.01
175	002184	海得控制	31,200	408,408.00	0.01
176	600071	凤凰光学	18,900	406,350.00	0.01
177	002172	澳洋健康	97,600	387,472.00	0.01
178	603115	海星股份	19,500	364,845.00	0.01
179	300709	精研科技	7,400	348,984.00	0.01
180	001376	百通能源	20,600	346,904.00	0.01
181	300113	顺网科技	17,000	344,080.00	0.01
182	002787	华源控股	26,900	334,905.00	0.01
183	600410	华胜天成	18,600	332,568.00	0.01
184	301526	国际复材	47,400	331,800.00	0.01
185	600999	招商证券	18,300	304,512.00	0.01
186	000576	甘化科工	27,700	291,681.00	0.01
187	002119	康强电子	16,800	276,696.00	0.01
188	001332	锡装股份	4,900	275,331.00	0.01
189	002658	雪迪龙	29,400	265,482.00	0.01
190	300065	海兰信	13,800	250,746.00	0.01
191	002181	粤传媒	28,700	247,394.00	0.01
192	688088	虹软科技	4,710	233,145.00	0.01
193	600082	海泰发展	55,984	227,295.04	0.01
194	002364	中恒电气	8,500	224,740.00	0.01
195	603811	诚意药业	21,300	223,650.00	0.01
196	600644	乐山电力	22,900	223,275.00	0.01
197	600300	维维股份	63,000	221,130.00	0.01
198	301150	中一科技	4,800	201,552.00	0.01
199	002023	海特高新	14,800	200,392.00	0.01
200	603787	新日股份	12,400	174,344.00	0.00
201	301028	鼎熔岩	11,900	173,502.00	0.00
202	300573	兴齐眼药	2,345	164,830.05	0.00
203	600722	金牛化工	25,200	149,688.00	0.00
204	600660	福耀玻璃	2,300	148,971.00	0.00
205	688795	摩尔线程	344	143,165.92	0.00
206	600478	科力远	20,705	142,657.45	0.00
207	603181	皇马科技	9,700	138,613.00	0.00
208	301158	德石股份	5,800	129,746.00	0.00
209	301110	青木科技	1,900	125,742.00	0.00

210	688321	微芯生物	4,139	120,941.58	0.00
211	000501	武商集团	11,500	116,380.00	0.00
212	300995	奇德新材	2,800	115,668.00	0.00
213	688182	灿勤科技	3,600	106,272.00	0.00
214	600011	华能国际	14,000	104,440.00	0.00
215	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
216	300768	迪普科技	5,200	96,356.00	0.00
217	603980	吉华集团	16,800	84,672.00	0.00
218	002164	宁波东力	5,200	83,252.00	0.00
219	301338	凯格精机	900	79,299.00	0.00
220	300798	锦鸡股份	11,100	78,921.00	0.00
221	000888	峨眉山 A	6,000	78,720.00	0.00
222	600469	风神股份	11,100	77,034.00	0.00
223	600160	巨化股份	1,900	72,998.00	0.00
224	002731	萃华珠宝	5,100	64,056.00	0.00
225	300801	泰和科技	2,200	60,786.00	0.00
226	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
227	600965	福成股份	8,500	50,575.00	0.00
228	603680	今创集团	3,000	46,230.00	0.00
229	002826	易明医药	2,300	42,274.00	0.00
230	688802	沐曦股份	102	40,729.62	0.00
231	002307	北新路桥	6,900	34,845.00	0.00
232	301529	福赛科技	300	33,930.00	0.00
233	002975	博杰股份	400	30,800.00	0.00
234	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
235	688512	慧智微	2,500	27,900.00	0.00
236	000833	粤桂股份	1,400	27,244.00	0.00
237	300988	津荣天宇	1,000	22,750.00	0.00
238	002912	中新赛克	700	21,098.00	0.00
239	002209	达意隆	1,300	20,956.00	0.00
240	301305	朗坤科技	900	20,223.00	0.00
241	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
242	300505	川金诺	800	17,912.00	0.00
243	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
244	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
245	603538	美诺华	800	15,392.00	0.00
246	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
247	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
248	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
249	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
250	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
251	002116	中国海诚	1,000	10,280.00	0.00
252	688790	昂瑞微	86	10,078.34	0.00

