

国泰君安中证 1000 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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	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	19
§ 7 投资组合报告	41
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	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60

§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件.....	64
§ 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.....	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 1000 指数增强	
基金主代码	015867	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 08 月 16 日	
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,200,681,947.81 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 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015867	015868
报告期末下属分级基金的份额总额	658,975,105.80 份	541,706,842.01 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 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率 \times 95% + 同期银行活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	任航
	联系电话	021-38676022	010-66060069
	电子邮箱	zgxxpl@ghtht.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95521	95599
传真		021-38871190	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200011	100031
法定代表人		陶耿	谷澍

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.ghttzg.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 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	45,800,772.87	43,616,830.79
本期利润	88,051,754.00	84,798,735.42
加权平均基金份额本期利润	0.1326	0.1382

本期加权平均净值利润率	11.96%	12.60%
本期基金份额净值增长率	13.12%	12.89%
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	81,502,986.92	60,113,426.48
期末可供分配基金份额利润	0.1237	0.1110
期末基金资产净值	785,673,351.42	638,499,428.22
期末基金份额净值	1.1923	1.1787
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	19.23%	17.87%

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 1000 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	6.04%	0.91%	5.20%	0.89%	0.84%	0.02%
过去三个月	6.13%	1.81%	2.03%	1.73%	4.10%	0.08%
过去六个月	13.12%	1.60%	6.44%	1.56%	6.68%	0.04%
过去一年	43.37%	1.88%	28.45%	1.87%	14.92%	0.01%
自基金合同生效起至今	19.23%	1.52%	-11.72%	1.52%	30.95%	0.00%

国泰君安中证 1000 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	6.01%	0.91%	5.20%	0.89%	0.81%	0.02%
过去三个月	6.03%	1.81%	2.03%	1.73%	4.00%	0.08%
过去六个月	12.89%	1.60%	6.44%	1.56%	6.45%	0.04%
过去一年	42.80%	1.88%	28.45%	1.87%	14.35%	0.01%
自基金合同生效起至今	17.87%	1.52%	-11.72%	1.52%	29.59%	0.00%

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1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月16日-2025年06月30日)



国泰君安中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月16日-2025年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，注册地址上海。

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，国泰君安稳健债券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	2022-08-16	-	14 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍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。

	量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
刘晟	国泰君安中证 1000 指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2024-08-21	-	3 年	刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。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，中证1000指数在科技主题热潮中，作为中小盘成长股的典型代表弹性显著，涨幅高于中大盘指数（涨幅6.69%），强于沪深300指数（涨幅0.03%）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、高稳定性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。鉴于今年市场环境的复杂性，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。

从中证1000指数当前的估值水平来看，截至6月底其加权PE和整体PE分别在45倍和39倍左右，整体PE在历史上的分位数在48%，较前有小幅下降。采用PB估值则处于历史分位数16%之内，仍具有向上空间。未来随着经济的全面逐步复苏及政策的逐步落地，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为作为一个高成长性、盈利增长潜力较大，行业分布均匀的中小盘宽基指数，中证1000指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

展望下半年，随着中东冲突逐步缓和，及中美共振降息的流动性宽松格局延续，A股估值修复

动力增强。盈利方面，虽仍面临关税压力，但在抢出口效应下，短期 A 股基本面仍有韧性支撑；估值方面，在全球市场风险偏好回暖和美国经济软着陆的预期下，全年仍有降息预期。而在国内人民币升值背景下，宽货币空间进一步打开，流动性宽松局面有望延续，驱动 A 股估值端进一步走强。整体而言，指数短期或面临阶段性调整压力，但尚未达到盈利承压最强的时候，因而每次调整都不剧烈，反而是流动性助推下，向上突破动力更强，指数持续有结构性做多机会。风险方面，仍需关注中美关税政策、地缘政治反复以及全球流动性收紧节奏，但监管层对资本市场改革的持续深化（如“国九条”落实）有望进一步稳定市场信心。

本基金是指数增强型基金，而基准指数中证 1000 相对于市值更大的宽基具有更强的进攻性，代价是波动率也会适度加大，我们一方面将波动率视为 Alpha 的朋友，另一方面也建议投资者对于波动率较大的基金采取定投等方式来改善基金持有体验。在投资策略层面，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，争取以较为稳定的方式增强中证 1000 指数。我们的投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期持有。我们认为中证 1000 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.1923 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 13.12%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%；截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.1787 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 12.89%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中小盘成长股对流动性环境更为敏感，下半年中美共振降息与国内宽货币政策将显著降低其融资成本，叠加“专精特新”企业税收优惠等政策落地，盈利增速有望跑赢大盘；中证 1000 指数上半年上涨 6.69%，表现亮眼，其高成长性与行业分散性优势显著，短期波动率或因市场情绪波动加大，但长期来看技术创新与产业升级将打开成长空间，指数上涨动能强于回调压力；行业层面，科技板块中 AI 算力、半导体设备等领域技术突破加速，成为中小盘成长股的核心驱动力，新能源产业链中的细分环节在政策支持下需求放量，传媒和计算机板块在大语言模型的快速发展下催生更多的落地应用，同时建议关注低估值消费电子板块的困境反转机会。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—上海国泰海通证券资产管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，上海国泰海通证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，上海国泰海通证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完

整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 1000 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	94,822,926.00	77,728,427.14
结算备付金		9,767,751.28	12,901,926.96
存出保证金		3,516,648.00	2,793,595.20
交易性金融资产	6.4.7.2	1,315,385,508.82	1,197,427,161.27
其中：股票投资		1,315,385,508.82	1,197,427,161.27
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		14,476,621.62	8,955,010.50
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—

资产总计		1, 437, 969, 455. 72	1, 299, 806, 121. 07
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		12, 106, 737. 93	7, 451, 079. 73
应付管理人报酬		1, 141, 912. 93	1, 061, 121. 20
应付托管费		171, 286. 92	159, 168. 21
应付销售服务费		200, 430. 63	209, 367. 51
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	176, 307. 67	165, 500. 13
负债合计		13, 796, 676. 08	9, 046, 236. 78
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 7	1, 200, 681, 947. 81	1, 230, 260, 222. 40
未分配利润	6. 4. 7. 8	223, 490, 831. 83	60, 499, 661. 89
净资产合计		1, 424, 172, 779. 64	1, 290, 759, 884. 29
负债和净资产总计		1, 437, 969, 455. 72	1, 299, 806, 121. 07

注 报告截止日 2025 年 06 月 30 日, 基金份额总额 1, 200, 681, 947. 81 份。其中国泰君安中证 1000

指数增强 A 基金份额净值 1.1923 元，基金份额总额 658,975,105.80 份；国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.1787 元，基金份额总额 541,706,842.01 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 1000 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	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业收入		182,279,801.54	-114,076,551.76
1.利息收入		247,559.77	230,936.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	212,240.04	230,936.80
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		35,319.73	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		97,157,292.37	-91,545,914.37
其中：股票投资收益	6.4.7.10	88,564,790.19	-96,744,972.86
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	-152,169.44	-716,097.88
股利收益	6.4.7.12	8,744,671.62	5,915,156.37
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	83,432,885.76	-22,964,150.65

