

国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示.....1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介6

2.1 基金基本情况6

2.2 基金产品说明6

2.3 基金管理人和基金托管人.....7

2.4 信息披露方式7

2.5 其他相关资料7

§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....7

3.1 主要会计数据和财务指标.....7

3.2 基金净值表现8

§ 4 管理人报告.....10

4.1 基金管理人及基金经理情况10

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明11

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明12

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望13

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....13

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明14

§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55

§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 A500 指数增强	
基金主代码	022467	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 17 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 208, 598, 485. 31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 A500 指数增强 A	国泰君安中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022467	022468
报告期末下属分级基金的份 额总额	632, 151, 296. 80 份	576, 447, 188. 51 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。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 本基金的投资策略主要包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回

	报，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	---------------------

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	张姗
	联系电话	021-38676022	400-61-95555
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95521	400-61-95555
传真		021-38871190	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200011	518040
法定代表人		陶耿	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gthtzg.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日）	
	国泰君安中证 A500 指数增强 A	国泰君安中证 A500 指数增强 C

本期已实现收益	21,155,640.84	17,569,664.75
本期利润	39,165,900.38	37,453,451.93
加权平均基金份额本期利润	0.0521	0.0498
本期加权平均净值利润率	5.18%	4.96%
本期基金份额净值增长率	4.87%	4.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	18,107,496.02	15,251,418.40
期末可供分配基金份额利润	0.0286	0.0265
期末基金资产净值	658,535,763.05	599,219,522.85
期末基金份额净值	1.0417	1.0395
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	4.17%	3.95%

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

国泰君安中证 A500 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
过去一个月	3.63%	0.61%	2.68%	0.57%	0.95%	0.04%
过去三个月	2.31%	1.25%	0.83%	1.14%	1.48%	0.11%
过去六个月	4.87%	1.09%	0.49%	1.05%	4.38%	0.04%
自基金合同生 效起至今	4.17%	1.05%	0.32%	1.02%	3.85%	0.03%

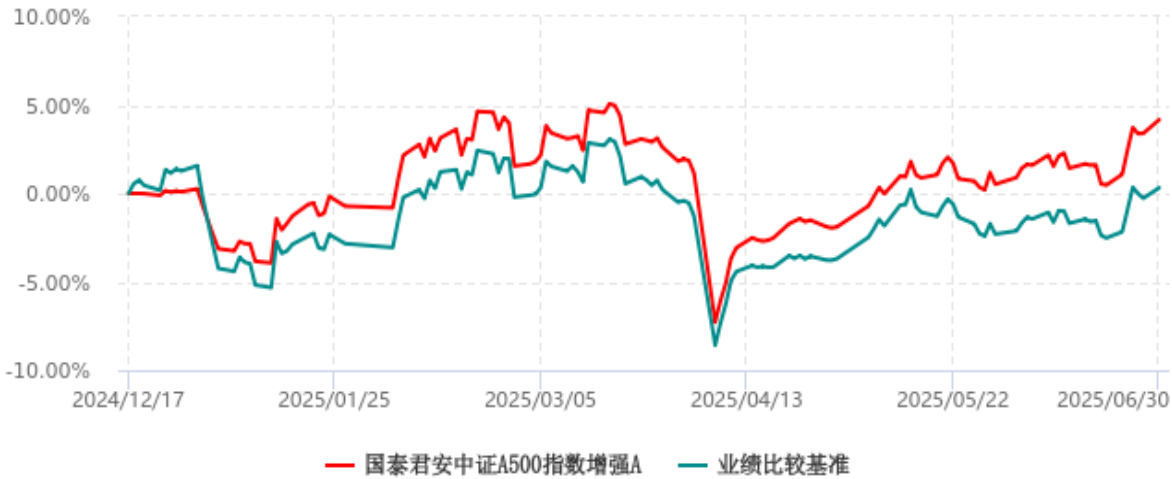
国泰君安中证 A500 指数增强 C 净值表现

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
过去一个月	3.60%	0.61%	2.68%	0.57%	0.92%	0.04%
过去三个月	2.21%	1.25%	0.83%	1.14%	1.38%	0.11%
过去六个月	4.67%	1.09%	0.49%	1.05%	4.18%	0.04%
自基金合同生	3.95%	1.05%	0.32%	1.02%	3.63%	0.03%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

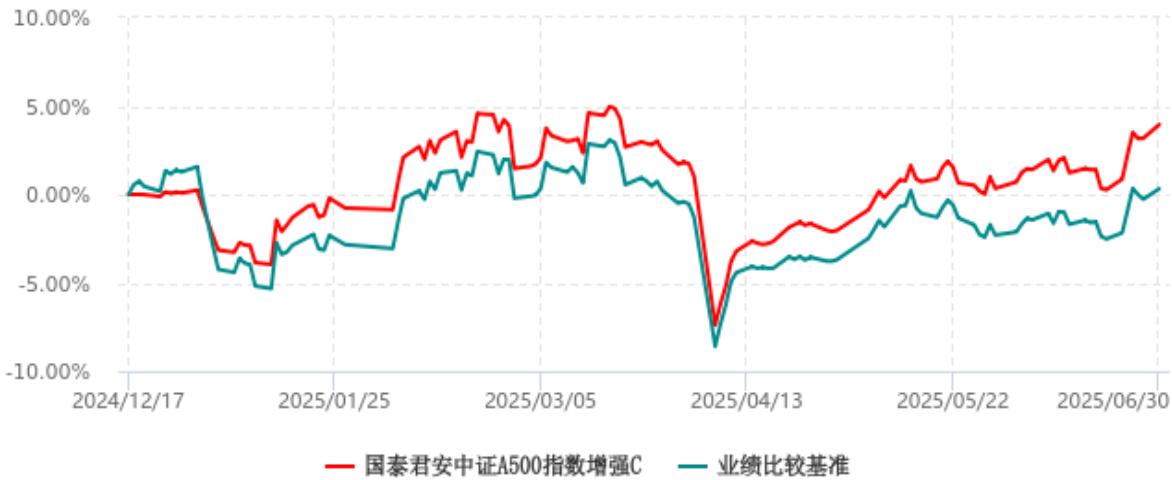
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰君安中证A500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
(2024年12月17日-2025年06月30日)



注：1、本基金于 2024 年 12 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰君安中证A500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
(2024年12月17日-2025年06月30日)



注：1、本基金于 2024 年 12 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 61 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	国泰君安中证 500 指数增强基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强基金经理，国泰君安量化选股混合发起基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰君安稳债	2024-12-17	-	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

	增利债券发起基金经理，国泰君安科创板量化选股股票发起基金经理，国泰君安红利量化选股混合基金经理，国泰君安中证 A500 指数增强基金经理，国泰君安上证科创板综合价格指数增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				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。
--	---	--	--	--	--

