

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月22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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	59

§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件.....	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安沪深 300 指数增强发起	
基金主代码	018257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 04 月 19 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,647,691,366.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	018257	018258
报告期末下属分级基金的份额总额	890,370,689.42 份	757,320,676.82 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，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份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。如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金的投资策略包括股票投资策略、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、融资及转融通证券出借业务投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	朱萍
	联系电话	021-38676022	021-31888888
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		95521	95528
传真		021-38871190	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200011	200126
法定代表人		陶耿	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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）	
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
本期已实现收益	1,434,594.70	-4,321,995.00
本期利润	13,821,919.74	1,572,101.87
加权平均基金份额本期利润	0.0152	0.0015
本期加权平均净值利润率	1.46%	0.15%
本期基金份额净值增长率	1.44%	1.23%
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	60,286,880.15	44,334,328.05
期末可供分配基金份额利润	0.0677	0.0585
期末基金资产净值	952,064,098.92	802,698,229.54
期末基金份额净值	1.0693	1.0599
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	6.93%	5.99%

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

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	3.07%	0.54%	2.37%	0.55%	0.70%	-0.01%
过去三个月	1.73%	1.14%	1.21%	1.04%	0.52%	0.10%
过去六个月	1.44%	1.03%	0.07%	0.97%	1.37%	0.06%
过去一年	15.85%	1.33%	13.12%	1.32%	2.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.93%	1.09%	-4.97%	1.08%	11.90%	0.01%

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去一个月	3.02%	0.54%	2.37%	0.55%	0.65%	-0.01%
过去三个月	1.63%	1.14%	1.21%	1.04%	0.42%	0.10%
过去六个月	1.23%	1.03%	0.07%	0.97%	1.16%	0.06%
过去一年	15.38%	1.33%	13.12%	1.32%	2.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.99%	1.09%	-4.97%	1.08%	10.96%	0.01%

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

国泰君安沪深300指数增强发起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

(2023年04月19日-2025年06月30日)



国泰君安沪深300指数增强发起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

(2023年04月19日-2025年06月30日)



§ 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	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
胡崇海	<p>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，国泰君安稳健债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。</p>	2023-04-19	-	14 年	<p>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。</p>

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%。综合来看，沪深 300 指数作为大盘核心资产，对政策信号反应更敏感，4 月关税冲击下调整幅度大于中小盘指数，本报告期间整体表现一般（涨幅 0.03%），强于中证红利指数（跌幅 3.07%），弱于中证 1000 指数（涨幅 6.69%）和中证 500 指数（涨幅 3.31%）。

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，特别是“黑天鹅”事件对超额收益的稳定性带来较大的挑战。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。

从沪深 300 指数当前的估值水平来看，截至 6 月底其加权 PE 和整体 PE 在 13 倍和 13 倍左右，处于历史中位数水平，整体 PE 在历史上的分位数在 53%左右，而用整体 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 19%之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要小于向上的空间。未来随着经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为作为 A 股核心资产的典型代表，沪深 300 指数从长期来看依然有其特殊的配置价值。

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沪深 300 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。我们认为沪深 300 指数当前依然处于历史低估阶段，在复杂的经济环境下体现出了较为稳定的盈利能力，也是最注重股东回报的一类上市公司，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沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值为 1.0693 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%；截至报告期末国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值为 1.0599 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济将延续“稳中有进”态势，政策发力聚焦扩大内需与产业升级，消费修复与制造业回升形成共振，叠加央行结构性货币政策工具持续落地，经济复苏动能有望增强，全球层面中美共振降息预期下流动性环境整体宽松；在此背景下，沪深 300 指数作为 A 股大盘核心资产代表，当前估值处于历史中等偏下水平，安全边际较高，短期或受地缘政治扰动呈现震荡，但政策托底与盈利改善将推动估值修复，全年结构性机会大于系统性风险，指数有望实现“估值 + 盈利”双击；行业层面，金融、消费等权重板块在经济复苏周期中具备业绩韧性，其中银行板块受益于政策呵护息差与资产质量改善，科技板块中与“新质生产力”相关的高端制造领域将持续获得资金青睐，同时需关注大宗商品价格波动对周期板块的阶段性影响。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由上海国泰海通证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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	183,289,767.24	163,945,754.77
结算备付金		12,036,243.70	6,297,664.76
存出保证金		4,244,268.60	4,142,490.66
交易性金融资产	6.4.7.2	1,621,589,365.89	1,682,127,380.11
其中：股票投资		1,621,589,365.89	1,682,127,380.11
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		332,283.94	71,074,810.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,821,491,929.37	1,927,588,101.06
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		-	0.00
应付赎回款		64,469,387.86	109,866,988.21
应付管理人报酬		1,553,782.18	1,468,804.78
应付托管费		233,067.33	220,320.71
应付销售服务费		306,839.81	411,247.30
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	166,523.73	40,495.53
负债合计		66,729,600.91	112,007,856.53

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,647,691,366.24	1,729,604,528.22
未分配利润	6.4.7.8	107,070,962.22	85,975,716.31
净资产合计		1,754,762,328.46	1,815,580,244.53
负债和净资产总计		1,821,491,929.37	1,927,588,101.06

注 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,647,691,366.24 份。其中国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值 1.0693 元，基金份额总额 890,370,689.42 份；国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值 1.0599 元，基金份额总额 757,320,676.82 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		28,973,413.64	-2,794,087.24
1. 利息收入		223,300.45	38,828.62
其中：存款利息收入	6.4.7.9	172,462.37	38,828.62
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		50,838.08	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,786,190.25	11,420,109.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,810,031.59	4,256,215.39
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	-2,015,927.18	764,645.25
股利收益	6.4.7.12	21,612,149.02	6,399,248.52
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	18,281,421.91	-14,646,549.83
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	682,501.03	393,524.81
减：二、营业总支出		13,579,392.03	2,113,542.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,910,839.41	1,448,976.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,486,625.95	217,346.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,091,203.06	367,682.99
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		227.16	4,118.49
8. 其他费用	6.4.7.15	90,496.45	75,418.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,394,021.61	-4,907,630.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,394,021.61	-4,907,630.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,394,021.61	-4,907,630.00

