

国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

| | |
|---------------------------------------|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| § 2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 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、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 11 |
| § 4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 16 |

| | |
|---|-----------|
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 16 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 17 |
| § 5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 17 |
| 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 | 17 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 17 |
| § 6 审计报告 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 18 |
| § 7 年度财务报表 | 19 |
| 7.1 资产负债表 | 19 |
| 7.2 利润表 | 21 |
| 7.3 净资产变动表 | 23 |
| 7.4 报表附注 | 24 |
| § 8 投资组合报告 | 55 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 55 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 55 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 57 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 76 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 87 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 87 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 88 |

| | |
|--|-----------|
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 88 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 88 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 88 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 88 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 88 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 89 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 89 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 90 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 90 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 90 |
| § 11 重大事件揭示 | 91 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 91 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 91 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 92 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 92 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 92 |
| 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 | 92 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 92 |
| 11.8 其他重大事件..... | 93 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 95 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 96 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 96 |

| | |
|-------------------|----|
| § 13 备查文件目录 | 96 |
| 13.1 备查文件目录..... | 96 |
| 13.2 存放地点 | 96 |
| 13.3 查阅方式..... | 96 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|--------------------|
| 基金名称 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国泰海通中证 1000 指数增强 | |
| 基金主代码 | 015867 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 08 月 16 日 | |
| 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 | 1,378,720,992.88 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015867 | 015868 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 704,044,432.55 份 | 674,676,560.33 份 |

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

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×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 | 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@gtht.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》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gthtzg.com |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|---|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26 |
| 注册登记机构 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司 | 上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2025 年 | | 2024 年 | | 2023 年 | |
|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C |
| 本期已实现收益 | 256,381,815.21 | 249,320,190.38 | 53,993,026.87 | 8,552,350.32 | 9,488,340.57 | 34,974,876.67 |
| 本期利润 | 293,290,956.75 | 280,347,269.70 | 37,643,348.17 | 13,603,266.11 | 14,005,967.62 | 39,926,248.80 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4150 | 0.4150 | 0.1022 | -0.0237 | 0.0517 | -0.0692 |
| 本期加权平均净值利润率 | 32.76% | 33.02% | 11.20% | -2.67% | 5.32% | -7.23% |
| 本期基金份额净值增长率 | 40.31% | 39.75% | 13.54% | 13.08% | 2.56% | 2.17% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末 | | 2024 年末 | | 2023 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 285,226,861.75 | 260,614,064.47 | 34,115,951.75 | 26,383,710.14 | 25,148,788.07 | 81,287,633.53 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4051 | 0.3863 | 0.0540 | 0.0441 | -0.0717 | -0.0767 |
| 期末基金资产净值 | 1,041,215,775.23 | 984,434,814.45 | 665,671,508.66 | 625,088,375.63 | 325,704,357.93 | 977,866,061.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.4789 | 1.4591 | 1.0540 | 1.0441 | 0.9283 | 0.9233 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2025 年末 | | 2024 年末 | | 2023 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 47.89% | 45.91% | 5.40% | 4.41% | -7.17% | -7.67% |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰海通中证 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.13% | 1.12% | 0.28% | 1.07% | 0.85% | 0.05% |
| 过去六个月 | 24.04% | 1.08% | 18.49% | 1.06% | 5.55% | 0.02% |
| 过去一年 | 40.31% | 1.35% | 26.12% | 1.32% | 14.19% | 0.03% |
| 过去三年 | 63.40% | 1.50% | 20.34% | 1.48% | 43.06% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.89% | 1.46% | 4.61% | 1.46% | 43.28% | 0.00% |

国泰海通中证 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.02% | 1.12% | 0.28% | 1.07% | 0.74% | 0.05% |
| 过去六个月 | 23.79% | 1.08% | 18.49% | 1.06% | 5.30% | 0.02% |
| 过去一年 | 39.75% | 1.35% | 26.12% | 1.32% | 13.63% | 0.03% |
| 过去三年 | 61.46% | 1.49% | 20.34% | 1.48% | 41.12% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.91% | 1.46% | 4.61% | 1.46% | 41.30% | 0.00% |

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

国泰海通中证1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月16日-2025年12月31日)