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 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

在市场方面，2025 年上半年 A 股市场呈现“政策驱动、情绪修复”主导的结构性行情。春节前市场情绪相对低迷，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。节后受 DeepSeek-v3、R1 发布影响，叠加春晚催化人形机器人主题投资热潮，及“春季躁动”行情，科技板块领涨，推动市场情绪快速修复，并带动 H 股科技板块的资产重估，形成了 A、H 股联动上涨的格局。短期的科创过热致使 3 月后获利盘持续了结，市场再次下跌，进入缩量轮动阶段。4 月初，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，人民日报发文强调增强应对关税冲击信心，中央汇金通过 ETF 市场维稳，叠加 4 月 18 日国务院常务会释放稳定股市信号，市场情绪逐步修复，指数开启估值驱动的快速反弹。进入 5 月，中美经贸高层会谈取得实质性进展，双方发布《日内瓦经贸会谈联合声明》暂停部分关税，叠加央行推出十项货币政策措施，市场风险偏好显著提升，上证综指单月上涨 2.09%。6 月 13 日，中东冲突引发全球资本市场普遍回调，投资者避险情绪提升，但随后中东协议停火，叠加制造业 PMI 回升及消费刺激政策等多重利好推动下，上证综指迎来快速修复，6 月末站上 3400 点创年内新高，上半年累计上涨 2.76%。上半年，科创 100 指数（涨幅 13.54%）、中证 1000 指数（涨幅 6.69%）表现较好，而中证红利指数表现较弱（跌幅 3.07%）。中证 A500 指数作为核心资产，表现中规中矩，期间上涨 0.47%。

从主要风险因子的走势来看，成长因子上半年表现强势。市值因子自年初以来持续走弱，但在 3 月底 4 月初出现小幅走高，随后持续走弱。从行业来看，各行业涨跌幅分化较大。有色金属是 2024 年四季度跌幅居前的行业，2025 年上半年在大宗商品、贵金属价格上涨的推动下重新走强。国防军工和银行板块上半年涨幅均超 10%；军工板块受政策、事件以及景气上行等因素影响表现强势，银行在政策呵护息差、高稳定属性的加持下取得了较好的涨幅。相较而言，受关税冲击或需求疲软影响，食品饮料板块在上半年则表现疲软；煤炭板块则因煤炭价格不断下跌，上半年跌幅达 12%。Alpha 表现方面，2025 上半年价量因子表现强势，整体上价量因子的表现优于基本面因子。过去一段时间内，受“对等关税”等政治事件影响，市场风险偏好急剧变化，维持超额收益稳定性的难度大幅提升，在短期内出现了较大波动。鉴于近期市场环境的复杂性，我们从中吸取经验，更加重视提升业绩稳定性，并根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

量化投资的逻辑自成体系，尽量不要受市场“宏大叙事”的影响，从投资理念和投资逻辑来讲保持自洽和一致。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本基金中，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，通过机器学习模型有针对性地有效选择因子，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，力求以较为稳定的方式增强中证 A500 指数。

另外一方面，由于本基金采用的基本面量化信号和实时量价信号在逻辑和数值层面均有较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha，更有效发挥两者的协同和共振效应，并根据市场的流动性和波动率进行及时优化。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 A500 指数作为 A 股新生代核心资产的代表，当前依然处于历史低估阶段，作为不同细分领域的“尖子生”在复杂的经济环境下体现出了较强的盈利能力，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

截至报告期末国泰君安中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.0417 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.87%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%；截至报告期末国泰君安中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.0395 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.67%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济正从“政策驱动”向“内生增长”过渡，中小盘企业盈利修复弹性逐步显现，全球供应链重构背景下，具备技术壁垒的细分领域“隐形冠军”将受益于进口替代与出口结构优化，为中证 A500 指数成分股提供业绩支撑；中证 A500 指数上半年上涨 0.47%，表现相对落后，但是也为其后续的行情留下了充足的上升空间，其覆盖的新生代核心资产兼具成长与估值优势，下半年流动性宽松格局延续，各个细分行业的龙头企业有望率先受益，指数估值修复空间大于回调压力，作为 A 股核心资产的代表中证 A500 长期配置价值显著；行业方面，专精特新“小巨人”集中的高端装备、新材料等领域受产业政策倾斜与技术突破驱动，景气度持续上行，有色金属板块在大宗商品价格回暖背景下业绩改善逻辑清晰，但也需同时需警惕部分过度依赖海外市场的行业受关税政策的阶段性冲击。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	119,055,839.32	982,607,367.30

结算备付金		8,138,420.76	-
存出保证金		2,519,085.60	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,166,546,907.51	1,029,567,842.06
其中：股票投资		1,166,546,907.51	1,029,567,842.06
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,584,296.85	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,298,844,550.04	2,012,175,209.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		39,721,156.71	-
应付管理人报酬		872,684.08	619,980.90
应付托管费		163,628.26	116,246.45
应付销售服务费		211,502.61	168,911.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	120,292.48	25,921.10
负债合计		41,089,264.14	931,060.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,208,598,485.31	2,025,021,789.27
未分配利润	6.4.7.8	49,156,800.59	-13,777,640.17
净资产合计		1,257,755,285.90	2,011,244,149.10
负债和净资产总计		1,298,844,550.04	2,012,175,209.36

注 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,208,598,485.31 份。其中国泰君安中证 A500 指数增强 A 基金份额净值 1.0417 元，基金份额总额 632,151,296.80 份；国泰君安中证 A500 指数增强 C 基金份额净值 1.0395 元，基金份额总额 576,447,188.51 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		85,473,825.87
1. 利息收入		301,339.62

其中：存款利息收入	6.4.7.9	291,846.10
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		9,493.52
2. 投资收益（损失以“-”填列）		46,931,602.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	29,897,878.08
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	6.4.7.11	3,137,123.58
股利收益	6.4.7.12	13,896,601.18
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	37,894,046.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	346,836.69
减：二、营业总支出		8,854,473.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,073,304.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,138,744.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,521,698.93
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		16,908.70

8. 其他费用	6.4.7.15	103,817.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76,619,352.31
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		76,619,352.31
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		76,619,352.31

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,025,021,789.27	-13,777,640.17	2,011,244,149.10
二、本期期初净资产	2,025,021,789.27	-13,777,640.17	2,011,244,149.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-816,423,303.96	62,934,440.76	-753,488,863.20
（一）、综合收益总额	-	76,619,352.31	76,619,352.31
（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）	-816,423,303.96	-13,684,911.55	-830,108,215.51
其中：1. 基金申购款	1,123,509,577.60	18,164,420.09	1,141,673,997.69
2. 基金赎回款	-1,939,932,881.56	-31,849,331.64	-1,971,782,213.20
（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	1,208,598,485.31	49,156,800.59	1,257,755,285.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024] 1451 号《关于准予国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由上海国泰海通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,024,218,290.02 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2400600 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 12 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,025,021,789.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 803,499.25 份基金份额。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》，本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（包括存托凭证、下同）、备选成份股（包括存托凭证、下同）、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证（包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等）、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 A500 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 \times 95% + 同期银行活期存款利率（税后） \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和