253	002337	赛象科技	1,400	9,198.00	0.00
254	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
255	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
256	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
257	002165	红宝丽	1,000	7,560.00	0.00
258	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
259	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
260	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
261	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
262	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
263	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
264	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
265	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	187,625,923.98	8.72
2	300604	长川科技	158,988,603.76	7.39
3	002008	大族激光	153,137,227.04	7.12
4	600699	均胜电子	137,371,122.80	6.39
5	002558	巨人网络	136,065,146.40	6.33
6	300017	网宿科技	131,400,227.21	6.11
7	689009	九号公司	125,244,294.47	5.82
8	600685	中船防务	124,431,063.32	5.79
9	002056	横店东磁	120,149,317.00	5.59
10	600118	中国卫星	119,371,053.00	5.55
11	002926	华西证券	117,592,275.90	5.47
12	301165	锐捷网络	117,238,992.00	5.45
13	002281	光迅科技	116,728,141.10	5.43
14	002273	水晶光电	114,583,613.02	5.33
15	600839	四川长虹	113,216,080.99	5.26
16	000039	中集集团	113,124,012.40	5.26
17	603893	瑞芯微	113,095,761.80	5.26
18	600096	云天化	112,131,501.46	5.21
19	600549	厦门钨业	109,204,854.45	5.08
20	002624	完美世界	106,909,845.00	4.97
21	300735	光弘科技	105,863,887.03	4.92
22	688220	翱捷科技	104,362,165.68	4.85
23	002436	兴森科技	103,983,990.37	4.84

24	300458	全志科技	102,792,562.27	4.78
25	300251	光线传媒	102,611,490.25	4.77
26	603228	景旺电子	102,532,315.50	4.77
27	000513	丽珠集团	100,890,214.72	4.69
28	002603	以岭药业	100,577,974.40	4.68
29	300496	中科创达	99,584,208.55	4.63
30	688235	百济神州	99,142,211.58	4.61
31	000988	华工科技	98,629,922.10	4.59
32	603341	龙旗科技	97,430,448.14	4.53
33	002080	中材科技	95,414,722.76	4.44
34	001389	广合科技	94,503,813.34	4.39
35	300373	扬杰科技	94,450,350.28	4.39
36	600598	北大荒	92,893,749.00	4.32
37	000960	锡业股份	92,677,592.89	4.31
38	002294	信立泰	90,815,186.00	4.22
39	300339	润和软件	90,681,806.00	4.22
40	601991	大唐发电	88,795,936.00	4.13
41	688183	生益电子	88,663,987.70	4.12
42	601216	君正集团	88,104,403.00	4.10
43	002414	高德红外	86,997,515.94	4.05
44	601555	东吴证券	86,927,106.00	4.04
45	600062	华润双鹤	86,095,072.89	4.00
46	600352	浙江龙盛	85,342,917.32	3.97
47	688180	君实生物	84,474,923.37	3.93
48	000830	鲁西化工	84,398,756.85	3.92
49	002773	康弘药业	84,290,285.75	3.92
50	600535	天士力	84,138,435.00	3.91
51	000559	万向钱潮	83,990,786.00	3.91
52	000783	长江证券	83,974,350.10	3.90
53	601179	中国西电	83,879,671.04	3.90
54	002312	川发龙蟒	82,985,518.31	3.86
55	000959	首钢股份	82,953,325.37	3.86
56	002625	光启技术	82,464,239.61	3.83
57	300570	太辰光	82,050,538.26	3.82
58	002156	通富微电	80,768,713.00	3.76
59	002340	格林美	80,716,700.80	3.75
60	002841	视源股份	79,818,259.00	3.71
61	600170	上海建工	79,464,997.00	3.70
62	600906	财达证券	79,227,625.00	3.68
63	688608	恒玄科技	78,904,599.09	3.67
64	688387	信科移动	78,641,390.58	3.66
65	603858	步长制药	77,132,488.64	3.59
66	601399	国机重装	76,956,253.12	3.58