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	1, 442, 063. 64	202, 576. 46
减：二、营业总支出		9, 429, 312. 12	6, 403, 380. 43
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	6, 959, 671. 99	4, 446, 281. 11
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 043, 950. 78	666, 942. 10
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1, 330, 204. 55	1, 195, 462. 83
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		6, 530. 49	881. 13
8. 其他费用	6. 4. 7. 15	88, 954. 31	93, 813. 26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		172, 850, 489. 42	-120, 479, 932. 19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		172, 850, 489. 42	-120, 479, 932. 19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		172, 850, 489. 42	-120, 479, 932. 19

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 1000 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	1, 230, 260, 222. 40	60, 499, 661. 89	1, 290, 759, 884. 29
二、本期期初净资产	1, 230, 260, 222. 40	60, 499, 661. 89	1, 290, 759, 884. 29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29, 578, 274. 59	162, 991, 169. 94	133, 412, 895. 35

(一)、综合收益总额	-	172,850,489.42	172,850,489.42
(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）	-29,578,274.59	-9,859,319.48	-39,437,594.07
其中：1. 基金申购款	918,076,025.65	96,108,354.21	1,014,184,379.86
2. 基金赎回款	-947,654,300.24	-105,967,673.69	1,053,621,973.93
(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	1,200,681,947.81	223,490,831.83	1,424,172,779.64
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	1,410,006,840.95	-106,436,421.60	1,303,570,419.35
二、本期期初净资产	1,410,006,840.95	-106,436,421.60	1,303,570,419.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-630,755,491.59	-27,573,126.19	-658,328,617.78
(一)、综合收益总额	-	-120,479,932.19	-120,479,932.19
(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）	-630,755,491.59	92,906,806.00	-537,848,685.59
其中：1. 基金申购款	365,599,994.23	-49,719,829.64	315,880,164.59
2. 基金赎回款	-996,355,485.82	142,626,635.64	-853,728,850.18
(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	779,251,349.36	-134,009,547.79	645,241,801.57

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 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]983 号《关于准予国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》，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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰君安中证

1000 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2022 年 8 月 1 日至 2022 年 8 月 12 日共募集 609,312,722.10 元(不含认购资金利息)，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(2022)验字第 0724 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 8 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 609,392,211.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 79,489.52 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证 1000 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。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 1000 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%，投资于中证 1000 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 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、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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内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	31,010,818.67
等于：本金	31,006,422.62
加：应计利息	4,396.05
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	63,812,107.33
等于：本金	63,811,211.10
加：应计利息	896.23
减：坏账准备	-
合计	94,822,926.00

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	1,285,681,317.1 6	-	1,315,385,508.8 2	29,704,191.66
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	1,285,681,317.1 6	-	1,315,385,508.8 2	29,704,191.66

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	28,283,562.38	-	-	-
—股指期货	28,283,562.38	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	28,283,562.38	-	-	-

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
IM2507	IM2507	6	7,547,280.00	37,880.00
IM2508	IM2508	4	4,979,520.00	21,800.00
IM2509	IM2509	1	1,231,120.00	56,633.33
IM2512	IM2512	13	15,547,480.00	905,524.29
合计				1,021,837.62
减：可抵销期货暂收款				1,021,837.62
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	3,610.11
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	90,874.70
合计	176,307.67

6.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 1000 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	631,555,556.91	631,555,556.91
本期申购	329,494,847.57	329,494,847.57
本期赎回(以“-”号填列)	-302,075,298.68	-302,075,298.68
本期末	658,975,105.80	658,975,105.80

国泰君安中证 1000 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	598,704,665.49	598,704,665.49
本期申购	588,581,178.08	588,581,178.08
本期赎回(以“-”号填列)	-645,579,001.56	-645,579,001.56
本期末	541,706,842.01	541,706,842.01

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

国泰君安中证 1000 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	34,769,191.13	-653,239.38	34,115,951.75
本期期初	34,769,191.13	-653,239.38	34,115,951.75
本期利润	45,800,772.87	42,250,981.13	88,051,754.00

本期基金份额交易产生的变动数	933,022.92	3,597,516.95	4,530,539.87
其中：基金申购款	24,216,736.45	15,058,111.24	39,274,847.69
基金赎回款	-23,283,713.53	-11,460,594.29	-34,744,307.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	81,502,986.92	45,195,258.70	126,698,245.62

国泰君安中证 1000 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	27,084,967.81	-701,257.67	26,383,710.14
本期期初	27,084,967.81	-701,257.67	26,383,710.14
本期利润	43,616,830.79	41,181,904.63	84,798,735.42
本期基金份额交易产生的变动数	-10,588,372.12	-3,801,487.23	-14,389,859.35
其中：基金申购款	35,248,337.92	21,585,168.60	56,833,506.52
基金赎回款	-45,836,710.04	-25,386,655.83	-71,223,365.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,113,426.48	36,679,159.73	96,792,586.21

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	126,495.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	30,912.24
结算备付金利息收入	54,832.13
其他	-
合计	212,240.04

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	7,627,700,199.47
减：卖出股票成本总额	7,533,263,697.42
减：交易费用	5,871,711.86
买卖股票差价收入	88,564,790.19

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	-31,193.67
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	54,420.76
减：交易费用	66,555.01
合计	-152,169.44

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	8,744,671.62
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	8,744,671.62

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	81,801,092.09
——股票投资	81,801,092.09
——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	1,631,793.67
——权证投资	-
——期货投资	1,631,793.67
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	83,432,885.76

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	1,431,019.99
转换费收入	11,043.65
合计	1,442,063.64

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	6,731.45
证券账户开户费	400.00
合计	88,954.31

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	基金管理人

(以下简称“国泰海通资管”)	
中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)	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、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	15,196,016,534.61	100.00%	10,263,698,145.54	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	1,083,262.64	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 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	768,482.43	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管理费用管理规定》，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	6,959,671.99	4,446,281.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,966,177.56	1,220,308.08
应支付基金管理人的净管理费	4,993,494.43	3,225,973.03

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

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	1,043,950.78	666,942.10

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

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 1000 指数 增强 A	国泰君安中证 1000 指数 增强 C	合计

国泰海通证券	-	175,246.92	175,246.92
国泰海通资管	-	288,158.59	288,158.59
合计	-	463,405.51	463,405.51
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			
名称	国泰君安中证 1000 指数 增强 A	国泰君安中证 1000 指数 增强 C	合计
国泰海通证券	-	247,109.38	247,109.38
国泰海通资管	-	585,752.31	585,752.31
合计	-	832,861.69	832,861.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40%/ 当年天数。

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

国泰君安中证 1000 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	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	12,418,753.88	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,418,753.88	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.88%	-

国泰君安中证 1000 指数增强 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	0.00	8,314,279.78
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-

减： 报告期间赎回/卖出总份额	-	8,314,279.78
报告期末持有的基金份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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，本基金本报告期内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	63,812,107.33	30,912.24	22,239,508.12	26,718.17
农业银行	31,010,818.67	126,495.67	28,008,509.48	130,958.40