《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况、2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46

号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	56,689,911.17
等于：本金	56,685,423.37
加：应计利息	4,487.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	62,365,928.15
等于：本金	62,364,315.25
加：应计利息	1,612.90
减：坏账准备	-
合计	119,055,839.32

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,142,436,664.37	-	1,166,546,907.51	24,110,243.14
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		1,142,436,664.37	-	1,166,546,907.51	24,110,243.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 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 06 月 30 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	20,679,234.07	-	-	-
—股指期货	20,679,234.07	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,679,234.07	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IC2507	IC2507	3	3,520,440.00	24,384.00
IC2512	IC2512	2	2,262,240.00	152,657.78
IF2507	IF2507	11	12,895,740.00	20,109.15
IF2512	IF2512	2	2,313,960.00	115,995.00
合计				313,145.93
减：可抵销期货暂收款				313,145.93
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	77,369.04
预提审计费	24,795.19
其他应付	18,127.80
合计	120,292.48

6.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 A500 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 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	921,564,737.07	921,564,737.07
本期申购	385,036,441.27	385,036,441.27
本期赎回（以“-”号填列）	-674,449,881.54	-674,449,881.54
本期末	632,151,296.80	632,151,296.80

国泰君安中证 A500 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 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,103,457,052.20	1,103,457,052.20
本期申购	738,473,136.33	738,473,136.33
本期赎回（以“-”号填列）	-1,265,483,000.02	-1,265,483,000.02
本期末	576,447,188.51	576,447,188.51

6.4.7.8 未分配利润

国泰君安中证 A500 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	-62,832.13	-6,130,867.46	-6,193,699.59
本期期初	-62,832.13	-6,130,867.46	-6,193,699.59
本期利润	21,155,640.84	18,010,259.54	39,165,900.38
本期基金份额交易产生的变动数	-2,985,312.69	-3,602,421.85	-6,587,734.54
其中：基金申购款	7,563,079.85	-1,712,378.28	5,850,701.57
基金赎回款	-10,548,392.54	-1,890,043.57	-12,438,436.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,107,496.02	8,276,970.23	26,384,466.25

国泰君安中证 A500 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	-244,150.39	-7,339,790.19	-7,583,940.58
本期期初	-244,150.39	-7,339,790.19	-7,583,940.58
本期利润	17,569,664.75	19,883,787.18	37,453,451.93
本期基金份额交易产生的变动数	-2,074,095.96	-5,023,081.05	-7,097,177.01
其中：基金申购款	17,503,007.94	-5,189,289.42	12,313,718.52
基金赎回款	-19,577,103.90	166,208.37	-19,410,895.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,251,418.40	7,520,915.94	22,772,334.34

6.4.7.9 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 06 月 30 日
活期存款利息收入	182,555.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	42,959.73
结算备付金利息收入	66,330.93
其他	-
合计	291,846.10

6.4.7.10 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 06 月 30 日
卖出股票成交总额	6,213,026,044.75
减：卖出股票成本总额	6,178,325,143.49
减：交易费用	4,803,023.18
买卖股票差价收入	29,897,878.08

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 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 06 月 30 日
股指期货投资收益	3,393,854.07
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	140,905.92
减：交易费用	115,824.57
合计	3,137,123.58

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,896,601.18
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	13,896,601.18

6.4.7.13 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 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	37,580,900.79
——股票投资	37,580,900.79
——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	313,145.93
——权证投资	-

——期货投资	313,145.93
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	37,894,046.72

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	346,821.66
转换费收入	15.03
合计	346,836.69

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	71,447.94
证券出借违约金	—
银行汇划费	7,573.89
合计	103,817.02

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
招商银行股份有限公司(以下简称 “招商银行”)	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	11,492,966,119.99	92.02%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 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 06 月 30 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	819,419.95	91.49%	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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,073,304.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,600,177.94
应支付基金管理人的净管理费	3,473,126.36

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：
 $H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,138,744.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
 $H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 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 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 A500 指数增强 A	国泰君安中证 A500 指数增强 C	合计
国泰海通证券	-	244,440.50	244,440.50
国泰海通资管直销	-	61,980.81	61,980.81
招商银行	-	696,101.76	696,101.76
合计	-	1,002,523.07	1,002,523.07

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

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安中证 A500 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	8,002,733.33
报告期间申购/买入总份额	—
报告期间因拆分变动份额	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	8,002,733.33
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.27%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	56,689,911.17	182,555.44
国泰海通证券	41,491,470.65	33,842.99

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人招商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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301678	新恒汇	2025 年 06 月 13 日	6 个月	创业板打新限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	5 个交易日	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	6 个月	深交所打新限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
688757	胜科纳米	2025 年 03 月 18 日	6 个月	科创板打新限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
301662	宏工科技	2025 年 04 月 10 日	6 个月	创业板打新限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-

		日		售						
301590	优优绿能	2025年05月28日	6个月	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301665	泰禾股份	2025年04月02日	6个月	创业板打新限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
603014	威高血净	2025年05月12日	6个月	股票流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025年04月30日	6个月	创业板打新限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025年05月12日	6个月	创业板打新限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025年04月17日	6个月	创业板打新限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025年04月01日	6个月	股票流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603124	江南新材	2025年03月12日	6个月	股票流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
001390	古麒绒材	2025年05月21日	6个月	股票流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603400	华之杰	2025年06月12日	6个月	股票流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025年06月05日	6个月	股票流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

		日								
603120	肯特催化	2025 年 04 月 09 日	6 个月	股票流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

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，锁定期限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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，其他银行存款为光大证券股份有限公司保证金、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 6 月 30 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)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见

附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	119,055,839.32	-	-	-	119,055,839.32
结算备付金	8,138,420.76	-	-	-	8,138,420.76
存出保证金	2,519,085.60	-	-	-	2,519,085.60
交易性金融	-	-	-	1,166,546,907.5	1,166,546,907.5