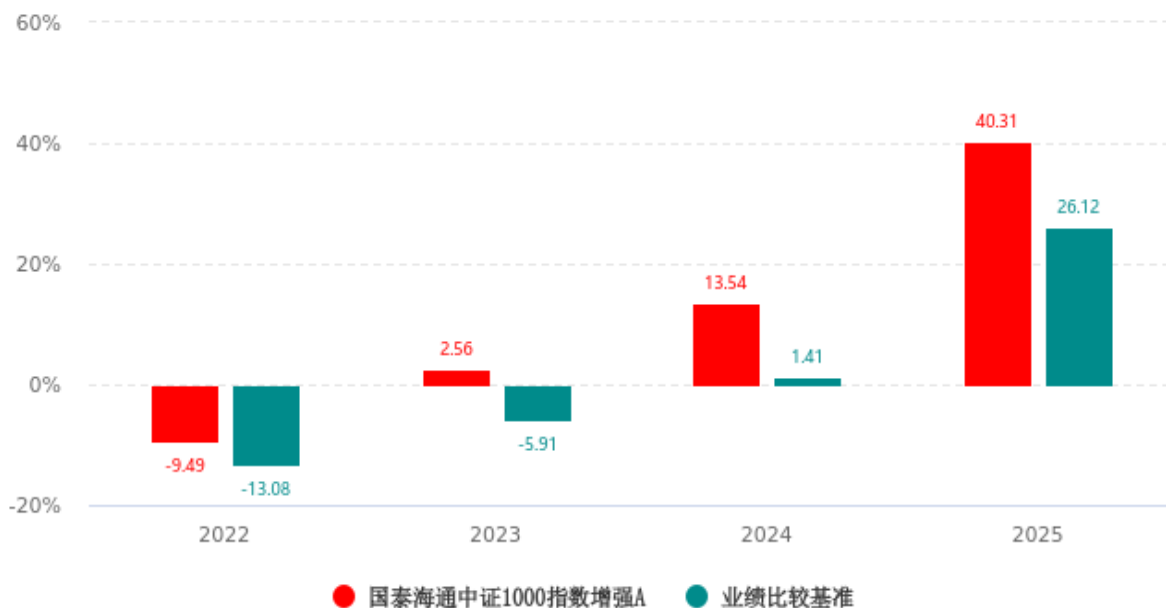


国泰海通中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

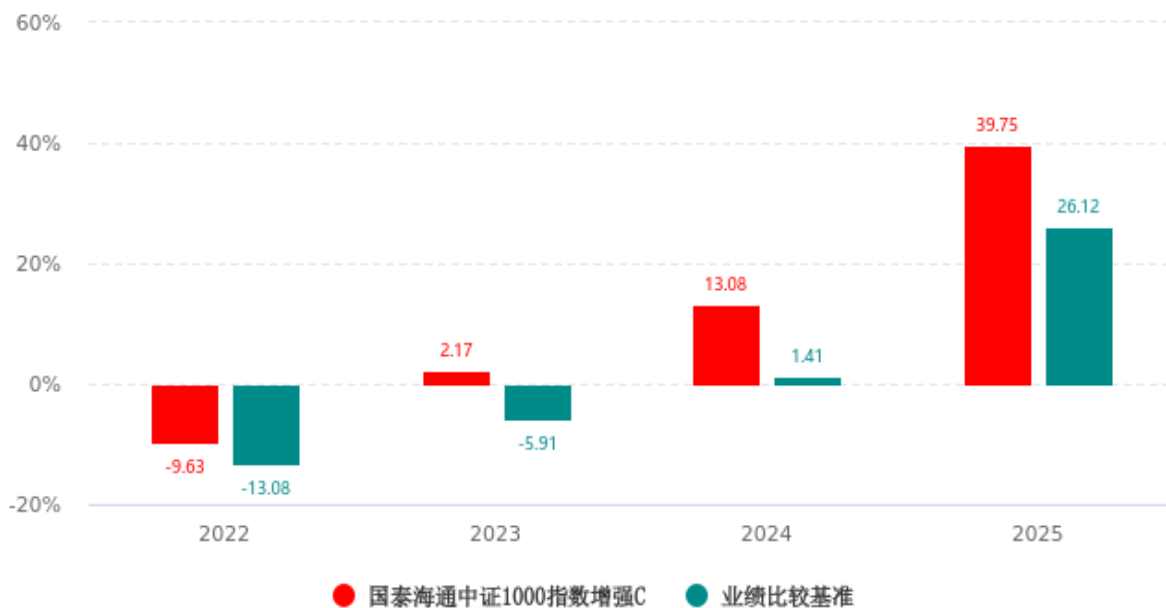
(2022年08月16日-2025年12月31日)