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国农业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	钧崴电子	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	-
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	1-6个月	科创板打	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

		月 18 日	(含)	新限 售						
68875 8	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	13,185.6 9	-
60307 2	天和 磁材	2024 年 12 月 24 日	1-6 个 月 (含)	主 板 打 新 限 售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.7 0	-
30166 2	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	11,797.5 0	-
30160 1	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	11,576.7 0	-
00135 6	富岭 股份	2025 年 01 月 16 日	1-6 个 月 (含)	主 板 打 新 限 售	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.9 6	-
30159 0	优优 绿能	2025 年 05 月 28 日	1-6 个 月 (含)	创 业 板 打 新 限 售	89.60	139.4 8	73	6,540.80	10,182.0 4	-
30166 5	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	-
00138 2	新亚 电缆	2025 年 03 月 13 日	1-6 个 月 (含)	主 板 打 新 限 售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
60301 4	威高 血净	2025 年 05 月 12 日	1-6 个 月 (含)	主 板 打 新 限 售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
30163 6	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	-
30159 5	太力 科技	2025 年 05	1-6 个 月	创 业 板 打	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

		月 12 日	(含)	新限 售						
30156 0	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	-
60321 0	泰鸿 万立	2025 年 04 月 01 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
60327 1	永杰 新材	2025 年 03 月 04 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
60312 4	江南 新材	2025 年 03 月 12 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
00139 0	古麒 绒材	2025 年 05 月 21 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
60340 0	华之 杰	2025 年 06 月 12 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
60338 2	海阳 科技	2025 年 06 月 05 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
60312 0	肯特 催化	2025 年 04 月 09 日	1-6 个 月 (含)	主板 打新 限售	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中国农业银行股份有限公司，其他银行存款为国泰海通证券股份有限公司保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2025 年 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	94,822,926.00	-	-	-	94,822,926.00
结算备付金	9,767,751.28	-	-	-	9,767,751.28
存出保证金	3,516,648.00	-	-	-	3,516,648.00
交易性金融 资产	-	-	-	1,315,385,508.8 2	1,315,385,508.8 2
应收申购款	-	-	-	14,476,621.62	14,476,621.62
资产总计	108,107,325.2 8	-	-	1,329,862,130.4 4	1,437,969,455.7 2
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,106,737.93	12,106,737.93
应付管理人 报酬	-	-	-	1,141,912.93	1,141,912.93
应付托管费	-	-	-	171,286.92	171,286.92
应付销售服 务费	-	-	-	200,430.63	200,430.63
其他负债	-	-	-	176,307.67	176,307.67
负债总计	-	-	-	13,796,676.08	13,796,676.08
利率敏感度 缺口	108,107,325.2 8	-	-	1,316,065,454.3 6	1,424,172,779.6 4
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2024 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	77,728,427.14	-	-	-	77,728,427.14
结算备付金	12,901,926.96	-	-	-	12,901,926.96
存出保证金	2,793,595.20	-	-	-	2,793,595.20
交易性金融 资产	-	-	-	1,197,427,161.2 7	1,197,427,161.2 7
应收申购款	-	-	-	8,955,010.50	8,955,010.50
资产总计	93,423,949.30	-	-	1,206,382,171.7 7	1,299,806,121.0 7
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,451,079.73	7,451,079.73
应付管理人 报酬	-	-	-	1,061,121.20	1,061,121.20
应付托管费	-	-	-	159,168.21	159,168.21
应付销售服 务费	-	-	-	209,367.51	209,367.51
其他负债	-	-	-	165,500.13	165,500.13
负债总计	-	-	-	9,046,236.78	9,046,236.78
利率敏感度 缺口	93,423,949.30	-	-	1,197,335,934.9 9	1,290,759,884.2 9

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	1,315,385,508.82	92.36	1,197,427,161.27	92.77
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	1,315,385,508.82	92.36	1,197,427,161.27	92.77

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%	70,847,341.88	64,279,055.76
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-70,847,341.88	-64,279,055.76

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	1,315,096,245.39	1,196,885,858.24
第二层次	15,385.54	27,736.50
第三层次	273,877.89	513,566.53
合计	1,315,385,508.82	1,197,427,161.27

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	1,315,385,508.82	91.48
	其中：股票	1,315,385,508.82	91.48
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	104,590,677.28	7.27
8	其他各项资产	17,993,269.62	1.25
9	合计	1,437,969,455.72	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	-	-
B	采矿业	12,101,863.00	0.85
C	制造业	777,788,579.64	54.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,116,377.72	1.90
E	建筑业	9,757,743.00	0.69
F	批发和零售业	34,582,538.60	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	29,486,342.34	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	145,807,304.15	10.24
J	金融业	19,164,999.37	1.35
K	房地产业	3,855,960.00	0.27
L	租赁和商务服务业	8,586,416.00	0.60

M	科学研究和技术服务业	4,696,845.55	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	6,721,599.89	0.47
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	6,807,451.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	1,086,474,020.26	76.29

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	6,888,780.00	0.48
B	采矿业	3,019,005.00	0.21
C	制造业	164,364,741.61	11.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,226,937.00	0.16
E	建筑业	989,235.00	0.07
F	批发和零售业	4,253,460.50	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,120,894.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,228,418.97	2.33
J	金融业	2,401,714.00	0.17
K	房地产业	182,970.00	0.01
L	租赁和商务服务业	952,150.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	4,299,562.48	0.30
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,983,620.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	228,911,488.56	16.07

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	002249	大洋电机	2,280,300	15,004,374.00	1.05
2	600267	海正药业	1,553,100	14,366,175.00	1.01
3	002151	北斗星通	496,800	14,253,192.00	1.00
4	300102	乾照光电	1,227,500	14,202,175.00	1.00
5	000901	航天科技	1,123,353	13,963,277.79	0.98
6	601678	滨化股份	3,245,900	13,438,026.00	0.94
7	600320	振华重工	3,034,900	13,262,513.00	0.93
8	300257	开山股份	1,308,138	13,172,949.66	0.92
9	688343	云天励飞	263,805	13,037,243.10	0.92
10	300570	太辰光	130,600	12,587,228.00	0.88
11	600812	华北制药	2,003,800	12,383,484.00	0.87
12	600550	保变电气	1,429,700	12,295,420.00	0.86
13	002378	章源钨业	1,548,890	12,251,719.90	0.86
14	000930	中粮科技	2,155,351	12,026,858.58	0.84
15	002434	万里扬	1,568,100	11,494,173.00	0.81
16	300768	迪普科技	664,200	11,391,030.00	0.80
17	300548	博创科技	162,600	10,856,802.00	0.76
18	002258	利尔化学	983,400	10,856,736.00	0.76
19	301526	国际复材	2,896,421	10,542,972.44	0.74
20	002204	大连重工	1,752,700	10,463,619.0	0.73