67	600380	健康元	76,541,689.13	3.56
68	002195	岩山科技	76,157,062.90	3.54
69	300207	欣旺达	75,839,467.21	3.53
70	688249	晶合集成	75,622,929.27	3.52
71	000021	深科技	75,269,506.75	3.50
72	000729	燕京啤酒	74,327,987.90	3.46
73	600339	中油工程	74,299,387.00	3.45
74	688578	艾力斯	74,263,284.45	3.45
75	600739	辽宁成大	73,633,094.74	3.42
76	000933	神火股份	73,493,344.80	3.42
77	600497	驰宏锌锗	72,717,401.48	3.38
78	002152	广电运通	72,149,980.46	3.36
79	300146	汤臣倍健	71,291,800.00	3.32
80	601608	中信重工	71,232,597.61	3.31
81	688385	复旦微电	71,142,458.64	3.31
82	000009	中国宝安	70,942,067.38	3.30
83	600884	杉杉股份	70,280,856.84	3.27
84	600909	华安证券	69,805,701.80	3.25
85	300803	指南针	69,197,736.80	3.22
86	300223	北京君正	69,138,324.01	3.21
87	002430	杭氧股份	69,028,244.06	3.21
88	688629	华丰科技	68,696,392.18	3.19
89	002185	华天科技	68,608,390.58	3.19
90	002410	广联达	68,432,175.40	3.18
91	600988	赤峰黄金	68,248,405.00	3.17
92	002155	湖南黄金	67,856,046.80	3.16
93	600141	兴发集团	67,739,493.00	3.15
94	300558	贝达药业	67,594,766.00	3.14
95	601918	新集能源	67,300,512.00	3.13
96	002945	华林证券	67,208,518.00	3.13
97	600143	金发科技	66,501,221.00	3.09
98	301236	软通动力	66,264,724.00	3.08
99	600282	南钢股份	66,162,381.24	3.08
100	600663	陆家嘴	65,967,794.62	3.07
101	601228	广州港	65,778,317.00	3.06
102	601665	齐鲁银行	65,103,893.00	3.03
103	688772	珠海冠宇	65,010,816.68	3.02
104	601198	东兴证券	64,808,076.00	3.01
105	601168	西部矿业	64,772,010.04	3.01
106	301536	星宸科技	64,368,174.05	2.99
107	002683	广东宏大	64,283,696.13	2.99
108	603087	甘李药业	64,061,815.05	2.98
109	600873	梅花生物	63,960,095.00	2.97

110	000060	中金岭南	63,887,343.50	2.97
111	301308	江波龙	63,648,755.38	2.96
112	000728	国元证券	62,623,353.10	2.91
113	600959	江苏有线	62,435,825.32	2.90
114	600704	物产中大	61,918,575.85	2.88
115	600517	国网英大	61,711,095.98	2.87
116	300573	兴齐眼药	61,709,082.73	2.87
117	300012	华测检测	60,809,812.00	2.83
118	002202	金风科技	60,668,755.90	2.82
119	002461	珠江啤酒	60,566,761.50	2.82
120	000543	皖能电力	59,982,244.50	2.79
121	000750	国海证券	59,731,993.20	2.78
122	600801	华新建材	59,575,525.05	2.77
123	000878	云南铜业	59,263,199.28	2.76
124	600521	华海药业	59,177,932.01	2.75
125	000987	越秀资本	59,060,710.16	2.75
126	300115	长盈精密	59,045,410.26	2.75
127	600928	西安银行	58,560,802.94	2.72
128	603486	科沃斯	58,448,736.58	2.72
129	300567	精测电子	58,258,589.87	2.71
130	601118	海南橡胶	58,158,691.00	2.70
131	601990	南京证券	58,062,693.00	2.70
132	600298	安琪酵母	58,006,865.34	2.70
133	688469	芯联集成	57,939,414.96	2.69
134	600267	海正药业	57,767,662.00	2.69
135	688280	精进电动	57,415,287.71	2.67
136	688343	云天励飞	57,079,263.54	2.65
137	601611	中国核建	56,150,470.00	2.61
138	300024	机器人	55,972,389.00	2.60
139	600155	华创云信	55,686,091.00	2.59
140	688425	铁建重工	55,538,623.99	2.58
141	600578	京能电力	55,266,314.08	2.57
142	600435	北方导航	55,094,501.28	2.56
143	600060	海信视像	54,923,970.00	2.55
144	600166	福田汽车	54,701,614.00	2.54
145	600879	航天电子	53,978,829.00	2.51
146	601997	贵阳银行	53,596,266.00	2.49
147	600673	东阳光	53,406,863.00	2.48
148	600392	盛和资源	53,404,691.13	2.48
149	603160	汇顶科技	53,264,479.76	2.48
150	001696	宗申动力	52,919,681.27	2.46
151	600299	安迪苏	52,279,153.28	2.43
152	002607	中公教育	52,227,777.00	2.43