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



注：本基金合同生效日为 2022 年 08 月 16 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2022 年 08 月 16 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰海通证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理国泰海通现金管家货币市场基金、国泰海通 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰海通君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰海通中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰海通君得明混合型证券投资基金、国泰海通东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰海通君得利短债债券型证券投资基金、国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰海通 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰海通安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金等 71 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 胡崇海 | 国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通量化选股混合发起基金经理，国泰海通沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰海通中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理，国泰海通红利量化选股混合基金经理，国泰海通中证 A500 指数增强基金经理，国泰海通上证科创板综合价格指数增强基金经理，国泰海通稳健泰裕债券发起基金经 | 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。 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|--|
| | 理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通创业板综指增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。 | | | | |
| 刘晟 | 国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。 | 2024-08-21 | - | 4 年 | 刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰海通证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，A 股市场在全球资本市场波动加剧的背景下表现出独立韧性，整体呈现震荡上行行情，期间在外部冲击后快速修复，科技主线贯穿全年。年初市场情绪相对低迷，受特朗普关税政策预期及海外流动性收紧冲击，北向资金持续流出，指数超预期调整并伴随成交量萎靡。春节后受 DeepSeek 发布影响，叠加春晚催化人形机器人主题，及春季躁动行情演绎，科技板块领涨，推动市场情绪快速修复；随后在获利了结压力下，3 月市场缩量回调。进入二季度，受美国“对等关税”政策冲击，全球资本市场动荡加剧，上证综指在 4 月 7 日单日大幅下挫 7.34%，市场风险偏好骤降。随后国内政策快速响应，市场在稳增长和稳市场政策预期推动下逐步企稳，指数开启估值驱动的快速反弹。三季度，在中美经贸缓和预期与“反内卷”政策预期驱动下，上证综指自 7 月开启单边上行。8 月量价齐升、主题扩散，从 AI 算力带动至全面牛市，市场情绪显著升温，上证综指创出十年新高。9 月，在避险情绪回升、境内外资金降杠杆与对冲基金减仓的扰动下，指数呈震荡分化态势。10 月美关税预期反复，叠加三季报超预期，指数承压后修复并突破 4000 点。11 月步入业绩与政策的空窗期，中上旬高位震荡，由普涨转向结构轮动，中下旬阶段性调整加深。12 月中旬，指数下探至阶段性低位，随后受美联储降息落地、AI 算力调整结束、十五五落地预期强化等催化，叠加年末交易情绪回暖，上证综指以 11 连阳收官并维持在相对高位。全年 A 股市场表现亮眼，中证 1000 指数绝对收益可观（涨幅 27.49%），强于沪深 300 指数（涨幅 17.66%），相较中证 500 指数（涨幅 30.39%）略显落后。

2025 年市场整体呈现出小盘风格跑赢大盘、成长风格跑赢价值的特点，至年底阶段市场风格才略趋均衡。从主要风险因子的走势来看，成长因子自年初以来一直表现强势，动量因子紧随其后，第四季度表现尤为强劲，而流动性和反转因子则在年内持续为负收益。行业层面，大多数行业在 2025 年录得正收益，其中有色金属板块表现居首，整体上涨 94.7%，这主要得益于美联储降息引发的美元指数下跌、此起彼伏的全球地缘政治风险，以及半导体、新能源等新兴产业对特定有色金属的刚性需求；通信行业以 84.8% 的涨幅次之。全年仅食品饮料和煤炭行业录得负收益。Alpha 表现方面，全年整体上价量因子的表现优于基本面因子。

本基金是指数增强型基金，而基准指数中证 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 指数当前估值依然处于历史相对合理区间，成长性良好，指数未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.4789 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 40.31%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%；截至报告期末国泰海通中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.4591 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 39.75%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，预计全球增长仍处于温和区间，通胀在主要经济体继续回落但黏性仍在，货币政策更可能从高位维持转向谨慎渐进的宽松，但大国博弈与地缘扰动仍可能对企业信心、全球贸易与风险偏好造成阶段性冲击。国内方面，政策更强调稳增长、促消费、稳预期与防范重点领域风险的平衡，在房地产调整与地方财政约束仍待修复的背景下，宏观政策预计偏支持取向，货币环境或维持相对宽松，并保留降准降息等政策工具空间。A 股方面，流动性边际改善有较强确定性，若与盈利企稳形成共振，系统性估值中枢有望更稳定，但监管对杠杆与过度投机的逆周期约束可能更常态化，市场特征或体现为更重基本面、波动中枢偏高、结构性机会主导。行业层面，景气与政策共振的方向仍可能围绕 AI 算力与应用、半导体与高端制造、机器人与航天军工等硬科技链条展开，同时在利率下行与分红回报偏好提升的环境中，高股息资产、部分公用与资源品、金融等或具备配置价值；此外，促消费与服务消费扩容、以及医药创新与出海相关领域也可能在盈利改善与风险偏好回升时贡献结构性机会，但需关注外部贸易摩擦、国内需求修复节奏、地产链条尾部风险及市场拥挤带来的回撤压力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