资产				1	1
应收申购款	-	-	-	2,584,296.85	2,584,296.85
资产总计	129,713,345.68	-	-	1,169,131,204.36	1,298,844,550.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,721,156.71	39,721,156.71
应付管理人报酬	-	-	-	872,684.08	872,684.08
应付托管费	-	-	-	163,628.26	163,628.26
应付销售服务费	-	-	-	211,502.61	211,502.61
其他负债	-	-	-	120,292.48	120,292.48
负债总计	-	-	-	41,089,264.14	41,089,264.14
利率敏感度缺口	129,713,345.68	-	-	1,128,041,940.22	1,257,755,285.90
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	982,607,367.30	-	-	-	982,607,367.30
交易性金融资产	-	-	-	1,029,567,842.06	1,029,567,842.06
资产总计	982,607,367.30	-	-	1,029,567,842.06	2,012,175,209.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	619,980.90	619,980.90
应付托管费	-	-	-	116,246.45	116,246.45
应付销售服务费	-	-	-	168,911.81	168,911.81
其他负债	-	-	-	25,921.10	25,921.10
负债总计	-	-	-	931,060.26	931,060.26
利率敏感度缺口	982,607,367.30	-	-	1,028,636,781.80	2,011,244,149.10

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 06 月 30 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)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 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	1,166,546,907.51	92.75	1,029,567,842.06	51.19
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	1,166,546,907.51	92.75	1,029,567,842.06	51.19

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,166,427,345.49	1,029,531,020.06
第二层次	15,385.54	36,822.00
第三层次	104,176.48	-
合计	1,166,546,907.51	1,029,567,842.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,166,546,907.51	89.81
	其中：股票	1,166,546,907.51	89.81
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	127,194,260.08	9.79
8	其他各项资产	5,103,382.45	0.39
9	合计	1,298,844,550.04	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,486,830.00	0.28
B	采矿业	45,537,361.96	3.62
C	制造业	589,326,671.70	46.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,677,154.40	3.08
E	建筑业	31,906,320.00	2.54
F	批发和零售业	12,185,808.00	0.97

G	交通运输、仓储和邮政业	37,799,076.40	3.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,548,266.20	4.34
J	金融业	125,048,333.43	9.94
K	房地产业	1,296,540.00	0.10
L	租赁和商务服务业	7,333,130.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	9,257,105.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	630,240.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,559,192.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	958,592,029.09	76.21

7.2.2 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	4,670,060.00	0.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	138,813,901.42	11.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,094,793.50	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,533,135.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,455,750.24	2.02
J	金融业	28,508,376.20	2.27
K	房地产业	1,090,865.00	0.09
L	租赁和商务服务业	590,247.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	3,518,364.06	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	162,690.00	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	1,516,696.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	207,954,878.42	16.53

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	138,500	34,932,470.00	2.78
2	600519	贵州茅台	23,100	32,559,912.00	2.59
3	601398	工商银行	2,736,713	20,771,651.67	1.65
4	601318	中国平安	339,900	18,857,652.00	1.50
5	601899	紫金矿业	841,000	16,399,500.00	1.30
6	601857	中国石油	1,826,000	15,612,300.00	1.24
7	600030	中信证券	545,375	15,063,257.50	1.20
8	688981	中芯国际	168,376	14,845,711.92	1.18
9	000333	美的集团	204,100	14,736,020.00	1.17
10	000001	平安银行	1,140,200	13,762,214.00	1.09
11	601166	兴业银行	588,290	13,730,688.60	1.09
12	600690	海尔智家	518,800	12,855,864.00	1.02
13	600887	伊利股份	454,200	12,663,096.00	1.01
14	300124	汇川技术	190,300	12,287,671.00	0.98
15	601766	中国中车	1,662,000	11,700,480.00	0.93
16	002414	高德红外	1,139,350	11,678,337.50	0.93
17	000063	中兴通讯	356,800	11,592,432.00	0.92

				0	
18	600893	航发动力	299,600	11,546,584.00	0.92
19	601989	中国重工	2,447,600	11,356,864.00	0.90
20	600460	士兰微	453,300	11,250,906.00	0.89
21	002603	以岭药业	790,700	11,148,870.00	0.89
22	601600	中国铝业	1,561,300	10,991,552.00	0.87
23	601186	中国铁建	1,317,000	10,549,170.00	0.84
24	601658	邮储银行	1,884,800	10,309,856.00	0.82
25	002407	多氟多	831,260	10,133,059.40	0.81
26	688008	澜起科技	120,706	9,897,892.00	0.79
27	300558	贝达药业	167,000	9,677,650.00	0.77
28	000878	云南铜业	759,900	9,665,928.00	0.77
29	000651	格力电器	213,700	9,599,404.00	0.76
30	601985	中国核电	1,027,602	9,577,250.64	0.76
31	600018	上港集团	1,652,700	9,436,917.00	0.75
32	601669	中国电建	1,926,100	9,380,107.00	0.75
33	603259	药明康德	133,100	9,257,105.00	0.74
34	600004	白云机场	1,015,394	9,240,085.40	0.73
35	600019	宝钢股份	1,365,100	8,996,009.00	0.72
36	600011	华能国际	1,245,684	8,894,183.76	0.71
37	600660	福耀玻璃	155,600	8,870,756.00	0.71
38	300502	新易盛	68,760	8,733,895.20	0.69
39	000009	中国宝安	976,500	8,671,320.00	0.69
40	600699	均胜电子	481,700	8,400,848.00	0.67
41	000858	五粮液	70,500	8,382,450.00	0.67
42	600196	复星医药	333,400	8,365,006.00	0.67
43	002625	光启技术	208,600	8,339,828.00	0.66
44	300017	网宿科技	777,400	8,333,728.00	0.66
45	600482	中国动力	358,200	8,263,674.00	0.66
46	300433	蓝思科技	367,500	8,195,250.00	0.65
47	300496	中科创达	143,000	8,182,460.00	0.65
48	601018	宁波港	2,201,000	8,055,660.00	0.64
49	002475	立讯精密	230,700	8,002,983.00	0.64
50	000725	京东方 A	1,977,600	7,890,624.00	0.63
51	300308	中际旭创	53,700	7,832,682.00	0.62