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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	1,729,604,528.22	85,975,716.31	1,815,580,244.53
二、本期期初净资产	1,729,604,528.22	85,975,716.31	1,815,580,244.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-81,913,161.98	21,095,245.91	-60,817,916.07
（一）、综合收益总额	-	15,394,021.61	15,394,021.61
（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）	-81,913,161.98	5,701,224.30	-76,211,937.68
其中：1. 基金申购款	963,268,490.54	41,760,346.31	1,005,028,836.85
2. 基金赎回款	-	-36,059,122.01	-
（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	1,647,691,366.24	107,070,962.22	1,754,762,328.46
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	170,985,415.82	-20,098,514.84	150,886,900.98
二、本期期初净资产	170,985,415.82	-20,098,514.84	150,886,900.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	618,064,563.05	-43,154,318.95	574,910,244.10
（一）、综合收益总额	-	-4,907,630.00	-4,907,630.00
（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）	618,064,563.05	-38,246,688.95	579,817,874.10
其中：1. 基金申购款	741,254,520.41	-47,815,491.89	693,439,028.52
2. 基金赎回款	-123,189,957.36	9,568,802.94	-113,621,154.42
（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	789,049,978.87	-63,252,833.79	725,797,145.08

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

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(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[2023]568 号《关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,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《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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基金,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 15,019,999.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0237 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 15,019,999.00 份,无认购资金利息折合基金份额。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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 15,019,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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、下同)、备选成份券(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、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、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%,投资于沪深 300 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沪深 300 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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 中期财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 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等有关信息。

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

本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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	100,811,862.08
等于：本金	100,804,769.37
加：应计利息	7,092.71
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	82,477,905.16
等于：本金	82,476,045.83
加：应计利息	1,859.33
减：坏账准备	-
合计	183,289,767.24

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	1,586,254,094.53	-	1,621,589,365.89	35,335,271.36
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	1,586,254,094.53	-	1,621,589,365.89	35,335,271.36

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	34,828,678.18	-	-	-
--股指期货	34,828,678.18	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	34,828,678.18	-	-	-

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
IF2507	IF2507	15	17,585,100.00	71,671.15
IF2509	IF2509	15	17,491,500.00	176,250.67
合计				247,921.82
减：可抵销期货暂收款				247,921.82
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	5,978.83
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	59,507.37
预提审计费	22,315.49
其他应付	78,722.04
合计	166,523.73

6.4.7.7 实收基金

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	661,649,866.07	661,649,866.07
本期申购	422,726,773.32	422,726,773.32
本期赎回（以“-”号填列）	-194,005,949.97	-194,005,949.97
本期末	890,370,689.42	890,370,689.42

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	1,067,954,662.15	1,067,954,662.15
本期申购	540,541,717.22	540,541,717.22
本期赎回（以“-”号填列）	-851,175,702.55	-851,175,702.55
本期末	757,320,676.82	757,320,676.82

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	42,539,484.92	-6,730,747.13	35,808,737.79
本期期初	42,539,484.92	-6,730,747.13	35,808,737.79
本期利润	1,434,594.70	12,387,325.04	13,821,919.74
本期基金份额交易产生的变动数	16,312,800.53	-4,250,048.56	12,062,751.97
其中：基金申购款	27,268,196.42	-8,402,129.48	18,866,066.94
基金赎回款	-10,955,395.89	4,152,080.92	-6,803,314.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,286,880.15	1,406,529.35	61,693,409.50

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	61,114,951.17	-10,947,972.65	50,166,978.52
本期期初	61,114,951.17	-10,947,972.65	50,166,978.52
本期利润	-4,321,995.00	5,894,096.87	1,572,101.87
本期基金份额交易产生的变动数	-12,458,628.12	6,097,100.45	-6,361,527.67
其中：基金申购款	32,613,448.53	-9,719,169.16	22,894,279.37
基金赎回款	-45,072,076.65	15,816,269.61	-29,255,807.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,334,328.05	1,043,224.67	45,377,552.72

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	109,466.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	43,222.19
结算备付金利息收入	19,774.16
其他	-

合计	172,462.37
----	------------

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	7,228,418,851.88
减：卖出股票成本总额	7,232,650,342.81
减：交易费用	5,578,540.66
买卖股票差价收入	-9,810,031.59

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	-1,908,556.91
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	1,892.99
减：交易费用	105,477.28
合计	-2,015,927.18

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	21,612,149.02
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	21,612,149.02

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	17,446,805.00
——股票投资	17,446,805.00
——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	834,616.91
——权证投资	-
——期货投资	834,616.91
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	18,281,421.91

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	659,196.88
转换费收入	23,304.15
合计	682,501.03

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,673.59
合计	90,496.45

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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦东发展银行”)	基金托管人
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		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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	11,493,981,946.91	79.92%	2,944,285,987.60	100.00%

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	819,523.69	78.64%	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 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	232,970.38	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。

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	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,910,839.41	1,448,976.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,824,731.15	281,489.37
应支付基金管理人的净管理费	8,086,108.26	1,167,486.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,486,625.95	217,346.44

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		
	国泰君安沪深 300 指数 增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数 增强发起 C	合计
国泰海通资管	-	1,255,662.91	1,255,662.91
浦东发展银行	-	743.53	743.53
国泰海通证券	-	225,624.46	225,624.46
合计	-	1,482,030.90	1,482,030.90
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 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安沪深 300 指数 增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数 增强发起 C	合计
国泰海通资管	-	222,685.75	222,685.75
国泰海通证券	-	108,582.39	108,582.39
合计	-	331,268.14	331,268.14