报告期内，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，本托管人未发现有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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 容诚审字[2026]200Z2707 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|--|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“国泰海通中证 1000 指数增强基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国泰海通中证 1000 指数增强基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于国泰海通中证 1000 指数增强基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>国泰海通中证 1000 指数增强基金的基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰海通中证 1000 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰海通中证 1000 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰海通中证 1000 指数增强基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报</p> |

| | |
|-----------|--|
| | <p>告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对国泰海通中证 1000 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰海通中证 1000 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 张振波 陈轶杰 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26 |
| 审计报告日期 | 2026-03-26 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 141,637,277.33 | 77,728,427.14 |
| 结算备付金 | | 29,390,007.84 | 12,901,926.96 |
| 存出保证金 | | 4,634,649.60 | 2,793,595.20 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,874,389,343.89 | 1,197,427,161.27 |
| 其中：股票投资 | | 1,874,389,343.89 | 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 3,979,318.85 | 8,955,010.50 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 2,054,030,597.51 | 1,299,806,121.07 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|------------------|------------------|
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 25,872,886.70 | 7,451,079.73 |
| 应付管理人报酬 | | 1,718,247.42 | 1,061,121.20 |
| 应付托管费 | | 257,737.12 | 159,168.21 |
| 应付销售服务费 | | 335,136.13 | 209,367.51 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 19,795.16 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 176,205.30 | 165,500.13 |
| 负债合计 | | 28,380,007.83 | 9,046,236.78 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 1,378,720,992.88 | 1,230,260,222.40 |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | 646,929,596.80 | 60,499,661.89 |
| 净资产合计 | | 2,025,650,589.68 | 1,290,759,884.29 |
| 负债和净资产总计 | | 2,054,030,597.51 | 1,299,806,121.07 |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,378,720,992.88 份。其中国泰海通中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.4789 元，基金份额总额 704,044,432.55 份；国泰海通中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.4591 元，基金份额总额 674,676,560.33 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰海通中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、营业总收入 | | 597,197,389.25 | 35,952,812.71 |
| 1. 利息收入 | | 527,465.62 | 413,629.72 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 482,390.14 | 413,629.72 |
| 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 | | 45,075.48 | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 524,266,063.09 | 73,251,644.38 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | 502,453,831.26 | 68,212,814.07 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.11 | 8,093,341.71 | -3,541,063.70 |
| 股利收益 | 7.4.7.12 | 13,718,890.12 | 8,579,894.01 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.13 | 67,936,220.86 | -38,505,295.13 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.14 | 4,467,639.68 | 792,833.74 |
| 减：二、营业总支出 | | 23,559,162.80 | 11,912,730.65 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 17,361,824.25 | 8,429,991.37 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,604,273.63 | 1,264,498.71 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 3,379,619.36 | 2,038,275.42 |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------|---------------|
| 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 | | 30,006.64 | 881.13 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.15 | 183,438.92 | 179,084.02 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 573,638,226.45 | 24,040,082.06 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 573,638,226.45 | 24,040,082.06 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 573,638,226.45 | 24,040,082.06 |

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通中证 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 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） | 148,460,770.48 | 586,429,934.91 | 734,890,705.39 |
| （一）、综合收益总额 | - | 573,638,226.45 | 573,638,226.45 |
| （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） | 148,460,770.48 | 12,791,708.46 | 161,252,478.94 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,619,920,917.92 | 715,090,551.34 | 3,335,011,469.26 |
| 2. 基金赎回款 | - | -702,298,842.88 | - |
| | 2,471,460,147.44 | | 3,173,758,990.32 |
| （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 | 1,378,720,992.88 | 646,929,596.80 | 2,025,650,589.68 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 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） | -179,746,618.55 | 166,936,083.49 | -12,810,535.06 |
| （一）、综合收益总额 | - | 24,040,082.06 | 24,040,082.06 |
| （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） | -179,746,618.55 | 142,896,001.43 | -36,850,617.12 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,435,397,094.08 | -30,469,105.47 | 1,404,927,988.61 |
| 2. 基金赎回款 | - | 173,365,106.90 | - |
| | 1,615,143,712.63 | | 1,441,778,605.73 |
| （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 | 1,230,260,222.40 | 60,499,661.89 | 1,290,759,884.29 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 陶耿 | 陶耿 | 王红莲 |
| ----- | ----- | ----- |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金变更而来。国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2022 年 5 月 13 日证监许可【2022】983 号文注册募集。《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。