52	600900	长江电力	247,600	7,462,664.00	0.59
53	300088	长信科技	1,233,300	7,350,468.00	0.58
54	600352	浙江龙盛	721,700	7,332,472.00	0.58
55	300014	亿纬锂能	148,900	6,821,109.00	0.54
56	600521	华海药业	355,400	6,621,102.00	0.53
57	688256	寒武纪	10,859	6,531,688.50	0.52
58	003816	中国广核	1,760,700	6,408,948.00	0.51
59	601668	中国建筑	1,106,400	6,383,928.00	0.51
60	600795	国电电力	1,308,700	6,334,108.00	0.50
61	000301	东方盛虹	753,000	6,272,490.00	0.50
62	600362	江西铜业	258,700	6,061,341.00	0.48
63	002230	科大讯飞	123,900	5,932,332.00	0.47
64	600335	国机汽车	875,800	5,648,910.00	0.45
65	603288	海天味业	145,100	5,645,841.00	0.45
66	002624	完美世界	366,000	5,552,220.00	0.44
67	601628	中国人寿	124,500	5,128,155.00	0.41
68	603501	豪威集团	39,693	5,066,811.45	0.40
69	002131	利欧股份	1,415,800	4,955,300.00	0.39
70	600150	中国船舶	148,800	4,841,952.00	0.38
71	002916	深南电路	42,966	4,632,164.46	0.37
72	600166	福田汽车	1,706,200	4,623,802.00	0.37
73	000100	TCL 科技	1,064,900	4,611,017.00	0.37
74	600050	中国联通	859,100	4,587,594.00	0.36
75	600919	江苏银行	364,400	4,350,936.00	0.35
76	000977	浪潮信息	84,400	4,294,272.00	0.34
77	000738	航发控制	200,300	4,156,225.00	0.33
78	002415	海康威视	148,200	4,109,586.00	0.33
79	601390	中国中铁	732,300	4,108,203.00	0.33
80	300628	亿联网络	117,600	4,087,776.00	0.33
81	600584	长电科技	121,000	4,076,490.00	0.32
82	301236	软通动力	72,100	3,939,544.00	0.31
83	601328	交通银行	481,800	3,854,400.00	0.31
84	688180	君实生物	111,328	3,782,925.44	0.30
85	002594	比亚迪	11,370	3,773,816.70	0.30
86	600704	物产中大	709,800	3,740,646.00	0.30
87	601866	中远海发	1,512,600	3,736,122.00	0.30
88	600188	兖矿能源	305,930	3,723,168.10	0.30
89	600497	驰宏锌锗	684,000	3,618,360.00	0.29
90	601216	君正集团	639,900	3,532,248.00	0.28
91	002714	牧原股份	83,000	3,486,830.00	0.28
92	300059	东方财富	150,282	3,476,022.66	0.28
93	600418	江淮汽车	84,500	3,387,605.00	0.27
94	002340	格林美	525,800	3,338,830.00	0.27

95	600309	万华化学	61,200	3,320,712.00	0.26
96	688111	金山办公	11,082	3,103,514.10	0.25
97	688235	百济神州	13,108	3,062,553.12	0.24
98	600839	四川长虹	310,200	3,015,144.00	0.24
99	600118	中国卫星	95,900	2,739,863.00	0.22
100	601319	中国人保	300,100	2,613,871.00	0.21
101	600315	上海家化	122,900	2,589,503.00	0.21
102	688396	华润微	54,576	2,573,804.16	0.20
103	600031	三一重工	137,000	2,459,150.00	0.20
104	600276	恒瑞医药	47,300	2,454,870.00	0.20
105	600332	白云山	92,200	2,430,392.00	0.19
106	600111	北方稀土	96,400	2,400,360.00	0.19
107	601888	中国中免	39,000	2,377,830.00	0.19
108	000988	华工科技	50,200	2,359,902.00	0.19
109	601988	中国银行	404,800	2,274,976.00	0.18
110	300476	胜宏科技	16,900	2,271,022.00	0.18
111	002241	歌尔股份	97,100	2,264,372.00	0.18
112	600549	厦门钨业	108,166	2,262,832.72	0.18
113	601615	明阳智能	193,700	2,225,613.00	0.18
114	000568	泸州老窖	19,600	2,222,640.00	0.18
115	601919	中远海控	146,000	2,195,840.00	0.17
116	601088	中国神华	53,100	2,152,674.00	0.17
117	601727	上海电气	288,200	2,129,798.00	0.17
118	601567	三星医疗	92,900	2,082,818.00	0.17
119	600085	同仁堂	56,900	2,051,814.00	0.16
120	600160	巨化股份	71,400	2,047,752.00	0.16
121	601288	农业银行	348,100	2,046,828.00	0.16
122	600637	东方明珠	271,900	2,031,093.00	0.16
123	601021	春秋航空	36,400	2,025,660.00	0.16
124	301381	赛维时代	93,200	1,859,340.00	0.15
125	002281	光迅科技	37,300	1,839,636.00	0.15
126	600989	宝丰能源	113,100	1,825,434.00	0.15
127	600028	中国石化	320,100	1,805,364.00	0.14
128	002938	鹏鼎控股	54,400	1,742,432.00	0.14
129	600096	云天化	78,800	1,731,236.00	0.14
130	000818	航锦科技	76,900	1,730,250.00	0.14
131	002353	杰瑞股份	49,400	1,729,000.00	0.14
132	000426	兴业银锡	108,200	1,709,560.00	0.14
133	601872	招商轮船	271,700	1,700,842.00	0.14
134	002493	荣盛石化	203,200	1,682,496.00	0.13
135	000768	中航西飞	60,600	1,656,804.00	0.13
136	002273	水晶光电	82,100	1,639,537.00	0.13
137	000425	徐工机械	202,800	1,575,756.00	0.13

138	601877	正泰电器	69,400	1,573,298.00	0.13
139	601633	长城汽车	69,800	1,499,304.00	0.12
140	601117	中国化学	193,600	1,484,912.00	0.12
141	300274	阳光电源	21,700	1,470,609.00	0.12
142	688041	海光信息	10,300	1,455,287.00	0.12
143	300604	长川科技	30,600	1,374,246.00	0.11
144	600007	中国国贸	63,000	1,296,540.00	0.10
145	002532	天山铝业	154,800	1,286,388.00	0.10
146	300024	机器人	74,000	1,271,320.00	0.10
147	688266	泽璟制药	11,800	1,268,618.00	0.10
148	300339	润和软件	24,900	1,265,667.00	0.10
149	001965	招商公路	101,900	1,222,800.00	0.10
150	000630	铜陵有色	364,400	1,217,096.00	0.10
151	300054	鼎龙股份	42,300	1,213,164.00	0.10
152	000792	盐湖股份	70,800	1,209,264.00	0.10
153	601225	陕西煤业	62,400	1,200,576.00	0.10
154	300251	光线传媒	58,900	1,193,903.00	0.09
155	688608	恒玄科技	3,400	1,183,132.00	0.09
156	600938	中国海油	44,600	1,164,506.00	0.09
157	300699	光威复材	36,200	1,146,454.00	0.09
158	300573	兴齐眼药	21,640	1,120,735.60	0.09
159	600547	山东黄金	33,000	1,053,690.00	0.08
160	600143	金发科技	99,100	1,021,721.00	0.08
161	002202	金风科技	99,400	1,018,850.00	0.08
162	600745	闻泰科技	29,700	995,841.00	0.08
163	688188	柏楚电子	7,360	969,017.60	0.08
164	300394	天孚通信	11,900	950,096.00	0.08
165	300223	北京君正	13,600	941,120.00	0.07
166	601607	上海医药	52,400	936,912.00	0.07
167	601728	中国电信	115,200	892,800.00	0.07
168	600426	华鲁恒升	40,500	877,635.00	0.07
169	603000	人民网	43,000	869,030.00	0.07
170	002558	巨人网络	33,900	798,345.00	0.06
171	601233	桐昆股份	73,000	773,800.00	0.06
172	600219	南山铝业	198,000	758,340.00	0.06
173	600372	中航机载	61,000	735,660.00	0.06
174	300296	利亚德	117,200	714,920.00	0.06
175	600941	中国移动	6,200	697,810.00	0.06
176	688099	晶晨股份	9,100	646,191.00	0.05
177	300015	爱尔眼科	50,500	630,240.00	0.05
178	601179	中国西电	98,900	607,246.00	0.05
179	002371	北方华创	1,200	530,652.00	0.04
180	601689	拓普集团	9,800	463,050.00	0.04