注：本基金 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 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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。

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

国泰君安沪深 300 指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

报告期初持有的基金份额	10,009,000.00	30,972,312.37
报告期间申购/买入总份额	14,768,756.72	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	20,963,312.37
报告期末持有的基金份额	24,777,756.72	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.78%	4.55%

国泰君安沪深 300 指数增强发起 C

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
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	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.66%	0.88%

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		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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	68,921,741.84	43,222.19	20,853,765.40	12,397.40
浦东发展银行	100,811,862.08	109,466.02	33,750,788.52	20,358.15

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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。

6.4.10.7 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。

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
301458	钧崑电子	2025年01月02日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025年03月04日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025年01月08日	1-6个月 (含)	科创板打新限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
301678	新恒汇	2025年06月13日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025年01月15日	1-6个月 (含)	创业板打新限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-

		日)	售						
301501	恒鑫生活	2025年03月11日	1-6个月(含)	创业板打新限售	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	-
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	1-6个月(含)	主板打新限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301479	弘景光电	2025年03月06日	1-6个月(含)	创业板打新限售	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
688757	胜科纳米	2025年03月18日	1-6个月(含)	科创板打新限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年01月02日	1-6个月(含)	科创板打新限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1-6个月(含)	股票流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025年04月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025年01月08日	1-6个月(含)	创业板打新限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025年01月16日	1-6个月(含)	股票流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025年05月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

		日)	售						
301665	泰禾股份	2025年04月02日	1-6个月(含)	创业板打新限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
001382	新亚电缆	2025年03月13日	1-6个月(含)	股票流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025年05月12日	1-6个月(含)	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	1-6个月(含)	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	1-6个月(含)	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	1-6个月(含)	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	1-6个月(含)	股票流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025年03月04日	1-6个月(含)	股票流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025年03月12日	1-6个月(含)	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	1-6个月(含)	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	1-6个月(含)	股票流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-

		日)							
603382	海阳科技	2025年06月05日	1-6个月(含)	股票流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603120	肯特催化	2025年04月09日	1-6个月(含)	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。

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上海浦东发展银行股份有限公司，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%。

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	183,289,767.24	-	-	-	183,289,767.24

结算备付金	12,036,243.70	-	-	-	12,036,243.70
存出保证金	4,244,268.60	-	-	-	4,244,268.60
交易性金融资产	-	-	-	1,621,589,365.89	1,621,589,365.89
应收申购款	-	-	-	332,283.94	332,283.94
资产总计	199,570,279.54	-	-	1,621,921,649.83	1,821,491,929.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	64,469,387.86	64,469,387.86
应付管理人报酬	-	-	-	1,553,782.18	1,553,782.18
应付托管费	-	-	-	233,067.33	233,067.33
应付销售服务费	-	-	-	306,839.81	306,839.81
其他负债	-	-	-	166,523.73	166,523.73
负债总计	-	-	-	66,729,600.91	66,729,600.91
利率敏感度缺口	199,570,279.54	-	-	1,555,192,048.92	1,754,762,328.46
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	163,945,754.77	-	-	-	163,945,754.77
结算备付金	6,297,664.76	-	-	-	6,297,664.76
存出保证金	4,142,490.66	-	-	-	4,142,490.66
交易性金融资产	-	-	-	1,682,127,380.11	1,682,127,380.11
应收申购款	-	-	-	71,074,810.76	71,074,810.76
资产总计	174,385,910.19	-	-	1,753,202,190.87	1,927,588,101.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	109,866,988.21	109,866,988.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,468,804.78	1,468,804.78
应付托管费	-	-	-	220,320.71	220,320.71
应付销售服务费	-	-	-	411,247.30	411,247.30
其他负债	-	-	-	40,495.53	40,495.53
负债总计	-	-	-	112,007,856.53	112,007,856.53

利率敏感度缺口	174,385,910.19	-	-	1,641,194,334.34	1,815,580,244.53
---------	----------------	---	---	------------------	------------------

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	1,621,589,365.89	92.41	1,682,127,380.11	92.65
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	1,621,589,365.89	92.41	1,682,127,380.11	92.65

	9		1
--	---	--	---

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

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）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 06 月 30 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%	88,323,466.27	90,075,800.45
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-88,323,466.27	-90,075,800.45

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	1,621,300,102.46	1,681,576,802.88
第二层次	15,385.54	27,736.50
第三层次	273,877.89	522,840.73
合计	1,621,589,365.89	1,682,127,380.11

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	1,621,589,365.89	89.03
	其中:股票	1,621,589,365.89	89.03
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	195,326,010.94	10.72
8	其他各项资产	4,576,552.54	0.25
9	合计	1,821,491,929.3	100.00

		7	
--	--	---	--

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	28,898,278.65	1.65
B	采矿业	82,379,706.10	4.69
C	制造业	667,100,775.39	38.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,045,897.82	3.08
E	建筑业	42,709,416.00	2.43
F	批发和零售业	1,283,784.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	33,104,748.00	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,878,899.30	1.76
J	金融业	358,833,499.28	20.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,316,860.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	14,883,700.00	0.85
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	947,232.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,317,382,796.54	75.07

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	1,026,920.00	0.06
B	采矿业	3,464,783.00	0.20
C	制造业	218,729,060.55	12.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,405,307.00	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,518,917.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	20,434,836.76	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,005,999.24	1.54
J	金融业	14,762,852.16	0.84

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,466,159.64	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	417,842.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,973,892.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	304,206,569.35	17.34