				0	
21	300113	顺网科技	522,664	10,327,840.64	0.73
22	600635	大众公用	2,641,100	10,300,290.00	0.72
23	300456	赛微电子	585,508	10,064,882.52	0.71
24	300009	安科生物	1,162,500	9,730,125.00	0.68
25	002761	浙江建投	1,071,700	9,505,979.00	0.67
26	600389	江山股份	504,500	9,383,700.00	0.66
27	603267	鸿远电子	186,600	9,380,382.00	0.66
28	002174	游族网络	771,300	9,355,869.00	0.66
29	002881	美格智能	199,700	9,266,080.00	0.65
30	300039	上海凯宝	1,510,600	9,154,236.00	0.64
31	600216	浙江医药	595,900	8,813,361.00	0.62
32	600717	天津港	1,914,522	8,730,220.32	0.61
33	600601	方正科技	1,625,100	8,678,034.00	0.61
34	300026	红日药业	2,334,100	8,612,829.00	0.60
35	002777	久远银海	469,900	8,580,374.00	0.60
36	300224	正海磁材	592,300	8,381,045.00	0.59
37	002815	崇达技术	736,300	8,342,279.00	0.59
38	601326	秦港股份	2,507,000	8,097,610.00	0.57
39	688209	英集芯	433,069	7,998,784.43	0.56
40	300393	中来股份	1,375,899	7,925,178.24	0.56
41	300101	振芯科技	346,800	7,848,084.00	0.55
42	002004	华邦健康	1,838,568	7,666,828.56	0.54
43	002626	金达威	374,700	7,666,362.00	0.54
44	601126	四方股份	468,400	7,620,868.00	0.54
45	000990	诚志股份	1,007,700	7,618,212.00	0.53
46	300602	飞荣达	357,300	7,578,333.00	0.53
47	600531	豫光金铅	957,700	7,412,598.00	0.52
48	002489	浙江永强	2,000,100	7,320,366.00	0.51
49	301558	三态股份	795,600	7,168,356.00	0.50
50	600746	江苏索普	916,900	7,160,989.00	0.50
51	600338	西藏珠峰	640,800	7,106,472.00	0.50
52	002275	桂林三金	480,300	6,873,093.00	0.48
53	300170	汉得信息	396,100	6,816,881.00	0.48
54	688400	凌云光	247,033	6,810,699.81	0.48
55	603118	共进股份	601,500	6,778,905.00	0.48
56	002611	东方精工	553,300	6,672,798.00	0.47
57	688380	中微半导	245,365	6,649,391.50	0.47
58	301069	凯盛新材	402,500	6,484,275.00	0.46
59	600305	恒顺醋业	832,974	6,438,889.02	0.45

60	603456	九洲药业	420,700	6,398,847.00	0.45
61	300088	长信科技	1,067,200	6,360,512.00	0.45
62	603013	亚普股份	368,029	6,359,541.12	0.45
63	688018	乐鑫科技	42,546	6,215,970.60	0.44
64	688403	汇成股份	577,368	5,998,853.52	0.42
65	600640	国脉文化	494,100	5,988,492.00	0.42
66	000019	深粮控股	880,100	5,861,466.00	0.41
67	300184	力源信息	595,580	5,848,595.60	0.41
68	600557	康缘药业	395,600	5,846,968.00	0.41
69	301316	慧博云通	135,300	5,828,724.00	0.41
70	002706	良信股份	647,900	5,772,789.00	0.41
71	603083	剑桥科技	121,600	5,751,680.00	0.40
72	601519	大智慧	553,900	5,644,241.00	0.40
73	688208	道通科技	182,590	5,587,254.00	0.39
74	600458	时代新材	398,600	5,468,792.00	0.38
75	600335	国机汽车	840,500	5,421,225.00	0.38
76	002351	漫步者	405,700	5,322,784.00	0.37
77	688502	茂莱光学	18,239	5,246,630.74	0.37
78	002396	星网锐捷	230,000	5,163,500.00	0.36
79	002243	力合科创	624,100	5,092,656.00	0.36
80	002913	奥士康	171,300	5,037,933.00	0.35
81	600780	通宝能源	845,700	5,015,001.00	0.35
82	300598	诚迈科技	117,200	4,986,860.00	0.35
83	002649	博彦科技	336,500	4,889,345.00	0.34
84	002079	苏州固锝	501,404	4,888,689.00	0.34
85	002239	奥特佳	1,684,020	4,883,658.00	0.34
86	300185	通裕重工	1,690,010	4,833,428.60	0.34
87	601101	昊华能源	661,000	4,785,640.00	0.34
88	000756	新华制药	320,700	4,784,844.00	0.34
89	301171	易点天下	177,000	4,731,210.00	0.33
90	600006	东风股份	651,000	4,706,730.00	0.33
91	688321	微芯生物	196,170	4,664,922.60	0.33
92	300634	彩讯股份	169,300	4,588,030.00	0.32
93	601107	四川成渝	761,400	4,583,628.00	0.32
94	300624	万兴科技	72,600	4,504,830.00	0.32
95	300925	法本信息	178,300	4,489,594.00	0.32
96	300079	数码视讯	752,800	4,403,880.00	0.31
97	002681	奋达科技	644,300	4,361,911.00	0.31
98	600597	光明乳业	517,000	4,347,970.00	0.31
99	000030	富奥股份	728,700	4,292,043.00	0.30
100	603027	千禾味业	365,300	4,241,133.00	0.30
101	002901	大博医疗	115,300	4,178,472.00	0.29
102	300232	洲明科技	573,100	4,149,244.00	0.29

103	688322	奥比中光	68,317	4,031,386.17	0.28
104	688549	中巨芯	519,003	4,017,083.22	0.28
105	600874	创业环保	668,496	3,990,921.12	0.28
106	688584	上海合晶	219,490	3,924,481.20	0.28
107	600961	株冶集团	350,700	3,920,826.00	0.28
108	600728	佳都科技	716,300	3,903,835.00	0.27
109	600420	国药现代	350,900	3,737,085.00	0.26
110	000686	东北证券	484,700	3,698,261.00	0.26
111	688523	航天环宇	170,397	3,665,239.47	0.26
112	600063	皖维高新	786,500	3,602,170.00	0.25
113	600315	上海家化	169,700	3,575,579.00	0.25
114	002245	蔚蓝锂芯	277,600	3,561,608.00	0.25
115	002267	陕天然气	468,400	3,545,788.00	0.25
116	600675	中华企业	1,167,700	3,362,976.00	0.24
117	603766	隆鑫通用	260,950	3,329,722.00	0.23
118	603881	数据港	130,300	3,329,165.00	0.23
119	002643	万润股份	285,200	3,282,652.00	0.23
120	000058	深赛格	390,600	3,245,886.00	0.23
121	601609	金田股份	438,200	3,071,782.00	0.22
122	300821	东岳硅材	390,700	3,070,902.00	0.22
123	300133	华策影视	408,800	3,070,088.00	0.22
124	688252	天德钰	122,702	2,991,474.76	0.21
125	300655	晶瑞电材	298,590	2,988,885.90	0.21
126	000550	江铃汽车	143,000	2,907,190.00	0.20
127	002215	诺普信	278,500	2,876,905.00	0.20
128	000935	四川双马	157,800	2,875,116.00	0.20
129	603229	奥翔药业	323,748	2,823,082.56	0.20
130	300045	华力创通	147,500	2,815,775.00	0.20
131	300363	博腾股份	162,800	2,780,624.00	0.20
132	600596	新安股份	343,000	2,778,300.00	0.20
133	688146	中船特气	95,916	2,772,931.56	0.19
134	603888	新华网	114,500	2,741,130.00	0.19
135	601949	中国出版	412,400	2,738,336.00	0.19
136	600100	同方股份	376,300	2,724,412.00	0.19
137	600388	龙净环保	226,500	2,718,000.00	0.19
138	002045	国光电器	167,600	2,674,896.00	0.19
139	000767	晋控电力	933,100	2,668,666.00	0.19
140	301297	富乐德	64,500	2,665,785.00	0.19
141	688327	云从科技	191,409	2,639,530.11	0.19
142	000681	视觉中国	129,800	2,614,172.00	0.18
143	002332	仙琚制药	282,600	2,591,442.00	0.18
144	600125	铁龙物流	449,900	2,546,434.00	0.18
145	600621	华鑫股份	163,700	2,506,247.00	0.18