181	601168	西部矿业	26,000	432,380.00	0.03
182	000960	锡业股份	27,500	420,750.00	0.03
183	002156	通富微电	16,100	412,482.00	0.03
184	688009	中国通号	79,000	406,060.00	0.03
185	300724	捷佳伟创	7,400	401,820.00	0.03
186	002138	顺络电子	13,900	390,868.00	0.03
187	002001	新和成	17,400	370,098.00	0.03
188	300760	迈瑞医疗	1,600	359,600.00	0.03
189	002245	蔚蓝锂芯	27,100	347,693.00	0.03
190	300763	锦浪科技	5,400	309,906.00	0.02
191	300395	菲利华	5,800	296,380.00	0.02
192	000625	长安汽车	23,200	296,032.00	0.02
193	603993	洛阳钼业	33,600	282,912.00	0.02
194	300037	新宙邦	7,900	278,080.00	0.02
195	688122	西部超导	5,300	274,964.00	0.02
196	002463	沪电股份	6,400	272,512.00	0.02
197	600089	特变电工	21,400	255,302.00	0.02
198	000623	吉林敖东	14,800	250,860.00	0.02
199	000938	紫光股份	10,000	239,900.00	0.02
200	002739	万达电影	20,100	229,743.00	0.02
201	300418	昆仑万维	6,400	215,232.00	0.02
202	002179	中航光电	5,100	205,836.00	0.02
203	002384	东山精密	5,400	203,958.00	0.02
204	002145	中核钛白	47,700	197,955.00	0.02
205	601816	京沪高铁	32,200	185,150.00	0.01
206	600141	兴发集团	8,100	166,293.00	0.01
207	300207	欣旺达	7,000	140,420.00	0.01
208	300033	同花顺	500	136,505.00	0.01
209	600499	科达制造	13,900	136,220.00	0.01
210	300182	捷成股份	24,600	135,546.00	0.01
211	600535	天士力	8,134	127,297.10	0.01
212	300529	健帆生物	4,900	105,693.00	0.01
213	600392	盛和资源	7,800	102,726.00	0.01
214	600176	中国巨石	7,000	79,800.00	0.01
215	688223	晶科能源	5,000	25,950.00	0.00
216	688012	中微公司	115	20,964.50	0.00
217	000423	东阿阿胶	20	1,046.00	0.00
218	002128	电投能源	37	731.86	0.00
219	688599	天合光能	31	450.43	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601818	光大银行	1,892,100	7,852,215.00	0.62
2	600703	三安光电	595,700	7,398,594.00	0.59
3	688280	精进电动	898,799	6,534,268.73	0.52
4	300102	乾照光电	441,700	5,110,469.00	0.41
5	601997	贵阳银行	755,000	4,711,200.00	0.37
6	600410	华胜天成	464,000	4,449,760.00	0.35
7	601138	工业富联	205,200	4,387,176.00	0.35
8	600016	民生银行	896,500	4,258,375.00	0.34
9	603687	大胜达	561,600	4,172,688.00	0.33
10	688512	慧智微	324,185	3,536,858.35	0.28
11	688343	云天励飞	70,171	3,467,850.82	0.28
12	600267	海正药业	368,800	3,411,400.00	0.27
13	000919	金陵药业	466,700	3,178,227.00	0.25
14	603858	步长制药	188,700	3,064,488.00	0.24
15	301256	华融化学	281,400	2,980,026.00	0.24
16	002174	游族网络	234,200	2,840,846.00	0.23
17	002151	北斗星通	94,000	2,696,860.00	0.21
18	000166	申万宏源	526,760	2,644,335.20	0.21
19	600619	海立股份	226,801	2,587,799.41	0.21
20	688220	翱捷科技	31,700	2,482,110.00	0.20
21	002661	克明食品	240,800	2,410,408.00	0.19
22	002772	众兴菌业	303,400	2,369,554.00	0.19
23	688334	西高院	132,613	2,278,291.34	0.18
24	301260	格力博	114,800	2,263,856.00	0.18
25	002079	苏州固锝	229,300	2,235,675.00	0.18
26	688079	美迪凯	212,900	2,137,516.00	0.17
27	300624	万兴科技	33,700	2,091,085.00	0.17
28	300830	金现代	227,500	2,077,075.00	0.17
29	000901	航天科技	165,700	2,059,651.00	0.16
30	002455	百川股份	275,300	2,059,244.00	0.16
31	601788	光大证券	113,300	2,037,134.00	0.16
32	688373	盟科药业	321,233	2,014,130.91	0.16
33	002786	银宝山新	211,200	1,947,264.00	0.15
34	300458	全志科技	46,960	1,863,842.40	0.15
35	002491	通鼎互联	321,000	1,823,280.00	0.14
36	000783	长江证券	260,500	1,805,265.00	0.14
37	301396	宏景科技	28,940	1,797,463.40	0.14
38	301221	光庭信息	33,800	1,756,586.00	0.14
39	002329	皇氏集团	494,900	1,742,048.00	0.14
40	300399	天利科技	46,600	1,705,560.00	0.14
41	000021	深科技	89,500	1,677,230.00	0.13