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	234,552	59,158,705.44	3.37
2	600519	贵州茅台	38,700	54,548,424.00	3.11
3	600036	招商银行	918,200	42,191,290.00	2.40
4	601318	中国平安	557,400	30,924,552.00	1.76
5	601899	紫金矿业	1,394,300	27,188,850.00	1.55
6	600887	伊利股份	861,600	24,021,408.00	1.37
7	000651	格力电器	518,300	23,282,036.00	1.33
8	601857	中国石油	2,665,600	22,790,880.00	1.30
9	000063	中兴通讯	662,900	21,537,621.00	1.23
10	601398	工商银行	2,820,600	21,408,354.00	1.22

11	000333	美的集团	285,500	20,613,100.0 0	1.17
12	600104	上汽集团	1,281,400	20,566,470.0 0	1.17
13	601138	工业富联	949,800	20,306,724.0 0	1.16
14	601600	中国铝业	2,711,900	19,091,776.0 0	1.09
15	000725	京东方 A	4,716,900	18,820,431.0 0	1.07
16	300498	温氏股份	1,100,764	18,801,049.1 2	1.07
17	600030	中信证券	678,900	18,751,218.0 0	1.07
18	000858	五粮液	157,400	18,714,860.0 0	1.07
19	600690	海尔智家	738,300	18,295,074.0 0	1.04
20	601818	光大银行	4,395,100	18,239,665.0 0	1.04
21	601009	南京银行	1,568,000	18,220,160.0 0	1.04
22	688981	中芯国际	193,634	17,072,709.7 8	0.97
23	000001	平安银行	1,344,900	16,232,943.0 0	0.93
24	601919	中远海控	1,070,800	16,104,832.0 0	0.92
25	601788	光大证券	828,802	14,901,859.9 6	0.85
26	603259	药明康德	214,000	14,883,700.0 0	0.85
27	601166	兴业银行	620,100	14,473,134.0 0	0.82
28	000100	TCL 科技	3,243,800	14,045,654.0 0	0.80
29	688008	澜起科技	169,170	13,871,940.0 0	0.79
30	601766	中国中车	1,917,600	13,499,904.0 0	0.77
31	000166	申万宏源	2,681,600	13,461,632.0 0	0.77
32	002142	宁波银行	486,100	13,299,696.0 0	0.76

33	600016	民生银行	2,786,900	13,237,775.0 0	0.75
34	600460	士兰微	531,200	13,184,384.0 0	0.75
35	600900	长江电力	430,413	12,972,647.8 2	0.74
36	601669	中国电建	2,630,000	12,808,100.0 0	0.73
37	601939	建设银行	1,315,389	12,417,272.1 6	0.71
38	002475	立讯精密	348,700	12,096,403.0 0	0.69
39	600482	中国动力	521,700	12,035,619.0 0	0.69
40	601668	中国建筑	2,068,000	11,932,360.0 0	0.68
41	601628	中国人寿	289,600	11,928,624.0 0	0.68
42	601985	中国核电	1,233,500	11,496,220.0 0	0.66
43	600660	福耀玻璃	200,400	11,424,804.0 0	0.65
44	600795	国电电力	2,309,700	11,178,948.0 0	0.64
45	600875	东方电气	664,200	11,118,708.0 0	0.63
46	601995	中金公司	312,200	11,039,392.0 0	0.63
47	300433	蓝思科技	483,900	10,790,970.0 0	0.61
48	300124	汇川技术	164,500	10,621,765.0 0	0.61
49	600050	中国联通	1,938,500	10,351,590.0 0	0.59
50	600019	宝钢股份	1,558,400	10,269,856.0 0	0.59
51	600011	华能国际	1,431,200	10,218,768.0 0	0.58
52	002714	牧原股份	240,353	10,097,229.5 3	0.58
53	600196	复星医药	365,000	9,157,850.00	0.52
54	688396	华润微	192,922	9,098,201.52	0.52
55	601186	中国铁建	1,132,100	9,068,121.00	0.52

56	601169	北京银行	1,308,360	8,936,098.80	0.51
57	600018	上港集团	1,526,500	8,716,315.00	0.50
58	300628	亿联网络	248,900	8,651,764.00	0.49
59	300502	新易盛	68,100	8,650,062.00	0.49
60	300014	亿纬锂能	188,400	8,630,604.00	0.49
61	600188	兖矿能源	704,930	8,578,998.10	0.49
62	300308	中际旭创	58,700	8,561,982.00	0.49
63	002736	国信证券	741,300	8,539,776.00	0.49
64	002594	比亚迪	23,329	7,743,128.39	0.44
65	601066	中信建投	318,200	7,652,710.00	0.44
66	601658	邮储银行	1,373,800	7,514,686.00	0.43
67	000568	泸州老窖	65,600	7,439,040.00	0.42
68	603296	华勤技术	88,900	7,172,452.00	0.41
69	601898	中煤能源	655,600	7,172,264.00	0.41
70	300059	东方财富	304,300	7,038,459.00	0.40
71	603288	海天味业	179,664	6,990,726.24	0.40
72	002648	卫星化学	371,400	6,436,362.00	0.37
73	600276	恒瑞医药	118,181	6,133,593.90	0.35
74	601328	交通银行	763,400	6,107,200.00	0.35
75	601989	中国重工	1,294,900	6,008,336.00	0.34
76	003816	中国广核	1,617,200	5,886,608.00	0.34
77	600893	航发动力	152,400	5,873,496.00	0.33
78	000977	浪潮信息	110,800	5,637,504.00	0.32
79	002415	海康威视	200,200	5,551,546.00	0.32
80	600958	东方证券	545,056	5,276,142.08	0.30
81	600015	华夏银行	664,600	5,256,986.00	0.30
82	600309	万华化学	96,700	5,246,942.00	0.30
83	300979	华利集团	97,400	5,120,318.00	0.29
84	603501	豪威集团	39,960	5,100,894.00	0.29
85	600362	江西铜业	217,300	5,091,339.00	0.29
86	002230	科大讯飞	105,900	5,070,492.00	0.29
87	601088	中国神华	123,200	4,994,528.00	0.28
88	600160	巨化股份	167,900	4,815,372.00	0.27
89	601698	中国卫通	223,600	4,577,092.00	0.26
90	600938	中国海油	173,700	4,535,307.00	0.26
91	300274	阳光电源	65,100	4,411,827.00	0.25
92	688256	寒武纪	6,800	4,090,200.00	0.23
93	600584	长电科技	116,800	3,934,992.00	0.22
94	601872	招商轮船	593,600	3,715,936.00	0.21
95	601225	陕西煤业	186,700	3,592,108.00	0.20
96	002916	深南电路	32,990	3,556,651.90	0.20
97	601319	中国人保	407,600	3,550,196.00	0.20
98	600919	江苏银行	294,800	3,519,912.00	0.20