153	688361	中科飞测	52,224,285.39	2.43
154	300003	乐普医疗	52,062,625.60	2.42
155	600098	广州发展	51,933,702.25	2.41
156	000683	博源化工	51,866,188.00	2.41
157	600021	上海电力	51,061,407.00	2.37
158	601858	中国科传	51,039,520.00	2.37
159	300113	顺网科技	51,021,783.00	2.37
160	000582	北部湾港	50,877,849.96	2.37
161	002673	西部证券	50,770,563.44	2.36
162	600007	中国国贸	50,442,956.50	2.35
163	688018	乐鑫科技	50,174,924.18	2.33
164	300395	菲利华	49,959,335.00	2.32
165	600582	天地科技	49,524,217.46	2.30
166	601231	环旭电子	49,375,809.00	2.30
167	688176	亚虹医药	49,335,867.40	2.29
168	601966	玲珑轮胎	49,304,994.00	2.29
169	002532	天山铝业	49,228,465.35	2.29
170	603659	璞泰来	49,024,713.40	2.28
171	601866	中远海发	48,837,391.00	2.27
172	000539	粤电力 A	48,554,825.00	2.26
173	688099	晶晨股份	47,975,674.51	2.23
174	300450	先导智能	47,225,199.28	2.20
175	601958	金铂股份	47,017,360.43	2.19
176	000887	中鼎股份	46,900,595.00	2.18
177	300676	华大基因	46,813,950.99	2.18
178	688591	泰凌微	46,797,299.45	2.18
179	300136	信维通信	46,558,764.00	2.17
180	002385	大北农	46,555,767.00	2.16
181	003022	联泓新科	45,730,213.50	2.13
182	300454	深信服	45,721,180.93	2.13
183	000686	东北证券	45,499,968.20	2.12
184	688192	迪哲医药	45,457,604.68	2.11
185	688538	和辉光电	45,395,603.85	2.11
186	002507	涪陵榨菜	45,354,953.10	2.11
187	002085	万丰奥威	45,253,045.52	2.10
188	600498	烽火通信	44,947,500.00	2.09
189	601212	白银有色	44,636,282.00	2.08
190	002261	拓维信息	44,557,298.10	2.07
191	002409	雅克科技	44,312,366.65	2.06
192	000733	振华科技	44,295,658.49	2.06
193	002500	山西证券	44,229,188.40	2.06
194	688373	盟科药业	44,147,370.57	2.05
195	000967	盈峰环境	43,148,363.78	2.01

196	300054	鼎龙股份	43,090,584.00	2.00
-----	--------	------	---------------	------

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	221,262,308.87	10.29
2	600699	均胜电子	156,335,073.48	7.27
3	002008	大族激光	152,219,938.32	7.08
4	300604	长川科技	144,574,590.60	6.72
5	600096	云天化	139,909,464.00	6.51
6	603893	瑞芯微	135,758,821.55	6.31
7	301165	锐捷网络	127,966,247.92	5.95
8	600118	中国卫星	127,139,034.01	5.91
9	002558	巨人网络	124,945,053.99	5.81
10	600839	四川长虹	122,157,870.28	5.68
11	002926	华西证券	121,825,572.76	5.66
12	002273	水晶光电	120,224,356.33	5.59
13	000559	万向钱潮	117,684,855.55	5.47
14	000039	中集集团	115,379,318.70	5.37
15	000988	华工科技	113,027,095.48	5.26
16	002056	横店东磁	112,368,554.42	5.23
17	000021	深科技	111,359,251.00	5.18
18	689009	九号公司	107,417,721.25	4.99
19	601399	国机重装	107,294,358.48	4.99
20	300339	润和软件	107,184,557.03	4.98
21	603228	景旺电子	106,342,978.26	4.95
22	688183	生益电子	105,062,886.52	4.89
23	300251	光线传媒	100,654,518.82	4.68
24	601608	中信重工	100,433,162.77	4.67
25	300373	扬杰科技	100,283,844.35	4.66
26	688180	君实生物	98,461,057.34	4.58
27	601179	中国西电	97,686,117.80	4.54
28	300496	中科创达	97,376,524.27	4.53
29	600352	浙江龙盛	95,518,334.00	4.44
30	000009	中国宝安	94,848,549.36	4.41
31	300017	网宿科技	94,624,714.55	4.40
32	600497	驰宏锌锗	93,198,722.00	4.33
33	688235	百济神州	93,097,882.90	4.33
34	000960	锡业股份	92,972,124.72	4.32
35	002294	信立泰	92,913,199.00	4.32