146	688270	臻镭科技	52,976	2,466,562.56	0.17
147	000597	东北制药	476,200	2,457,192.00	0.17
148	600623	华谊集团	323,100	2,445,867.00	0.17
149	002588	史丹利	273,900	2,413,059.00	0.17
150	002324	普利特	226,300	2,405,569.00	0.17
151	600662	外服控股	465,700	2,379,727.00	0.17
152	688141	杰华特	72,599	2,365,275.42	0.17
153	300493	润欣科技	110,800	2,356,716.00	0.17
154	002698	博实股份	151,343	2,351,870.22	0.17
155	002518	科士达	101,200	2,286,108.00	0.16
156	603588	高能环境	404,900	2,283,636.00	0.16
157	001287	中电港	122,200	2,237,482.00	0.16
158	688306	均普智能	221,799	2,182,502.16	0.15
159	601860	紫金银行	677,800	2,033,400.00	0.14
160	600682	南京新百	299,800	2,014,656.00	0.14
161	301376	致欧科技	107,400	1,960,050.00	0.14
162	600169	太原重工	808,300	1,956,086.00	0.14
163	600075	新疆天业	452,500	1,914,075.00	0.13
164	600783	鲁信创投	152,900	1,911,250.00	0.13
165	605020	永和股份	82,900	1,910,016.00	0.13
166	000969	安泰科技	143,038	1,842,329.44	0.13
167	300953	震裕科技	17,700	1,793,895.00	0.13
168	002747	埃斯顿	87,000	1,760,880.00	0.12
169	600459	贵研铂业	113,000	1,752,630.00	0.12
170	603583	捷昌驱动	47,700	1,742,004.00	0.12
171	300236	上海新阳	44,600	1,730,480.00	0.12
172	002242	九阳股份	181,300	1,722,350.00	0.12
173	301339	通行宝	100,260	1,717,453.80	0.12
174	601369	陕鼓动力	195,300	1,712,781.00	0.12
175	301029	怡合达	74,300	1,698,498.00	0.12
176	688586	江航装备	150,924	1,697,895.00	0.12
177	600987	航民股份	238,900	1,689,023.00	0.12
178	688443	智翔金泰	60,246	1,671,224.04	0.12
179	000682	东方电子	159,900	1,637,376.00	0.11
180	688279	峰昭科技	8,824	1,636,852.00	0.11
181	300738	奥飞数据	78,000	1,632,540.00	0.11
182	300705	九典制药	104,300	1,623,951.00	0.11
183	688522	纳睿雷达	31,618	1,619,473.96	0.11
184	002100	天康生物	258,800	1,601,972.00	0.11
185	301205	联特科技	16,500	1,581,690.00	0.11
186	002839	张家港行	350,800	1,578,600.00	0.11
187	600330	天通股份	217,500	1,559,475.00	0.11
188	601200	上海环境	192,800	1,530,832.00	0.11

189	000737	北方铜业	140,400	1,524,744.00	0.11
190	002399	海普瑞	127,800	1,522,098.00	0.11
191	301175	中科环保	290,217	1,500,421.89	0.11
192	688128	中国电研	61,186	1,499,057.00	0.11
193	300913	兆龙互连	31,620	1,480,448.40	0.10
194	600020	中原高速	304,800	1,456,944.00	0.10
195	688336	三生国健	26,100	1,415,664.00	0.10
196	002073	软控股份	157,800	1,402,842.00	0.10
197	002468	申通快递	128,500	1,373,665.00	0.10
198	688131	皓元医药	27,733	1,340,890.55	0.09
199	600929	雪天盐业	262,200	1,326,732.00	0.09
200	688362	甬矽电子	44,414	1,322,648.92	0.09
201	300755	华致酒行	68,400	1,320,120.00	0.09
202	002545	东方铁塔	145,900	1,297,051.00	0.09
203	603328	依顿电子	127,288	1,248,695.28	0.09
204	601187	厦门银行	183,703	1,247,343.37	0.09
205	600269	赣粤高速	241,967	1,224,353.02	0.09
206	600572	康恩贝	279,100	1,222,458.00	0.09
207	300151	昌红科技	96,200	1,184,222.00	0.08
208	002010	传化智联	204,600	1,141,668.00	0.08
209	002038	双鹭药业	159,700	1,132,273.00	0.08
210	300770	新媒股份	28,200	1,127,718.00	0.08
211	300034	钢研高纳	67,100	1,115,873.00	0.08
212	300672	国科微	13,100	1,112,452.00	0.08
213	000657	中钨高新	91,700	1,087,562.00	0.08
214	000829	天音控股	106,300	1,085,323.00	0.08
215	600963	岳阳林纸	243,600	1,079,148.00	0.08
216	688347	华虹公司	19,100	1,048,781.00	0.07
217	600475	华光环能	95,500	995,110.00	0.07
218	688165	埃夫特	38,800	990,176.00	0.07
219	688351	微电生理	50,099	986,950.30	0.07
220	002701	奥瑞金	165,300	983,535.00	0.07
221	002216	三全食品	88,400	978,588.00	0.07
222	002511	中顺洁柔	137,335	922,891.20	0.06
223	000059	华锦股份	163,600	881,804.00	0.06
224	600771	广誉远	43,000	866,880.00	0.06
225	000913	钱江摩托	55,400	831,000.00	0.06
226	000810	创维数字	70,400	829,312.00	0.06
227	002539	云图控股	85,100	798,238.00	0.06
228	001339	智微智能	16,400	792,612.00	0.06
229	000600	建投能源	114,000	787,740.00	0.06
230	603444	吉比特	2,500	754,875.00	0.05
231	301381	赛维时代	37,700	752,115.00	0.05