99	601728	中国电信	445,900	3,455,725.00	0.20
100	601077	渝农商行	478,800	3,418,632.00	0.19
101	601800	中国交建	381,700	3,393,313.00	0.19
102	002938	鹏鼎控股	104,900	3,359,947.00	0.19
103	000425	徐工机械	428,719	3,331,146.63	0.19
104	600926	杭州银行	195,100	3,281,582.00	0.19
105	601021	春秋航空	58,100	3,233,265.00	0.18
106	600150	中国船舶	94,700	3,081,538.00	0.18
107	002600	领益智造	349,200	2,999,628.00	0.17
108	000776	广发证券	176,200	2,961,922.00	0.17
109	601390	中国中铁	505,400	2,835,294.00	0.16
110	601117	中国化学	348,400	2,672,228.00	0.15
111	600989	宝丰能源	160,700	2,593,698.00	0.15
112	601901	方正证券	325,700	2,576,287.00	0.15
113	600085	同仁堂	70,300	2,535,018.00	0.14
114	688111	金山办公	8,646	2,421,312.30	0.14
115	601888	中国中免	38,000	2,316,860.00	0.13
116	001289	龙源电力	141,700	2,292,706.00	0.13
117	600219	南山铝业	594,100	2,275,403.00	0.13
118	600918	中泰证券	348,200	2,238,926.00	0.13
119	000301	东方盛虹	265,401	2,210,790.33	0.13
120	600999	招商证券	115,200	2,026,368.00	0.12
121	601633	长城汽车	92,000	1,976,160.00	0.11
122	600332	白云山	71,000	1,871,560.00	0.11
123	601877	正泰电器	82,400	1,868,008.00	0.11
124	600028	中国石化	316,400	1,784,496.00	0.10
125	002001	新和成	83,000	1,765,410.00	0.10
126	601881	中国银河	99,100	1,699,565.00	0.10
127	600426	华鲁恒升	77,500	1,679,425.00	0.10
128	601288	农业银行	262,000	1,540,560.00	0.09
129	688041	海光信息	9,691	1,369,241.39	0.08
130	002493	荣盛石化	161,600	1,338,048.00	0.08
131	001965	招商公路	111,200	1,334,400.00	0.08
132	601607	上海医药	71,800	1,283,784.00	0.07
133	002371	北方华创	2,700	1,193,967.00	0.07
134	002241	歌尔股份	51,100	1,191,652.00	0.07
135	601229	上海银行	100,566	1,067,005.26	0.06
136	300760	迈瑞医疗	4,400	988,900.00	0.06
137	601336	新华保险	16,800	982,800.00	0.06
138	300015	爱尔眼科	75,900	947,232.00	0.05
139	301236	软通动力	16,700	912,488.00	0.05
140	600031	三一重工	49,500	888,525.00	0.05
141	600547	山东黄金	27,500	878,075.00	0.05

142	300394	天孚通信	10,800	862,272.00	0.05
143	000338	潍柴动力	52,700	810,526.00	0.05
144	601998	中信银行	93,631	795,863.50	0.05
145	601236	红塔证券	82,800	701,316.00	0.04
146	601808	中海油服	42,000	577,920.00	0.03
147	601688	华泰证券	28,000	498,680.00	0.03
148	600061	国投资本	65,276	490,875.52	0.03
149	000876	新希望	49,100	460,558.00	0.03
150	000768	中航西飞	16,200	442,908.00	0.03
151	000630	铜陵有色	132,200	441,548.00	0.03
152	601136	首创证券	21,800	433,384.00	0.02
153	601689	拓普集团	7,600	359,100.00	0.02
154	600111	北方稀土	13,300	331,170.00	0.02
155	600741	华域汽车	17,800	314,170.00	0.02
156	603993	洛阳钼业	34,000	286,280.00	0.02
157	002463	沪电股份	5,400	229,932.00	0.01
158	688187	时代电气	4,700	200,455.00	0.01
159	000792	盐湖股份	7,300	124,684.00	0.01
160	688599	天合光能	39	566.67	0.00
161	600176	中国巨石	43	490.20	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	601298	青岛港	1,376,300	11,960,047.00	0.68
2	600267	海正药业	988,900	9,147,325.00	0.52
3	601997	贵阳银行	1,459,200	9,105,408.00	0.52
4	600703	三安光电	667,700	8,292,834.00	0.47
5	300009	安科生物	708,000	5,925,960.00	0.34
6	002249	大洋电机	877,200	5,771,976.00	0.33
7	000878	云南铜业	434,347	5,524,893.84	0.31
8	600268	国电南自	687,416	5,375,593.12	0.31
9	688220	翱捷科技	64,400	5,042,520.00	0.29
10	002414	高德红外	470,300	4,820,575.00	0.27
11	600521	华海药业	249,400	4,646,322.00	0.26
12	002349	精华制药	626,504	4,504,563.76	0.26
13	600410	华胜天成	467,600	4,484,284.00	0.26
14	688728	格科微	279,639	4,306,440.60	0.25
15	688280	精进电动	588,615	4,279,231.05	0.24
16	688365	光云科技	272,156	4,142,214.32	0.24