2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。2025 年 9 月 29 日，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金变更为国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金，《国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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

根据《国泰海通中证 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《国泰海通中证 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×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款 | 61,155,137.07 | 46,294,930.84 |
| 等于：本金 | 61,148,479.10 | 46,283,724.98 |
| 加：应计利息 | 6,657.97 | 11,205.86 |
| 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 | 80,482,140.26 | 31,433,496.30 |
| 等于：本金 | 80,480,753.00 | 31,432,672.67 |
| 加：应计利息 | 1,387.26 | 823.63 |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 合计 | 141,637,277.33 | 77,728,427.14 |

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | | | |
|---------------|----------------------|------|------------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,859,355,554.99 | - | 1,874,389,343.89 | 15,033,788.90 |
| 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 | 1,859,355,554.99 | - | 1,874,389,343.89 | 15,033,788.90 |
| 项目 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,249,524,061.70 | - | 1,197,427,161.27 | -52,096,900.43 |
| 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 | 1,249,524,061.70 | - | 1,197,427,161.27 | -52,096,900.43 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | | | |
|--------|-----------------------|------|----|----|
| | 合同/名义金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | 38,419,909.45 | - | - | - |
| 股指期货 | 38,419,909.45 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 38,419,909.45 | - | - | - |
| 项目 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | | | |
| | 合同/名义金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | 23,889,916.05 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|---------------|---|---|---|
| 股指期货 | 23,889,916.05 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 23,889,916.05 | - | - | - |

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 |
|------------|--------|----------|---------------|------------|
| IM2602 | IM2602 | 13 | 19,515,080.00 | -46,800.00 |
| IM2603 | IM2603 | 8 | 11,902,400.00 | 273,890.55 |
| IM2606 | IM2606 | 5 | 7,204,600.00 | -24,920.00 |
| 合计 | | | | 202,170.55 |
| 减：可抵销期货暂收款 | | | | 202,170.55 |
| 净额 | | | | 0.00 |

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------|-----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 8,205.30 | 500.13 |
| 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 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 预提审计费 | 48,000.00 | 45,000.00 |
| 合计 | 176,205.30 | 165,500.13 |

7.4.7.7 实收基金

国泰海通中证 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 12 月 31 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 | 850,631,304.03 | 850,631,304.03 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -778,142,428.39 | -778,142,428.39 |
| 本期末 | 704,044,432.55 | 704,044,432.55 |

国泰海通中证 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 12 月 31 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 | 1,769,289,613.89 | 1,769,289,613.89 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,693,317,719.05 | -1,693,317,719.05 |
| 本期末 | 674,676,560.33 | 674,676,560.33 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰海通中证 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 | 256,381,815.21 | 36,909,141.54 | 293,290,956.75 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,924,144.59 | 15,688,578.77 | 9,764,434.18 |
| 其中：基金申购款 | 176,790,166.23 | 59,199,836.95 | 235,990,003.18 |
| 基金赎回款 | -182,714,310.82 | -43,511,258.18 | -226,225,569.00 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 285,226,861.75 | 51,944,480.93 | 337,171,342.68 |

国泰海通中证 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 | 249,320,190.38 | 31,027,079.32 | 280,347,269.70 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -15,791,093.72 | 18,818,368.00 | 3,027,274.28 |
| 其中：基金申购款 | 354,511,049.76 | 124,589,498.40 | 479,100,548.16 |
| 基金赎回款 | -370,302,143.48 | -105,771,130.40 | -476,073,273.88 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 260,614,064.47 | 49,144,189.65 | 309,758,254.12 |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|-----------|--|---|
| 活期存款利息收入 | 257,820.34 | 253,258.66 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | 50,958.18 | 45,593.55 |
| 结算备付金利息收入 | 173,611.62 | 114,777.51 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 482,390.14 | 413,629.72 |