232	000676	智度股份	77,400	705,888.00	0.05
233	002315	焦点科技	15,200	694,488.00	0.05
234	600114	东睦股份	33,600	683,424.00	0.05
235	605577	龙版传媒	52,200	671,292.00	0.05
236	300296	利亚德	109,400	667,340.00	0.05
237	603876	鼎胜新材	73,100	664,479.00	0.05
238	000061	农产品	102,600	655,614.00	0.05
239	300303	聚飞光电	100,900	639,706.00	0.04
240	688088	虹软科技	12,979	626,236.75	0.04
241	600664	哈药股份	166,800	613,824.00	0.04
242	002635	安洁科技	44,300	599,822.00	0.04
243	603056	德邦股份	37,400	595,408.00	0.04
244	300119	瑞普生物	29,900	580,658.00	0.04
245	600059	古越龙山	53,000	578,230.00	0.04
246	601311	骆驼股份	62,900	567,987.00	0.04
247	000848	承德露露	62,200	567,886.00	0.04
248	003039	顺控发展	40,700	551,892.00	0.04
249	002727	一心堂	33,600	549,024.00	0.04
250	002946	新乳业	29,100	546,207.00	0.04
251	600602	云赛智联	26,700	538,539.00	0.04
252	688062	迈威生物	19,000	537,320.00	0.04
253	600966	博汇纸业	118,700	524,654.00	0.04
254	688127	蓝特光学	19,608	504,121.68	0.04
255	300660	江苏雷利	9,900	437,976.00	0.03
256	600864	哈投股份	73,100	436,407.00	0.03
257	600986	浙文互联	52,900	432,193.00	0.03
258	300401	花园生物	28,400	431,964.00	0.03
259	300226	上海钢联	18,900	431,676.00	0.03
260	002534	西子洁能	37,200	418,128.00	0.03
261	601827	三峰环境	49,000	411,600.00	0.03
262	603678	火炬电子	10,800	410,724.00	0.03
263	601083	锦江航运	36,200	402,182.00	0.03
264	000837	秦川机床	33,000	396,660.00	0.03
265	300641	正丹股份	16,700	380,593.00	0.03
266	600273	嘉化能源	42,800	362,088.00	0.03
267	300725	药石科技	9,100	352,170.00	0.02
268	300319	麦捷科技	32,000	343,680.00	0.02
269	301508	中机认检	10,000	338,000.00	0.02
270	300772	运达股份	25,600	329,728.00	0.02
271	300183	东软载波	19,600	329,476.00	0.02
272	002145	中核钛白	78,175	324,426.25	0.02
273	002516	旷达科技	61,400	316,210.00	0.02
274	600073	光明肉业	42,805	315,900.90	0.02

275	300415	伊之密	14,800	298,220.00	0.02
276	600641	万业企业	21,300	295,644.00	0.02
277	688629	华丰科技	5,152	294,694.40	0.02
278	002139	拓邦股份	21,100	291,391.00	0.02
279	688001	华兴源创	11,427	288,760.29	0.02
280	000420	吉林化纤	71,000	276,900.00	0.02
281	603636	南威软件	21,700	274,288.00	0.02
282	002993	奥海科技	6,500	269,555.00	0.02
283	601208	东材科技	28,200	267,336.00	0.02
284	603171	税友股份	6,200	266,042.00	0.02
285	000557	西部创业	50,800	259,080.00	0.02
286	300593	新雷能	19,300	258,620.00	0.02
287	301090	华润材料	34,300	258,279.00	0.02
288	688266	泽璟制药	2,400	258,024.00	0.02
289	002941	新疆交建	22,600	251,764.00	0.02
290	601801	皖新传媒	36,000	245,880.00	0.02
291	603025	大豪科技	16,800	235,536.00	0.02
292	000758	中色股份	41,700	209,751.00	0.01
293	600866	星湖科技	29,200	201,772.00	0.01
294	600649	城投控股	46,000	197,340.00	0.01
295	300620	光库科技	4,100	193,151.00	0.01
296	600179	安通控股	69,200	190,992.00	0.01
297	600252	中恒集团	71,800	181,654.00	0.01
298	300357	我武生物	8,700	179,568.00	0.01
299	688192	迪哲医药	2,900	173,420.00	0.01
300	002745	木林森	22,000	173,360.00	0.01
301	300229	拓尔思	8,400	154,896.00	0.01
302	603063	禾望电气	4,400	148,984.00	0.01
303	600718	东软集团	15,100	147,225.00	0.01
304	601089	福元医药	8,100	135,108.00	0.01
305	000690	宝新能源	28,400	129,220.00	0.01
306	600835	上海机电	6,000	127,500.00	0.01
307	601619	嘉泽新能	35,400	126,732.00	0.01
308	002807	江阴银行	23,000	109,250.00	0.01
309	688690	纳微科技	4,000	91,320.00	0.01
310	002597	金禾实业	3,800	89,490.00	0.01
311	603103	横店影视	5,100	81,855.00	0.01
312	600933	爱柯迪	5,000	80,050.00	0.01
313	300080	易成新能	16,400	68,552.00	0.00
314	002011	盾安环境	3,700	42,920.00	0.00
315	688717	艾罗能源	622	33,482.26	0.00
316	600869	远东股份	5,900	29,972.00	0.00
317	000927	中国铁物	10,100	25,957.00	0.00

318	600575	淮河能源	7,400	25,826.00	0.00
319	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
320	301015	百洋医药	1,100	22,066.00	0.00
321	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
322	688190	云路股份	144	13,328.64	0.00
323	002487	大金重工	400	13,160.00	0.00
324	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
325	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
326	688798	艾为电子	113	7,706.60	0.00
327	688185	康希诺	116	6,917.08	0.00
328	688177	百奥泰	102	2,556.12	0.00
329	301087	可孚医疗	50	1,660.00	0.00
330	300579	数字认证	47	1,621.97	0.00
331	688048	长光华芯	14	808.36	0.00
332	002428	云南锗业	27	537.30	0.00
333	300432	富临精工	20	261.40	0.00
334	603730	岱美股份	40	227.60	0.00
335	000791	甘肃能源	20	127.60	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	002786	银宝山新	866,800	7,991,896.00	0.56
2	688280	精进电动	1,047,730	7,616,997.10	0.53
3	600410	华胜天成	629,500	6,036,905.00	0.42
4	600619	海立股份	527,700	6,021,057.00	0.42
5	002414	高德红外	577,666	5,921,076.50	0.42
6	000919	金陵药业	806,600	5,492,946.00	0.39
7	688365	光云科技	343,236	5,224,051.92	0.37
8	603687	大胜达	635,000	4,718,050.00	0.33
9	002772	众兴菌业	579,600	4,526,676.00	0.32
10	002107	沃华医药	762,200	4,359,784.00	0.31
11	002349	精华制药	568,600	4,088,234.00	0.29
12	600703	三安光电	325,000	4,036,500.00	0.28
13	000063	中兴通讯	123,600	4,015,764.00	0.28
14	301260	格力博	197,100	3,886,812.00	0.27
15	002686	亿利达	589,900	3,840,249.00	0.27
16	600460	士兰微	144,400	3,584,008.00	0.25
17	002455	百川股份	473,600	3,542,528.00	0.25
18	300424	航新科技	199,300	3,451,876.00	0.24
19	300251	光线传媒	168,800	3,421,576.00	0.24