17	300257	开山股份	405,900	4,087,413.00	0.23
18	600717	天津港	871,821	3,975,503.76	0.23
19	301015	百洋医药	191,600	3,843,496.00	0.22
20	301256	华融化学	362,200	3,835,698.00	0.22
21	301165	锐捷网络	59,220	3,639,661.20	0.21
22	600315	上海家化	168,200	3,543,974.00	0.20
23	688469	芯联集成	724,587	3,456,279.99	0.20
24	600619	海立股份	301,400	3,438,974.00	0.20
25	300231	银信科技	274,100	3,374,171.00	0.19
26	300489	光智科技	72,800	3,214,848.00	0.18
27	688180	君实生物	88,000	2,990,240.00	0.17
28	300558	贝达药业	51,400	2,978,630.00	0.17
29	000823	超声电子	239,300	2,835,705.00	0.16
30	600299	安迪苏	281,700	2,718,405.00	0.15
31	688146	中船特气	93,117	2,692,012.47	0.15
32	300224	正海磁材	188,200	2,663,030.00	0.15
33	688222	成都先导	164,052	2,637,956.16	0.15
34	300102	乾照光电	225,700	2,611,349.00	0.15
35	688518	联赢激光	127,300	2,595,647.00	0.15
36	000783	长江证券	366,300	2,538,459.00	0.14
37	301526	国际复材	685,900	2,496,676.00	0.14
38	600742	富维股份	262,100	2,492,571.00	0.14
39	300570	太辰光	25,700	2,476,966.00	0.14
40	688209	英集芯	124,933	2,307,512.51	0.13
41	600096	云天化	104,600	2,298,062.00	0.13
42	601678	滨化股份	544,500	2,254,230.00	0.13
43	300320	海达股份	223,511	2,221,699.34	0.13
44	688343	云天励飞	44,704	2,209,271.68	0.13
45	002758	浙农股份	245,200	2,189,636.00	0.12
46	603687	大胜达	277,400	2,061,082.00	0.12
47	002455	百川股份	272,433	2,037,798.84	0.12
48	002174	游族网络	162,200	1,967,486.00	0.11
49	000513	丽珠集团	53,400	1,924,536.00	0.11
50	688590	新致软件	93,200	1,914,328.00	0.11
51	600699	均胜电子	109,000	1,900,960.00	0.11
52	300424	航新科技	109,400	1,894,808.00	0.11
53	688403	汇成股份	181,893	1,889,868.27	0.11
54	002625	光启技术	47,000	1,879,060.00	0.11
55	600004	白云机场	203,200	1,849,120.00	0.11
56	002661	克明食品	180,900	1,810,809.00	0.10
57	300562	乐心医疗	122,300	1,803,925.00	0.10
58	600557	康缘药业	121,700	1,798,726.00	0.10
59	688602	康鹏科技	206,234	1,728,240.92	0.10

60	600909	华安证券	290,100	1,691,283.00	0.10
61	688334	西高院	98,185	1,686,818.30	0.10
62	301260	格力博	83,500	1,646,620.00	0.09
63	002603	以岭药业	116,100	1,637,010.00	0.09
64	301025	读客文化	146,700	1,613,700.00	0.09
65	601168	西部矿业	96,700	1,608,121.00	0.09
66	688512	慧智微	143,500	1,565,585.00	0.09
67	600819	耀皮玻璃	264,500	1,539,390.00	0.09
68	300039	上海凯宝	253,500	1,536,210.00	0.09
69	600216	浙江医药	100,900	1,492,311.00	0.09
70	603739	蔚蓝生物	111,700	1,487,844.00	0.08
71	601567	三星医疗	64,400	1,443,848.00	0.08
72	600062	华润双鹤	75,000	1,399,500.00	0.08
73	688321	微芯生物	58,632	1,394,268.96	0.08
74	301376	致欧科技	75,300	1,374,225.00	0.08
75	300788	中信出版	42,400	1,360,192.00	0.08
76	688584	上海合晶	75,230	1,345,112.40	0.08
77	002206	海利得	263,100	1,344,441.00	0.08
78	002228	合兴包装	374,000	1,320,220.00	0.08
79	300624	万兴科技	20,700	1,284,435.00	0.07
80	600582	天地科技	213,200	1,277,068.00	0.07
81	688275	万润新能	30,500	1,236,775.00	0.07
82	002004	华邦健康	296,000	1,234,320.00	0.07
83	300351	永贵电器	76,900	1,224,248.00	0.07
84	601156	东航物流	93,100	1,218,679.00	0.07
85	002825	纳尔股份	121,700	1,214,566.00	0.07
86	002275	桂林三金	83,900	1,200,609.00	0.07
87	300705	九典制药	72,500	1,128,825.00	0.06
88	003022	联泓新科	71,100	1,125,513.00	0.06
89	600352	浙江龙盛	108,400	1,101,344.00	0.06
90	600685	中船防务	40,300	1,095,757.00	0.06
91	300908	仲景食品	36,200	1,089,982.00	0.06
92	300456	赛微电子	63,100	1,084,689.00	0.06
93	688079	美迪凯	107,949	1,083,807.96	0.06
94	600959	江苏有线	305,800	1,051,952.00	0.06
95	300232	洲明科技	145,000	1,049,800.00	0.06
96	002491	通鼎互联	175,200	995,136.00	0.06
97	002258	利尔化学	88,200	973,728.00	0.06
98	300802	矩子科技	49,900	940,116.00	0.05
99	600780	通宝能源	151,500	898,395.00	0.05
100	600812	华北制药	144,900	895,482.00	0.05
101	000009	中国宝安	100,207	889,838.16	0.05
102	000021	深科技	47,400	888,276.00	0.05