36	600685	中船防务	92,729,768.97	4.31
37	002436	兴森科技	91,892,822.82	4.27
38	688220	翱捷科技	91,141,385.62	4.24
39	300735	光弘科技	90,980,518.07	4.23
40	688469	芯联集成	90,357,421.79	4.20
41	603087	甘李药业	89,809,910.59	4.18
42	002414	高德红外	89,514,889.43	4.16
43	600141	兴发集团	88,467,509.00	4.11
44	601555	东吴证券	86,410,160.39	4.02
45	002625	光启技术	86,057,132.91	4.00
46	002340	格林美	85,927,216.40	4.00
47	000830	鲁西化工	84,844,857.93	3.95
48	601168	西部矿业	84,523,696.00	3.93
49	600170	上海建工	83,850,042.92	3.90
50	600535	天士力	83,529,716.40	3.88
51	002080	中材科技	82,874,071.64	3.85
52	600549	厦门钨业	82,339,848.50	3.83
53	000513	丽珠集团	81,809,820.00	3.80
54	300207	欣旺达	81,782,967.80	3.80
55	601216	君正集团	81,671,834.00	3.80
56	002281	光迅科技	81,122,070.29	3.77
57	002410	广联达	80,906,991.80	3.76
58	600906	财达证券	80,797,390.76	3.76
59	688578	艾力斯	80,367,944.76	3.74
60	600062	华润双鹤	80,034,798.46	3.72
61	000783	长江证券	78,682,750.12	3.66
62	600339	中油工程	77,569,073.00	3.61
63	002841	视源股份	76,650,769.81	3.56
64	601991	大唐发电	75,750,846.00	3.52
65	300803	指南针	75,214,235.86	3.50
66	002430	杭氧股份	73,845,449.21	3.43
67	300458	全志科技	73,365,305.64	3.41
68	002603	以岭药业	72,885,676.21	3.39
69	600578	京能电力	72,802,982.00	3.39
70	600879	航天电子	72,448,698.00	3.37
71	603858	步长制药	72,110,843.40	3.35
72	601997	贵阳银行	72,091,719.00	3.35
73	000959	首钢股份	71,845,425.95	3.34
74	688249	晶合集成	71,829,513.18	3.34
75	002152	广电运通	71,652,038.00	3.33
76	301236	软通动力	71,549,928.25	3.33
77	603341	龙旗科技	71,432,720.00	3.32
78	300573	兴齐眼药	71,304,282.25	3.32

79	688387	信科移动	71,293,785.81	3.32
80	002624	完美世界	71,242,630.00	3.31
81	300146	汤臣倍健	70,992,491.00	3.30
82	600143	金发科技	70,894,413.00	3.30
83	000728	国元证券	70,720,296.05	3.29
84	600704	物产中大	70,422,719.20	3.27
85	002202	金风科技	70,325,900.73	3.27
86	300558	贝达药业	70,325,016.36	3.27
87	002773	康弘药业	70,096,274.14	3.26
88	002385	大北农	69,360,279.62	3.23
89	300223	北京君正	69,288,177.38	3.22
90	000878	云南铜业	68,068,794.56	3.17
91	600582	天地科技	68,051,335.13	3.16
92	001389	广合科技	67,810,895.40	3.15
93	002945	华林证券	67,729,575.90	3.15
94	600521	华海药业	67,429,986.00	3.14
95	601198	东兴证券	66,527,927.00	3.09
96	000683	博源化工	66,148,233.68	3.08
97	600959	江苏有线	66,054,180.49	3.07
98	601866	中远海发	65,857,021.00	3.06
99	600380	健康元	64,912,579.27	3.02
100	688772	珠海冠宇	64,491,613.77	3.00
101	600663	陆家嘴	64,473,734.37	3.00
102	300012	华测检测	63,624,462.93	2.96
103	000543	皖能电力	62,865,006.70	2.92
104	600098	广州发展	62,731,934.00	2.92
105	002683	广东宏大	62,401,550.56	2.90
106	601228	广州港	62,251,412.05	2.89
107	688425	铁建重工	62,072,271.30	2.89
108	600282	南钢股份	61,668,986.00	2.87
109	688099	晶晨股份	61,216,747.61	2.85
110	000750	国海证券	60,273,932.72	2.80
111	601231	环旭电子	60,240,772.58	2.80
112	600267	海正药业	59,909,734.12	2.79
113	601118	海南橡胶	59,560,077.77	2.77
114	601966	玲珑轮胎	59,495,656.00	2.77
115	600928	西安银行	59,461,919.28	2.77
116	600909	华安证券	58,334,426.30	2.71
117	002500	山西证券	58,193,732.63	2.71
118	300024	机器人	58,135,615.80	2.70
119	600517	国网英大	58,119,277.40	2.70
120	300115	长盈精密	57,917,353.81	2.69
121	601990	南京证券	57,655,461.00	2.68