20	688512	慧智微	310,102	3,383,212.82	0.24
21	601600	中国铝业	470,200	3,310,208.00	0.23
22	603189	网达软件	184,300	3,201,291.00	0.22
23	688661	和林微纳	79,919	3,178,378.63	0.22
24	300231	银信科技	256,000	3,151,360.00	0.22
25	300512	中亚股份	363,100	3,115,398.00	0.22
26	601857	中国石油	353,100	3,019,005.00	0.21
27	002661	克明食品	299,800	3,000,998.00	0.21
28	002783	凯龙股份	337,700	2,914,351.00	0.20
29	600521	华海药业	151,900	2,829,897.00	0.20
30	002625	光启技术	69,100	2,762,618.00	0.19
31	300562	乐心医疗	184,400	2,719,900.00	0.19
32	603901	永创智能	254,000	2,677,160.00	0.19
33	002825	纳尔股份	255,160	2,546,496.80	0.18
34	300746	汉嘉设计	152,900	2,395,943.00	0.17
35	300489	光智科技	53,800	2,375,808.00	0.17
36	600354	敦煌种业	381,600	2,362,104.00	0.17
37	002885	京泉华	158,000	2,235,700.00	0.16
38	002523	天桥起重	611,100	2,230,515.00	0.16
39	300830	金现代	231,500	2,113,595.00	0.15
40	300306	远方信息	156,100	2,016,812.00	0.14
41	601698	中国卫通	96,000	1,965,120.00	0.14
42	600396	华电辽能	659,500	1,945,525.00	0.14
43	300043	星辉娱乐	400,500	1,938,420.00	0.14
44	002823	凯中精密	137,000	1,922,110.00	0.13
45	688382	益方生物	56,704	1,861,025.28	0.13
46	601116	三江购物	164,500	1,791,405.00	0.13
47	002329	皇氏集团	496,500	1,747,680.00	0.12
48	688256	寒武纪	2,777	1,670,365.50	0.12
49	600189	泉阳泉	225,100	1,629,724.00	0.11
50	002722	物产金轮	95,700	1,539,813.00	0.11
51	300351	永贵电器	94,600	1,506,032.00	0.11
52	688158	优刻得	64,474	1,458,401.88	0.10
53	300407	凯发电气	137,300	1,451,261.00	0.10
54	300817	双飞集团	61,300	1,449,132.00	0.10
55	688593	新相微	88,307	1,442,053.31	0.10
56	688201	信安世纪	108,500	1,405,075.00	0.10
57	002491	通鼎互联	241,100	1,369,448.00	0.10
58	600613	神奇制药	203,200	1,312,672.00	0.09
59	600628	新世界	175,300	1,283,196.00	0.09
60	600268	国电南自	163,900	1,281,698.00	0.09
61	688590	新致软件	61,534	1,263,908.36	0.09
62	300891	惠云钛业	117,300	1,128,426.00	0.08

63	688033	天宜新材	174,800	1,120,468.00	0.08
64	300739	明阳电路	74,400	1,104,096.00	0.08
65	688079	美迪凯	109,119	1,095,554.76	0.08
66	300399	天利科技	29,400	1,076,040.00	0.08
67	002931	锋龙股份	64,000	1,020,800.00	0.07
68	601186	中国铁建	123,500	989,235.00	0.07
69	000783	长江证券	141,700	981,981.00	0.07
70	300222	科大智能	93,200	949,708.00	0.07
71	600819	耀皮玻璃	153,900	895,698.00	0.06
72	688716	中研股份	25,000	890,000.00	0.06
73	002386	天原股份	177,840	882,086.40	0.06
74	301256	华融化学	82,700	875,793.00	0.06
75	003016	欣贺股份	113,300	849,750.00	0.06
76	688176	亚虹医药	92,313	818,816.31	0.06
77	002201	九鼎新材	124,400	814,820.00	0.06
78	300805	电声股份	73,800	811,800.00	0.06
79	688222	成都先导	50,049	804,787.92	0.06
80	688334	西高院	43,725	751,195.50	0.05
81	600959	江苏有线	216,700	745,448.00	0.05
82	002228	合兴包装	208,900	737,417.00	0.05
83	688602	康鹏科技	86,283	723,051.54	0.05
84	002953	日丰股份	68,600	712,068.00	0.05
85	000878	云南铜业	55,800	709,776.00	0.05
86	600106	重庆路桥	110,600	677,978.00	0.05
87	603386	骏亚科技	53,340	674,751.00	0.05
88	301025	读客文化	60,500	665,500.00	0.05
89	003025	思进智能	47,620	644,774.80	0.05
90	603858	步长制药	39,326	638,654.24	0.04
91	300968	格林精密	43,600	637,432.00	0.04
92	300735	光弘科技	25,300	635,030.00	0.04
93	300400	劲拓股份	37,500	631,500.00	0.04
94	301536	星宸科技	10,400	627,120.00	0.04
95	002593	日上集团	123,900	603,393.00	0.04
96	002403	爱仕达	42,700	598,654.00	0.04
97	603739	蔚蓝生物	44,800	596,736.00	0.04
98	600218	全柴动力	65,500	587,535.00	0.04
99	600262	北方股份	25,600	583,680.00	0.04
100	601997	贵阳银行	91,000	567,840.00	0.04
101	603101	汇嘉时代	74,601	559,507.50	0.04
102	601002	晋亿实业	110,100	542,793.00	0.04
103	300788	中信出版	16,000	513,280.00	0.04
104	300048	合康新能	84,300	494,841.00	0.03
105	601138	工业富联	22,800	487,464.00	0.03

106	002419	天虹股份	89,700	480,792.00	0.03
107	600699	均胜电子	26,600	463,904.00	0.03
108	002303	美盈森	129,600	461,376.00	0.03
109	301226	祥明智能	16,700	457,246.00	0.03
110	300434	金石亚药	43,800	421,356.00	0.03
111	600105	永鼎股份	49,800	402,882.00	0.03
112	000166	申万宏源	78,900	396,078.00	0.03
113	002905	金逸影视	41,300	383,264.00	0.03
114	300885	海昌新材	27,100	379,671.00	0.03
115	601018	宁波港	101,600	371,856.00	0.03
116	300382	斯莱克	22,700	345,267.00	0.02
117	600909	华安证券	58,600	341,638.00	0.02
118	301076	新瀚新材	9,800	340,844.00	0.02
119	300320	海达股份	33,100	329,014.00	0.02
120	600336	澳柯玛	48,100	328,042.00	0.02
121	600071	凤凰光学	15,300	326,808.00	0.02
122	000570	苏常柴 A	46,200	267,498.00	0.02
123	600050	中国联通	47,900	255,786.00	0.02
124	002603	以岭药业	17,420	245,622.00	0.02
125	002407	多氟多	19,600	238,924.00	0.02
126	002728	特一药业	28,000	235,480.00	0.02
127	300825	阿尔特	20,800	224,848.00	0.02
128	002624	完美世界	14,200	215,414.00	0.02
129	000421	南京公用	32,400	212,868.00	0.01
130	000823	超声电子	17,200	203,820.00	0.01
131	002395	双象股份	10,900	192,930.00	0.01
132	688015	交控科技	9,000	187,560.00	0.01
133	300703	创源股份	8,800	186,208.00	0.01
134	605218	伟时电子	8,200	183,516.00	0.01
135	600736	苏州高新	34,200	182,970.00	0.01
136	300964	本川智能	4,200	175,266.00	0.01
137	688183	生益电子	3,306	169,267.20	0.01
138	300771	智莱科技	13,000	165,490.00	0.01
139	300154	瑞凌股份	18,000	162,000.00	0.01
140	000045	深纺织 A	13,800	153,042.00	0.01
141	300153	科泰电源	4,500	152,325.00	0.01
142	300221	银禧科技	17,700	146,910.00	0.01
143	002131	利欧股份	40,100	140,350.00	0.01
144	000501	武商集团	16,000	138,560.00	0.01
145	002350	北京科锐	17,200	117,992.00	0.01
146	300539	横河精密	8,600	117,734.00	0.01
147	600668	尖峰集团	8,100	114,615.00	0.01
148	605055	迎丰股份	15,500	112,995.00	0.01