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------|--|---|
| 卖出股票成交总额 | 19,745,329,404.53 | 10,383,873,878.00 |
| 减：卖出股票成本总额 | 19,227,640,805.65 | 10,307,628,534.90 |
| 减：交易费用 | 15,234,767.62 | 8,032,529.03 |
| 买卖股票差价收入 | 502,453,831.26 | 68,212,814.07 |

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|----------------------|--|---|
| 股指期货投资收益 | 8,585,233.40 | -3,396,091.49 |
| 减：其他衍生工具收益应缴纳 增值税 | 250,055.35 | 7,342.87 |
| 减：交易费用 | 241,836.34 | 137,629.34 |
| 合计 | 8,093,341.71 | -3,541,063.70 |

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 13,718,890.12 | 8,579,894.01 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |

| | | |
|-------------|---------------|--------------|
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 13,718,890.12 | 8,579,894.01 |

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------------|--|---|
| 1. 交易性金融资产 | 67,130,689.33 | -37,718,366.62 |
| ——股票投资 | 67,130,689.33 | -37,718,366.62 |
| ——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 | 812,126.60 | -786,928.51 |
| ——权证投资 | - | - |
| ——期货投资 | 812,126.60 | - |
| 期货投资 | - | -786,928.51 |
| 3. 其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | 6,595.07 | - |
| 合计 | 67,936,220.86 | -38,505,295.13 |

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 基金赎回费收入 | 4,445,672.74 | 792,770.95 |
| 转换费收入 | 21,966.94 | 62.79 |
| 合计 | 4,467,639.68 | 792,833.74 |

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用 | 48,000.00 | 45,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 15,038.92 | 14,084.02 |

| | | |
|---------|------------|------------|
| 证券账户开户费 | 400.00 | - |
| 合计 | 183,438.92 | 179,084.02 |

7.4.7.16 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

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

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

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------------|---------|
| 上海国泰海通证券资产管理有限公司(以下简称“国泰海通资管”) | 基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银 | 基金托管人 |

| | |
|----------------------------|---------------|
| 行”) | |
| 国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通证券”) | 基金管理人的股东、代销机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 | |
|--------|---------------------------------------|--------------|--|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 39,043,603,926.82 | 98.64% | 20,701,930,129.06 | 100.00% |

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | | |
|--------|--|------------|----------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 2,783,445.22 | 98.57% | 0.00 | 0.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 1,512,508.9 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |

| | | | |
|--|---|--|--|
| | 7 | | |
|--|---|--|--|

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 17,361,824.25 | 8,429,991.37 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 5,532,173.13 | 2,446,464.71 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 11,829,651.12 | 5,983,526.66 |

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,604,273.63 | 1,264,498.71 |

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|--|--------------------|--------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C | 合计 |
| 国泰海通证券 | - | 373,134.28 | 373,134.28 |
| 国泰海通资管 | - | 465,333.66 | 465,333.66 |
| 合计 | - | 838,467.94 | 838,467.94 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 1000 指数增强 C | 合计 |
| 国泰海通证券 | - | 472,392.63 | 472,392.63 |
| 国泰海通资管 | - | 837,684.68 | 837,684.68 |
| 合计 | - | 1,310,077.31 | 1,310,077.31 |

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰海通中证 1000 指数增强 A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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 | - | 12,418,753.88 |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份 额 | 12,418,753.88 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 12,418,753.88 |
| 报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例 | 0.00% | 1.97% |

国泰海通中证 1000 指数增强 C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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：报告期内赎回/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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|------------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 国泰海通证券 | 69,114,124.40 | 50,958.18 | 31,433,496.30 | 45,593.55 |
| 农业银行 | 61,155,137.07 | 257,820.34 | 46,294,930.84 | 253,258.66 |