103	002881	美格智能	18,500	858,400.00	0.05
104	002786	银宝山新	92,400	851,928.00	0.05
105	300817	双飞集团	36,000	851,040.00	0.05
106	300458	全志科技	21,100	837,459.00	0.05
107	688128	中国电研	33,492	820,554.00	0.05
108	002885	京泉华	57,800	817,870.00	0.05
109	002783	凯龙股份	94,500	815,535.00	0.05
110	002151	北斗星通	27,400	786,106.00	0.04
111	300043	星辉娱乐	158,900	769,076.00	0.04
112	000426	兴业银锡	48,000	758,400.00	0.04
113	301055	张小泉	35,900	756,772.00	0.04
114	688210	统联精密	32,800	747,840.00	0.04
115	600550	保变电气	84,400	725,840.00	0.04
116	688505	复旦张江	82,528	714,692.48	0.04
117	601326	秦港股份	214,900	694,127.00	0.04
118	300206	理邦仪器	57,700	693,554.00	0.04
119	002772	众兴菌业	87,500	683,375.00	0.04
120	600968	海油发展	166,000	677,280.00	0.04
121	688428	诺诚健华	27,695	676,588.85	0.04
122	301381	赛维时代	33,400	666,330.00	0.04
123	300694	蠡湖股份	44,800	665,728.00	0.04
124	300830	金现代	72,800	664,664.00	0.04
125	688183	生益电子	12,700	650,240.00	0.04
126	301110	青木科技	11,400	638,286.00	0.04
127	000901	航天科技	50,400	626,472.00	0.04
128	301339	通行宝	35,600	609,828.00	0.03
129	000026	飞亚达	36,000	569,520.00	0.03
130	300017	网宿科技	53,100	569,232.00	0.03
131	002624	完美世界	37,500	568,875.00	0.03
132	600166	福田汽车	204,700	554,737.00	0.03
133	600420	国药现代	51,000	543,150.00	0.03
134	603189	网达软件	31,100	540,207.00	0.03
135	002500	山西证券	92,100	537,864.00	0.03
136	002329	皇氏集团	151,000	531,520.00	0.03
137	600283	钱江水利	49,600	506,912.00	0.03
138	688176	亚虹医药	56,700	502,929.00	0.03
139	688739	成大生物	18,700	493,680.00	0.03
140	300768	迪普科技	28,500	488,775.00	0.03
141	002913	奥士康	16,500	485,265.00	0.03
142	002953	日丰股份	46,100	478,518.00	0.03
143	601228	广州港	145,400	469,642.00	0.03
144	688425	铁建重工	113,872	464,597.76	0.03
145	688579	山大地纬	41,400	463,266.00	0.03

146	300488	恒锋工具	14,200	463,204.00	0.03
147	600262	北方股份	19,800	451,440.00	0.03
148	300724	捷佳伟创	8,300	450,690.00	0.03
149	688588	凌志软件	29,900	435,643.00	0.02
150	300602	飞荣达	20,300	430,563.00	0.02
151	600475	华光环能	40,100	417,842.00	0.02
152	603013	亚普股份	23,900	412,992.00	0.02
153	300026	红日药业	109,900	405,531.00	0.02
154	301069	凯盛新材	24,000	386,640.00	0.02
155	300113	顺网科技	18,000	355,680.00	0.02
156	300905	宝丽迪	11,100	354,645.00	0.02
157	301017	漱玉平民	27,100	347,693.00	0.02
158	600354	敦煌种业	55,500	343,545.00	0.02
159	300160	秀强股份	58,500	328,770.00	0.02
160	002340	格林美	49,900	316,865.00	0.02
161	002722	物产金轮	19,400	312,146.00	0.02
162	688015	交控科技	14,892	310,349.28	0.02
163	002128	电投能源	15,500	306,590.00	0.02
164	603101	汇嘉时代	39,502	296,265.00	0.02
165	003016	欣贺股份	36,900	276,750.00	0.02
166	600125	铁龙物流	47,300	267,718.00	0.02
167	688660	电气风电	30,200	262,136.00	0.01
168	002056	横店东磁	18,400	260,360.00	0.01
169	300702	天宇股份	10,600	246,556.00	0.01
170	300221	银禧科技	29,100	241,530.00	0.01
171	603160	汇顶科技	3,400	241,502.00	0.01
172	688586	江航装备	21,000	236,250.00	0.01
173	300539	横河精密	17,000	232,730.00	0.01
174	300184	力源信息	23,600	231,752.00	0.01
175	301149	隆华新材	20,100	229,944.00	0.01
176	688685	迈信林	4,000	223,400.00	0.01
177	300869	康泰医学	15,400	220,836.00	0.01
178	300196	长海股份	17,900	218,380.00	0.01
179	300399	天利科技	5,900	215,940.00	0.01
180	301536	星辰科技	3,500	211,050.00	0.01
181	002284	亚太股份	18,300	202,215.00	0.01
182	300573	兴齐眼药	3,800	196,802.00	0.01
183	000869	张裕 A	8,100	171,963.00	0.01
184	002107	沃华医药	28,900	165,308.00	0.01
185	600961	株冶集团	14,200	158,756.00	0.01
186	300496	中科创达	2,600	148,772.00	0.01
187	600305	恒顺醋业	18,300	141,459.00	0.01
188	000919	金陵药业	20,400	138,924.00	0.01

189	688177	百奥泰	5,368	134,522.08	0.01
190	688179	阿拉丁	9,112	115,904.64	0.01
191	688208	道通科技	3,745	114,597.00	0.01
192	601101	昊华能源	15,800	114,392.00	0.01
193	688158	优刻得	4,752	107,490.24	0.01
194	002730	电光科技	5,200	87,932.00	0.01
195	301281	科源制药	1,800	58,284.00	0.00
196	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
197	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
198	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
199	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
200	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
201	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
202	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
203	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
204	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
205	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
206	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
207	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
208	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
209	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
210	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
211	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
212	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
213	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
214	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
215	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
216	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
217	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
218	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
219	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
220	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
221	688249	晶合集成	131	2,655.37	0.00
222	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
223	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
224	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
225	688088	虹软科技	44	2,123.00	0.00
226	688716	中研股份	35	1,246.00	0.00
227	301617	博苑股份	29	1,190.45	0.00
228	300739	明阳电路	50	742.00	0.00
229	605365	立达信	48	707.04	0.00
230	688362	甬矽电子	20	595.60	0.00
231	688381	帝奥微	15	324.90	0.00