42	300257	开山股份	165,800	1,669,606.00	0.13
43	688458	美芯晟	33,261	1,568,588.76	0.12
44	688176	亚虹医药	175,407	1,555,860.09	0.12
45	300224	正海磁材	103,400	1,463,110.00	0.12
46	600557	康缘药业	95,200	1,407,056.00	0.11
47	002249	大洋电机	210,600	1,385,748.00	0.11
48	300489	光智科技	31,100	1,373,376.00	0.11
49	002228	合兴包装	380,640	1,343,659.20	0.11
50	301025	读客文化	119,800	1,317,800.00	0.10
51	300043	星辉娱乐	272,000	1,316,480.00	0.10
52	601939	建设银行	134,700	1,271,568.00	0.10
53	002881	美格智能	27,300	1,266,720.00	0.10
54	601009	南京银行	105,100	1,221,262.00	0.10
55	300424	航新科技	70,400	1,219,328.00	0.10
56	600909	华安证券	200,900	1,171,247.00	0.09
57	300735	光弘科技	46,200	1,159,620.00	0.09
58	688146	中船特气	39,800	1,150,618.00	0.09
59	688365	光云科技	74,228	1,129,750.16	0.09
60	688728	格科微	73,130	1,126,202.00	0.09
61	002004	华邦健康	269,700	1,124,649.00	0.09
62	002107	沃华医药	195,500	1,118,260.00	0.09
63	300967	晓鸣股份	60,100	1,111,850.00	0.09
64	688716	中研股份	30,769	1,095,376.40	0.09
65	601228	广州港	338,900	1,094,647.00	0.09
66	600736	苏州高新	203,900	1,090,865.00	0.09
67	301526	国际复材	295,000	1,073,800.00	0.09
68	603739	蔚蓝生物	76,300	1,016,316.00	0.08
69	300320	海达股份	102,200	1,015,868.00	0.08
70	300039	上海凯宝	167,100	1,012,626.00	0.08
71	300221	银禧科技	119,200	989,360.00	0.08
72	301281	科源制药	30,100	974,638.00	0.08
73	002669	康达新材	80,600	934,960.00	0.07
74	600875	东方电气	54,200	907,308.00	0.07
75	002349	精华制药	125,400	901,626.00	0.07
76	688660	电气风电	101,916	884,630.88	0.07
77	301017	漱玉平民	67,600	867,308.00	0.07
78	002885	京泉华	59,500	841,925.00	0.07
79	600354	敦煌种业	131,600	814,604.00	0.06
80	300026	红日药业	220,500	813,645.00	0.06
81	300009	安科生物	95,700	801,009.00	0.06
82	002258	利尔化学	70,100	773,904.00	0.06
83	301536	星宸科技	12,500	753,750.00	0.06
84	300539	横河精密	54,300	743,367.00	0.06

85	300570	太辰光	7,600	732,488.00	0.06
86	688443	智翔金泰	25,993	721,045.82	0.06
87	603048	浙江黎明	36,300	713,658.00	0.06
88	688222	成都先导	43,900	705,912.00	0.06
89	300289	利德曼	133,300	693,160.00	0.06
90	300978	东箭科技	61,900	690,804.00	0.05
91	301165	锐捷网络	11,200	688,352.00	0.05
92	601678	滨化股份	165,700	685,998.00	0.05
93	600812	华北制药	108,800	672,384.00	0.05
94	300739	明阳电路	43,300	642,572.00	0.05
95	600015	华夏银行	79,800	631,218.00	0.05
96	688275	万润新能	15,400	624,470.00	0.05
97	600628	新世界	81,700	598,044.00	0.05
98	300231	银信科技	48,100	592,111.00	0.05
99	603682	锦和商管	104,100	590,247.00	0.05
100	301110	青木科技	10,500	587,895.00	0.05
101	002728	特一药业	68,716	577,901.56	0.05
102	601698	中国卫通	27,400	560,878.00	0.04
103	300891	惠云钛业	57,705	555,122.10	0.04
104	300160	秀强股份	92,100	517,602.00	0.04
105	002722	物产金轮	32,000	514,880.00	0.04
106	300908	仲景食品	16,900	508,859.00	0.04
107	002913	奥士康	17,200	505,852.00	0.04
108	300828	锐新科技	28,800	476,064.00	0.04
109	301226	祥明智能	17,200	470,936.00	0.04
110	001219	青岛食品	34,500	469,890.00	0.04
111	600305	恒顺醋业	59,800	462,254.00	0.04
112	002725	跃岭股份	34,900	459,982.00	0.04
113	002825	纳尔股份	45,500	454,090.00	0.04
114	300882	万胜智能	24,800	444,912.00	0.04
115	300351	永贵电器	27,700	440,984.00	0.04
116	300939	秋田微	14,300	434,720.00	0.03
117	300825	阿尔特	39,100	422,671.00	0.03
118	300407	凯发电气	39,400	416,458.00	0.03
119	000990	诚志股份	52,100	393,876.00	0.03
120	300512	中亚股份	45,800	392,964.00	0.03
121	300563	神宇股份	9,500	385,320.00	0.03
122	300048	合康新能	65,200	382,724.00	0.03
123	688209	英集芯	20,559	379,724.73	0.03
124	300498	温氏股份	21,900	374,052.00	0.03
125	300456	赛微电子	21,700	373,023.00	0.03
126	600488	津药药业	86,800	361,956.00	0.03
127	000513	丽珠集团	9,900	356,796.00	0.03

128	002391	长青股份	60,500	354,530.00	0.03
129	300705	九典制药	22,700	353,439.00	0.03
130	688584	上海合晶	19,700	352,236.00	0.03
131	600268	国电南自	44,500	347,990.00	0.03
132	688380	中微半导	12,700	344,170.00	0.03
133	300420	五洋自控	98,600	339,184.00	0.03
134	688321	微芯生物	14,100	335,298.00	0.03
135	600717	天津港	72,500	330,600.00	0.03
136	601066	中信建投	13,400	322,270.00	0.03
137	688020	方邦股份	8,495	321,705.65	0.03
138	600742	富维股份	33,300	316,683.00	0.03
139	300206	理邦仪器	26,200	314,924.00	0.03
140	600056	中国医药	29,800	308,132.00	0.02
141	600218	全柴动力	34,300	307,671.00	0.02
142	002523	天桥起重	83,700	305,505.00	0.02
143	300562	乐心医疗	20,600	303,850.00	0.02
144	000869	张裕 A	14,200	301,466.00	0.02
145	688015	交控科技	13,982	291,384.88	0.02
146	300925	法本信息	11,500	289,570.00	0.02
147	601995	中金公司	7,900	279,344.00	0.02
148	002823	凯中精密	19,700	276,391.00	0.02
149	300510	金冠股份	60,300	276,174.00	0.02
150	300549	优德精密	14,800	270,692.00	0.02
151	300817	双飞集团	11,400	269,496.00	0.02
152	300508	维宏股份	9,300	264,027.00	0.02
153	688181	八亿时空	8,400	261,408.00	0.02
154	688221	前沿生物	25,700	258,028.00	0.02
155	300382	斯莱克	16,100	244,881.00	0.02
156	000936	华西股份	33,700	231,856.00	0.02
157	688183	生益电子	4,500	230,400.00	0.02
158	688469	芯联集成	47,500	226,575.00	0.02
159	002783	凯龙股份	25,800	222,654.00	0.02
160	300365	恒华科技	31,600	208,244.00	0.02
161	600216	浙江医药	13,600	201,144.00	0.02
162	300788	中信出版	6,200	198,896.00	0.02
163	301015	百洋医药	9,800	196,588.00	0.02
164	600819	耀皮玻璃	33,400	194,388.00	0.02
165	301270	汉仪股份	3,900	185,874.00	0.01
166	301216	万凯新材	14,700	183,309.00	0.01
167	002782	可立克	13,500	175,230.00	0.01
168	002403	爱仕达	12,300	172,446.00	0.01
169	301069	凯盛新材	10,100	162,711.00	0.01
170	300187	永清环保	31,900	162,690.00	0.01