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|----------|---------|--------|--------|--------------|-----------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688795 | 摩尔线程 | 2025年11月26日 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 114.28 | 416.18 | 258 | 29,484.24 | 107,374.44 | - |
| 001280 | 中国铀业 | 2025年11月25日 | 1-6个月(含) | 主板打新限售 | 17.89 | 45.36 | 2,277 | 40,735.53 | 103,284.72 | - |
| 688809 | 强一股份 | 2025年12月23日 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 85.09 | 203.31 | 259 | 22,038.31 | 52,657.29 | - |
| 688802 | 沐曦股份 | 2025年12月09日 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 104.66 | 399.31 | 102 | 10,675.32 | 40,729.62 | - |
| 001386 | 马可 | 2025年10月 | 1-6个月 | 主板打新 | 13.75 | 18.53 | 1,626 | 22,357.50 | 30,129.78 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------------|-------|------------|-----|---------------|-----------|---|--|
| | 波 罗 | 月 15 日 | (含) | 限售 | | | | | | | |
| 68872 7 | 恒 坤 新 材 | 2025 年 11 月 11 日 | 1-6 个 月 (含) | 科 创 板 打 新 限 售 | 14.99 | 34.87 | 563 | 8,439.37 | 19,631.81 | - | |
| 68879 6 | 百 奥 赛 图 | 2025 年 12 月 02 日 | 1-6 个 月 (含) | 科 创 板 打 新 限 售 | 26.68 | 42.25 | 423 | 11,285.6 4 | 17,871.75 | - | |
| 30163 2 | 广 东 建 科 | 2025 年 08 月 05 日 | 1-6 个 月 (含) | 创 业 板 打 新 限 售 | 6.56 | 23.68 | 656 | 4,303.36 | 15,534.08 | - | |
| 30156 3 | 云 汉 芯 城 | 2025 年 09 月 23 日 | 1-6 个 月 (含) | 创 业 板 打 新 限 售 | 27.00 | 133.6 9 | 110 | 2,970.00 | 14,705.90 | - | |
| 30149 1 | 汉 桑 科 技 | 2025 年 07 月 29 日 | 1-6 个 月 (含) | 创 业 板 打 新 限 售 | 28.91 | 55.11 | 245 | 7,082.95 | 13,501.95 | - | |
| 00136 9 | 双 欣 环 保 | 2025 年 12 月 23 日 | 1-6 个 月 (含) | 主 板 打 新 限 售 | 6.85 | 12.89 | 897 | 6,144.45 | 11,562.33 | - | |
| 30160 9 | 山 大 电 力 | 2025 年 07 月 16 日 | 1-6 个 月 (含) | 创 业 板 打 新 限 售 | 14.66 | 40.99 | 277 | 4,060.82 | 11,354.23 | - | |
| 30168 7 | 新 广 益 | 2025 年 12 月 24 日 | 1-6 个 月 (含) | 创 业 板 打 新 限 售 | 21.93 | 54.39 | 195 | 4,276.35 | 10,606.05 | - | |
| 68879 0 | 昂 瑞 微 | 2025 年 12 月 09 日 | 1-6 个 月 (含) | 科 创 板 打 新 限 售 | 83.06 | 117.1 9 | 86 | 7,143.16 | 10,078.34 | - | |
| 30166 7 | 纳 百 川 | 2025 年 12 月 10 日 | 1-6 个 月 (含) | 创 业 板 打 新 限 售 | 22.63 | 57.07 | 151 | 3,417.13 | 8,617.57 | - | |
| 68880 5 | 健 信 | 2025 年 12 | 1-6 个 月 | 科 创 板 打 | 18.58 | 32.37 | 265 | 4,923.70 | 8,578.05 | - | |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|------------|---------|-------|-------|-----|----------|----------|---|--|
| | 超导 | 月 17 日 | (含) | 新限售 | | | | | | | |
| 603175 | 超颖电子 | 2025 年 10 月 17 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 17.08 | 48.56 | 169 | 2,886.52 | 8,206.64 | - | |
| 603092 | 德力佳 | 2025 年 10 月 30 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 46.68 | 55.66 | 146 | 6,815.28 | 8,126.36 | - | |
| 301668 | 昊创瑞通 | 2025 年 09 月 15 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 21.00 | 44.80 | 165 | 3,465.00 | 7,392.00 | - | |
| 301449 | 天溯计量 | 2025 年 12 月 16 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 36.80 | 65.23 | 112 | 4,121.60 | 7,305.76 | - | |
| 601026 | 道生天合 | 2025 年 10 月 09 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 5.98 | 14.28 | 451 | 2,696.98 | 6,440.28 | - | |
| 301575 | 艾芬达 | 2025 年 09 月 03 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 27.69 | 49.55 | 126 | 3,488.94 | 6,243.30 | - | |
| 603406 | 天富龙 | 2025 年 07 月 30 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 23.60 | 40.16 | 153 | 3,610.80 | 6,144.48 | - | |
| 001388 | 信通电子 | 2025 年 06 月 24 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 16.42 | 42.94 | 94 | 1,543.48 | 4,036.36 | - | |
| 603370 | 华新精科 | 2025 年 08 月 27 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 18.60 | 46.35 | 82 | 1,525.20 | 3,800.70 | - | |
| 001396 | 誉帆科技 | 2025 年 12 月 23 日 | 1-6 个月 (含) | 主板打新限售 | 22.29 | 35.39 | 69 | 1,538.01 | 2,441.91 | - | |