149	002660	茂硕电源	11,300	106,220.00	0.01
150	002782	可立克	8,000	103,840.00	0.01
151	300421	力星股份	6,500	97,370.00	0.01
152	688202	美迪西	2,700	97,011.00	0.01
153	301055	张小泉	4,300	90,644.00	0.01
154	300879	大叶股份	2,300	90,344.00	0.01
155	600016	民生银行	17,100	81,225.00	0.01
156	688571	杭华股份	10,100	77,871.00	0.01
157	601228	广州港	22,000	71,060.00	0.00
158	600742	富维股份	7,400	70,374.00	0.00
159	600011	华能国际	9,600	68,544.00	0.00
160	603500	祥和实业	7,400	67,784.00	0.00
161	300608	思特奇	5,600	65,184.00	0.00
162	300939	秋田微	2,100	63,840.00	0.00
163	688055	龙腾光电	16,700	61,790.00	0.00
164	002692	远程股份	10,700	52,858.00	0.00
165	301028	东亚机械	4,300	52,847.00	0.00
166	603396	金辰股份	1,900	48,450.00	0.00
167	688235	百济神州	149	34,812.36	0.00
168	300908	仲景食品	1,100	33,121.00	0.00
169	601628	中国人寿	800	32,952.00	0.00
170	688221	前沿生物	2,900	29,116.00	0.00
171	002666	德联集团	5,600	28,504.00	0.00
172	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
173	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
174	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
175	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
176	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
177	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
178	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
179	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
180	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
181	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
182	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
183	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
184	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
185	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
186	688396	华润微	132	6,225.12	0.00
187	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
188	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
189	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
190	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
191	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00

192	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
193	688676	金盘科技	109	3,646.05	0.00
194	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
195	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
196	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
197	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
198	688582	芯动联科	28	1,881.60	0.00
199	688410	山外山	125	1,775.00	0.00
200	688531	日联科技	20	1,432.00	0.00
201	301617	博苑股份	29	1,190.45	0.00
202	688135	利扬芯片	49	1,014.79	0.00
203	688428	诺诚健华	34	830.62	0.00
204	301216	万凯新材	50	623.50	0.00
205	688388	嘉元科技	30	602.40	0.00
206	688315	诺禾致源	21	296.52	0.00
207	688469	芯联集成	36	171.72	0.00
208	688585	上纬新材	21	163.38	0.00
209	688707	振华新材	7	94.85	0.00
210	688373	盟科药业	14	87.78	0.00
211	688261	东微半导	2	82.50	0.00
212	601727	上海电气	1	7.39	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	300113	顺网科技	35,392,429.00	2.74
2	300570	太辰光	35,379,349.98	2.74
3	600550	保变电气	34,984,051.08	2.71
4	600100	同方股份	32,456,992.00	2.51
5	688343	云天励飞	30,984,167.38	2.40
6	688280	精进电动	30,740,690.19	2.38
7	600006	东风股份	29,821,329.00	2.31

8	688327	云从科技	29,592,770.46	2.29
9	002258	利尔化学	28,178,671.36	2.18
10	300180	华峰超纤	28,058,903.00	2.17
11	002378	章源钨业	28,015,754.02	2.17
12	301297	富乐德	26,784,029.08	2.08
13	301526	国际复材	26,624,478.00	2.06
14	002402	和而泰	26,591,893.00	2.06
15	002312	川发龙蟒	26,473,629.00	2.05
16	600782	新钢股份	26,138,913.00	2.03
17	002626	金达威	26,090,654.00	2.02
18	002249	大洋电机	25,812,203.00	2.00
19	002901	大博医疗	25,787,753.59	2.00
20	600812	华北制药	25,644,581.00	1.99

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	002626	金达威	34,531,329.78	2.68
2	600100	同方股份	32,571,305.00	2.52
3	300180	华峰超纤	31,814,683.95	2.46
4	688327	云从科技	31,805,273.03	2.46
5	002396	星网锐捷	29,827,773.85	2.31

6	301297	富乐德	28,402,710.26	2.20
7	002402	和而泰	28,169,553.00	2.18
8	002773	康弘药业	28,046,621.14	2.17
9	688183	生益电子	27,855,504.99	2.16
10	002489	浙江永强	27,346,078.00	2.12
11	002015	协鑫能科	27,176,215.90	2.11
12	600782	新钢股份	26,798,323.00	2.08
13	002312	川发龙蟒	26,729,080.00	2.07
14	600006	东风股份	26,639,417.00	2.06
15	300113	顺网科技	26,627,488.17	2.06
16	600478	科力远	26,027,542.00	2.02
17	600550	保变电气	26,022,545.70	2.02
18	300570	太辰光	25,901,844.00	2.01
19	002097	山河智能	25,864,592.00	2.00
20	002249	大洋电机	25,827,194.85	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	7,569,420,952.88
卖出股票收入（成交）总额	7,627,700,199.47

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

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

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

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

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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公

开谴责、处罚的情况。

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	3,516,648.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,476,621.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,993,269.62

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 1000 指数增强 A	30,694	21,469.18	401,948,539.84	61.00%	257,026,565.96	39.00%
国泰君安中证 1000 指数增强 C	30,204	17,934.94	327,280,631.98	60.42%	214,426,210.03	39.58%
合计	60,898	19,716.28	729,229,171.82	60.73%	471,452,775.99	39.27%

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 1000 指数增强 A	2,677,292.54	0.4063%
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	587,354.71	0.1084%
	合计	3,264,647.25	0.2719%

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 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	>100

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 08 月 16 日）基金份额总额	332,110,120.07	277,282,091.55
本报告期期初基金份额总额	631,555,556.91	598,704,665.49
本报告期基金总申购份额	329,494,847.57	588,581,178.08
减：本报告期基金总赎回份额	302,075,298.68	645,579,001.56
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	658,975,105.80	541,706,842.01

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、报告期内本基金管理人员重大人事变动如下：

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、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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	15,196,016,534.61	100.00%	1,083,262.64	100.00%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

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 1000 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
2	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

3	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
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额、最低追加申购金额、最低赎回份额和最低持有限额的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-02-27
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 1000 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 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
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
13	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、关于准予国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

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以免费查阅。

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