171	688593	新相微	9,842	160,719.86	0.01
172	688347	华虹公司	2,800	153,748.00	0.01
173	002142	宁波银行	5,100	139,536.00	0.01
174	002787	华源控股	16,900	138,073.00	0.01
175	601901	方正证券	16,600	131,306.00	0.01
176	688602	康鹏科技	15,113	126,646.94	0.01
177	300222	科大智能	12,300	125,337.00	0.01
178	300184	力源信息	12,700	124,714.00	0.01
179	688158	优刻得	5,300	119,886.00	0.01
180	603189	网达软件	6,800	118,116.00	0.01
181	688468	科美诊断	14,800	108,928.00	0.01
182	600106	重庆路桥	17,600	107,888.00	0.01
183	688202	美迪西	2,716	97,585.88	0.01
184	688505	复旦张江	11,100	96,126.00	0.01
185	600299	安迪苏	7,100	68,515.00	0.01
186	601169	北京银行	4,700	32,101.00	0.00
187	300393	中来股份	4,100	23,616.00	0.00
188	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
189	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
190	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
191	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
192	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
193	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
194	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
195	688185	康希诺	108	6,440.04	0.00
196	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
197	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
198	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
199	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
200	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
201	688208	道通科技	128	3,916.80	0.00
202	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
203	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
204	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
205	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
206	688381	帝奥微	28	606.48	0.00
207	003025	思进智能	40	541.60	0.00
208	300802	矩子科技	20	376.80	0.00
209	688400	凌云光	3	82.71	0.00
210	603101	汇嘉时代	1	7.50	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	64,573,510.00	3.21
2	600276	恒瑞医药	55,728,159.60	2.77
3	600519	贵州茅台	55,285,538.80	2.75
4	688981	中芯国际	42,207,074.08	2.10
5	601398	工商银行	39,416,831.84	1.96
6	000001	平安银行	38,175,641.00	1.90
7	601018	宁波港	37,652,428.00	1.87
8	000858	五粮液	36,921,669.00	1.84
9	002625	光启技术	36,065,713.00	1.79
10	601727	上海电气	35,721,008.00	1.78
11	601318	中国平安	35,149,536.00	1.75
12	603986	兆易创新	33,265,940.00	1.65
13	601166	兴业银行	33,020,690.00	1.64
14	688008	澜起科技	32,867,772.22	1.63
15	002475	立讯精密	32,549,261.00	1.62
16	000333	美的集团	32,013,650.00	1.59
17	002594	比亚迪	31,721,480.70	1.58
18	601658	邮储银行	31,123,673.00	1.55
19	688041	海光信息	30,520,618.60	1.52
20	600460	士兰微	30,501,754.00	1.52

			0	
--	--	--	---	--

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	58,068,879.91	2.89
2	600519	贵州茅台	54,287,361.00	2.70
3	300750	宁德时代	52,693,591.89	2.62
4	603986	兆易创新	43,383,625.00	2.16
5	002594	比亚迪	42,398,049.00	2.11
6	000001	平安银行	39,962,951.16	1.99
7	601318	中国平安	37,707,833.00	1.87
8	000858	五粮液	36,621,996.00	1.82
9	688981	中芯国际	36,392,585.07	1.81
10	601727	上海电气	36,271,413.00	1.80
11	002475	立讯精密	35,112,647.10	1.75
12	603259	药明康德	33,772,171.00	1.68
13	000725	京东方 A	33,729,708.00	1.68
14	601018	宁波港	32,957,134.24	1.64
15	601328	交通银行	32,426,475.00	1.61
16	688041	海光信息	32,106,602.49	1.60
17	600900	长江电力	31,518,923.00	1.57
18	000333	美的集团	31,479,249.00	1.57

			0	
19	601988	中国银行	30,892,693.00	1.54
20	300339	润和软件	30,682,746.00	1.53

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。

7.4.3 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	6,277,723,308.15
卖出股票收入（成交）总额	6,213,026,044.75

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可参与股指期货交易。若本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、

有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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平安银行股份有限公司，2025 年 3 月因违法违规被国家金融监督管理总局地方监管局罚款、责令改正，其分支行 2024 年 7 月至 2025 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国工商银行股份有限公司，其分支行 2024 年 7 月至 2025 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信证券股份有限公司，及其分支行 2024 年 7 月至 2025 年 6 月多次因违规被证监会、深圳证券交易所、上海证券交易所、北京证券交易所罚款、警示等。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2, 519, 085. 60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2, 584, 296. 85
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,103,382.45

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
国泰君 安中证 A500 指 数增强 A	5,323	118,758.46	281,528,757.83	44.54%	350,622,538.97	55.46%
国泰君 安中证 A500 指 数增强 C	11,053	52,153.01	54,743,917.28	9.50%	521,703,271.23	90.50%
合计	16,376	73,803.03	336,272,675.11	27.82%	872,325,810.20	72.18%

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）。

8.2 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	国泰君安中证 A500 指数增强 A	2,502,538.93	0.3959%
	国泰君安中证 A500 指数增强 C	561,022.55	0.0973%
	合计	3,063,561.48	0.2535%

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安中证 A500 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 A500 指数增强 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证 A500 指数增强 A	50~100
	国泰君安中证 A500 指数增强 C	0
	合计	50~100

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 A500 指数增强 A	国泰君安中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 12 月 17 日）基金份额总额	921,564,737.07	1,103,457,052.20
本报告期期初基金份额总额	921,564,737.07	1,103,457,052.20
本报告期基金总申购份额	385,036,441.27	738,473,136.33
减：本报告期基金总赎回份额	674,449,881.54	1,265,483,000.02
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	632,151,296.80	576,447,188.51

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

2、本报告期内本基金托管人专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券股份有限公司	2	11,492,966,119.99	92.02%	819,419.95	91.49%	-
光大证券股份有限公司	3	997,277,614.59	7.98%	76,220.14	8.51%	-

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-01-13
2	国泰君安中证 A500 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	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
6	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
7	国泰君安中证 A500 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
8	国泰君安中证 A500 指数增强	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22

	型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告		
9	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
10	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
11	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
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
14	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2025 年 7 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关于基金管理人法定名称、住所变更的公告》，其中公司中文名称由“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”，公司住所由“上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室”变更为“上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层”，生效日期为 2025 年 7 月 25 日。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》；

- 4、《国泰君安中证 A500 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。

12.2 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>。

12.3 查阅方式

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

上海国泰海通证券资产管理有限公司
二〇二五年八月二十九日