232	002386	天原股份	50	248.00	0.00
233	601216	君正集团	41	226.32	0.00
234	301029	怡合达	7	160.02	0.00
235	688400	凌云光	4	110.28	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	600276	恒瑞医药	75,152,270.70	4.14
2	300750	宁德时代	62,139,421.00	3.42
3	600519	贵州茅台	56,636,263.00	3.12
4	000063	中兴通讯	53,993,395.00	2.97
5	688981	中芯国际	53,357,059.54	2.94
6	688008	澜起科技	47,768,544.95	2.63
7	601939	建设银行	46,431,901.05	2.56
8	000651	格力电器	45,138,738.00	2.49
9	603259	药明康德	44,711,815.20	2.46
10	600036	招商银行	44,557,276.00	2.45
11	002594	比亚迪	44,022,868.00	2.42
12	601328	交通银行	43,201,166.00	2.38
13	600030	中信证券	41,791,998.00	2.30
14	601899	紫金矿业	41,183,119.00	2.27
15	000338	潍柴动力	40,936,465.40	2.25
16	000858	五粮液	40,916,331.07	2.25

17	601398	工商银行	39,880,672.0 0	2.20
18	002714	牧原股份	39,402,214.0 7	2.17
19	000001	平安银行	38,834,796.0 0	2.14
20	002142	宁波银行	38,303,088.4 0	2.11
21	601788	光大证券	37,817,762.0 0	2.08
22	601138	工业富联	36,911,825.1 7	2.03
23	002415	海康威视	36,329,053.0 0	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。

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	76,486,917.8 2	4.21
2	600519	贵州茅台	66,163,065.0 0	3.64
3	002594	比亚迪	59,083,363.3 2	3.25
4	300750	宁德时代	56,844,054.7 8	3.13
5	603259	药明康德	55,324,746.4 0	3.05
6	601318	中国平安	54,444,251.0 0	3.00
7	601988	中国银行	51,339,812.3 0	2.83
8	688981	中芯国际	50,277,239.5 8	2.77
9	600036	招商银行	48,401,659.0 0	2.67
10	601939	建设银行	45,685,839.1 0	2.52
11	601899	紫金矿业	45,660,269.4 6	2.51

12	000333	美的集团	45,647,568.85	2.51
13	000338	潍柴动力	45,371,919.80	2.50
14	000001	平安银行	45,028,127.00	2.48
15	601328	交通银行	44,513,668.00	2.45
16	000063	中兴通讯	44,168,822.00	2.43
17	600941	中国移动	43,816,484.00	2.41
18	603986	兆易创新	42,233,932.80	2.33
19	002415	海康威视	42,134,147.00	2.32
20	000858	五粮液	41,551,781.00	2.29
21	002352	顺丰控股	40,619,615.85	2.24
22	002475	立讯精密	40,350,169.00	2.22
23	688008	澜起科技	39,467,365.71	2.17
24	603501	豪威集团	39,427,180.70	2.17
25	600031	三一重工	39,176,517.00	2.16
26	300274	阳光电源	38,557,856.30	2.12
27	600900	长江电力	38,360,411.00	2.11
28	600887	伊利股份	38,127,576.00	2.10
29	601728	中国电信	37,823,737.00	2.08
30	601138	工业富联	37,345,848.41	2.06
31	601919	中远海控	36,912,578.50	2.03

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	7,154,665,523.59
卖出股票收入（成交）总额	7,228,418,851.88

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招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	4,244,268.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	332,283.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,576,552.54

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
国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	88,461	10,065.12	658,369,057.61	73.94%	232,001,631.81	26.06%
国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	17,614	42,995.38	682,765,562.94	90.16%	74,555,113.88	9.84%
合计	106,075	15,533.27	1,341,134,620.55	81.39%	306,556,745.69	18.61%

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	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	632,072.69	0.0710%
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	8,152.93	0.0011%
	合计	640,225.62	0.0389%

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	国泰君安沪深 300 指数增强发 起 A	10~50
	国泰君安沪深 300 指数增强发 起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放 式基金	国泰君安沪深 300 指数增强发 起 A	10~50
	国泰君安沪深 300 指数增强发 起 C	0
	合计	10~50

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	29,787,756.7 2	1.81%	15,019,000.0 0	0.91%	自基金合同 生效日起不 少于 3 年
基金管理人高级 管理人员	17,761.02	-	-	-	-
基金经理等人员	245,239.23	0.01%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	377,225.37	0.02%	-	-	-
合计	30,427,982.3 4	1.84%	15,019,000.0 0	0.91%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安沪深 300 指数 增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数 增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）基金 份额总额	10,009,999.00	5,010,000.00
本报告期期初基金份额总额	661,649,866.07	1,067,954,662.15
本报告期基金总申购份额	422,726,773.32	540,541,717.22
减：本报告期基金总赎回份额	194,005,949.97	851,175,702.55
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	890,370,689.42	757,320,676.82

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、报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	11,493,981,946.91	79.92%	819,523.69	78.64%	-
光大证券股份有限公司	3	2,887,997,810.82	20.08%	222,660.02	21.36%	-

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	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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 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	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公	2025-02-27

	额、最低追加申购金额、最低赎回份额和最低持有限额的公告	司官网	
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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
8	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（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	2025-04-18
9	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（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	2025-04-18
10	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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	2025-04-18
11	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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、关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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.gtztzg.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