122	600598	北大荒	57,172,058.99	2.66
123	601611	中国核建	56,665,606.00	2.63
124	002195	岩山科技	56,383,668.71	2.62
125	600155	华创云信	56,270,595.00	2.62
126	600673	东阳光	55,970,665.75	2.60
127	002312	川发龙蟒	55,004,016.00	2.56
128	300570	太辰光	54,818,754.16	2.55
129	300113	顺网科技	54,397,402.96	2.53
130	688361	中科飞测	54,350,943.27	2.53
131	600637	东方明珠	53,902,093.19	2.51
132	000933	神火股份	53,749,537.00	2.50
133	301308	江波龙	53,700,920.00	2.50
134	601958	金铂股份	53,395,535.23	2.48
135	300003	乐普医疗	53,262,566.98	2.48
136	601918	新集能源	53,003,811.58	2.46
137	600021	上海电力	53,000,512.00	2.46
138	603160	汇顶科技	52,960,756.84	2.46
139	688608	恒玄科技	52,927,449.66	2.46
140	000987	越秀资本	52,852,961.06	2.46
141	002532	天山铝业	52,818,801.57	2.46
142	000887	中鼎股份	52,750,456.00	2.45
143	000582	北部湾港	52,697,567.80	2.45
144	300567	精测电子	52,520,121.00	2.44
145	600739	辽宁成大	52,443,339.88	2.44
146	002673	西部证券	52,065,362.88	2.42
147	688629	华丰科技	51,588,042.94	2.40
148	002155	湖南黄金	51,462,719.10	2.39
149	000060	中金岭南	51,429,599.15	2.39
150	600498	烽火通信	51,370,982.00	2.39
151	600060	海信视像	51,337,976.00	2.39
152	688385	复旦微电	51,226,150.90	2.38
153	301536	星辰科技	51,202,384.03	2.38
154	688018	乐鑫科技	51,158,261.56	2.38
155	002185	华天科技	50,930,838.77	2.37
156	002607	中公教育	50,699,646.00	2.36
157	600299	安迪苏	50,616,655.76	2.35
158	601858	中国科传	50,596,580.40	2.35
159	688280	精进电动	50,464,055.27	2.35
160	688591	泰凌微	50,436,729.13	2.35
161	300054	鼎龙股份	49,253,709.00	2.29
162	688176	亚虹医药	49,102,475.30	2.28
163	601665	齐鲁银行	48,863,751.00	2.27
164	300395	菲利华	48,841,213.25	2.27

165	600968	海油发展	48,276,765.00	2.24
166	002156	通富微电	48,145,208.45	2.24
167	000539	粤电力 A	47,758,641.24	2.22
168	300136	信维通信	47,738,232.00	2.22
169	002409	雅克科技	47,654,033.00	2.22
170	688538	和辉光电	47,508,567.86	2.21
171	601212	白银有色	47,251,926.76	2.20
172	000967	盈峰环境	46,291,784.08	2.15
173	600298	安琪酵母	46,037,885.00	2.14
174	601696	中银证券	45,746,049.50	2.13
175	688192	迪哲医药	45,531,128.23	2.12
176	000729	燕京啤酒	45,337,854.00	2.11
177	003022	联泓新科	45,284,673.42	2.11
178	600583	海油工程	45,108,783.00	2.10
179	600884	杉杉股份	44,824,551.00	2.08
180	300676	华大基因	44,715,518.43	2.08
181	002138	顺络电子	44,706,138.57	2.08
182	002261	拓维信息	44,591,670.00	2.07
183	002507	涪陵榨菜	44,254,293.70	2.06
184	600873	梅花生物	43,708,215.25	2.03
185	601099	太平洋	43,646,589.35	2.03
186	600007	中国国贸	43,429,635.50	2.02
187	600166	福田汽车	43,390,342.00	2.02
188	000032	深桑达 A	43,289,505.00	2.01

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	26,607,171,334.15
卖出股票收入（成交）总额	26,082,666,664.03

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,855,988.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,933,568.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,789,557.63

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	595,815	2,838.88	595,333,623.81	35.20%	1,096,115,611.04	64.80%

500 指数增强 A						
国泰海通中证 500 指数增强 C	409,045	2,494.79	475,953,471.73	46.64%	544,528,828.77	53.36%
国泰海通中证 500 指数增强 Y	124	6,153.14	0.00	0.00%	762,988.81	100.00%
合计	1,004,984	2,699.24	1,071,287,095.54	39.49%	1,641,407,428.62	60.51%

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 500 指数增强 A	3,037,533.80	0.1796%
	国泰海通中证 500 指数增强 C	1,284,578.93	0.1259%
	国泰海通中证 500 指数增强 Y	26,707.99	3.5004%
	合计	4,348,820.72	0.1603%

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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	国泰海通中证 500 指数增强 A	>100
	国泰海通中证 500 指数增强 C	50~100
	国泰海通中证	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	500 指数增强 Y	
	合计	>100
	国泰海通中证 500 指数增强 A	>100
	国泰海通中证 500 指数增强 C	50~100
	国泰海通中证 500 指数增强 Y	0
合计	>100	

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 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）基金份额总额	720,641,928.72	440,062,218.02	-
本报告期期初基金份额总额	1,512,370,458.39	698,650,931.92	-
本报告期基金总申购份额	1,710,722,651.25	1,857,217,931.02	983,462.63
减：本报告期基金总赎回份额	1,531,643,874.79	1,535,386,562.44	220,473.82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,691,449,234.85	1,020,482,300.50	762,988.81

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。

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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、基金财产的诉讼。报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

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 48,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为 2024 年 11 月 5 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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

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	
国泰海通证券股份有限公司	2	52,687,200,367.41	100.00%	3,758,737.53	100.00%	-

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	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 费率优惠活动的公告	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	2025-01-02
2	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-01-22
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金在直销柜台开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-02-19
5	关于调整旗下部分开放式基金在部分销售机构最低申购金额、最低追加申购金额、最低	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	2025-02-27

	赎回份额和最低持有限额的公告		
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-03-31
8	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
9	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-04-22
11	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	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	2025-04-26
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁财富开通基金转换业务的公告	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	2025-04-30
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	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	2025-04-30
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	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	2025-06-11
15	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-07-21
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 2 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-07-21
17	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-07-24
18	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-07-24
19	国泰君安中证 500 指数增强型	证监会指定网站、公司官网	2025-07-24

	证券投资基金（Y 类份额）基金产品资料概要更新		
20	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-07-24
21	国泰君安中证 500 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	2025-07-24
22	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-07-24
23	关于国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	上海证券报、中国证监会指定网站、公司官网	2025-07-24
24	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告	证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-07-25
25	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-07-26
26	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
27	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
28	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（Y 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
29	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 2 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
30	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司管理人官网地址变更的公告	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	2025-08-09
31	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于吸收合并事项通知债权人的公告	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	2025-08-27
32	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-08-29
33	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2025-08-29
34	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海证券报、中国证券报、证	2025-09-05

	限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	
35	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	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	2025-09-26
36	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
37	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
38	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金（Y 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
39	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 3 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
40	国泰海通中证 500 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	2025-09-29
41	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
42	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	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	2025-10-14
43	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-10-28
44	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 3 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-10-28
45	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	中国证券报、上海证券报、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
46	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

上海国泰海通证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”）于 2025 年 7 月 25 日办理完成工商变更登记，公司法定名称由“上海国泰君安证券资产管理有限公司”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司”。根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，本公司已于 2025 年 7 月 25 日公告更名事宜。经与各基金托管人协商一致，并履行适当程序，本公司旗下的公开募集证券投资基金自 2025 年 9 月 29 日起变更基金名称（各基金的基金代码保持不变），具体情况详见管理人于 2025 年 9 月 26 日发布的《上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》。

§ 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君安中证 500 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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通中证 500 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。

二〇二六年三月三十一日