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|---------|--------|------------|--------|--------|--------------|--------------|----|
| 603508 | 思维列控 | 2025-12-29 | 筹划控制权变更 | 27.82 | 2026-01-07 | 27.83 | 40,600 | 1,140,321.00 | 1,129,492.00 | - |

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2024 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2025 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 | 141,637,277.33 | - | - | - | 141,637,277.33 |
| 结算备付 | 29,390,007.84 | - | - | - | 29,390,007.84 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 金 | | | | | |
| 存出保证金 | - | - | - | 4,634,649.60 | 4,634,649.60 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,874,389,343.89 | 1,874,389,343.89 |
| 应收申购款 | - | - | - | 3,979,318.85 | 3,979,318.85 |
| 资产总计 | 171,027,285.17 | - | - | 1,883,003,312.34 | 2,054,030,597.51 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 25,872,886.70 | 25,872,886.70 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,718,247.42 | 1,718,247.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 257,737.12 | 257,737.12 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 335,136.13 | 335,136.13 |
| 应交税费 | - | - | - | 19,795.16 | 19,795.16 |
| 其他负债 | - | - | - | 176,205.30 | 176,205.30 |
| 负债总计 | - | - | - | 28,380,007.83 | 28,380,007.83 |
| 利率敏感度缺口 | 171,027,285.17 | - | - | 1,854,623,304.51 | 2,025,650,589.68 |
| 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 | 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 | - | - | - | 1,197,427,161.27 | 1,197,427,161.27 |
| 应收申购款 | - | - | - | 8,955,010.50 | 8,955,010.50 |
| 资产总计 | 93,423,949.30 | - | - | 1,206,382,171.77 | 1,299,806,121.07 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回 | - | - | - | 7,451,079.73 | 7,451,079.73 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|------------------|------------------|
| 款 | | | | | |
| 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 | - | - | 1,197,335,934.99 | 1,290,759,884.29 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2024 年 12 月 31 日: 0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2024 年 12 月 31 日: 同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | |
|----|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| | | | | |

| | | | | |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 1,874,389,343.89 | 92.53 | 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 | 1,874,389,343.89 | 92.53 | 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 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5% | 102,693,762.64 | 64,279,055.76 |
| | 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5% | -102,693,762.64 | -64,279,055.76 |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
|---------------|----------------------|-----------------------|

| | | |
|------|----------------------|----------------------|
| 第一层次 | 1, 872, 723, 496. 19 | 1, 196, 885, 858. 24 |
| 第二层次 | 1, 129, 492. 00 | 27, 736. 50 |
| 第三层次 | 536, 355. 70 | 513, 566. 53 |
| 合计 | 1, 874, 389, 343. 89 | 1, 197, 427, 161. 27 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|--|--|--------------|--------------|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | 513, 566. 53 | 513, 566. 53 |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 332, 934. 29 | 332, 934. 29 |
| 转出第三层次 | - | 923, 331. 28 | 923, 331. 28 |
| 当期利得或损失总额 | - | 613, 186. 16 | 613, 186. 16 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 613, 186. 16 | 613, 186. 16 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 536, 355. 70 | 536, 355. 70 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 315, 326. 06 | 315, 326. 06 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |

| | | | |
|--|---|--------------|--------------|
| 期初余额 | - | 475,956.99 | 475,956.99 |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 1,042,114.14 | 1,042,114.14 |
| 转出第三层次 | - | 1,298,052.84 | 1,298,052.84 |
| 当期利得或损失总额 | - | 293,548.24 | 293,548.24 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 293,548.24 | 293,548.24 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 513,566.53 | 513,566.53 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 306,390.29 | 306,390.29 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|--------|------------|------------|---------|----------------|------------|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 流通受限股票 | 536,355.70 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 18.00%-307.91% | 负相关 |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 流通受限股票 | 513,566.53 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 34.23%-574.44% | 负相关 |

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,874,389,343.89 | 91.25 |
| | 其中：股票 | 1,874,389,343.89 | 91.25 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 171,027,285.17 | 8.33 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,613,968.45 | 0.42 |
| 9 | 合计 | 2,054,030,597.51 | 100.00 |

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

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|---|------------------|------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,728,800.44 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 31,991,784.22 | 1.58 |
| C | 制造业 | 1,080,973,556.16 | 53.36 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,172,622.90 | 0.80 |
| E | 建筑业 | 17,132,668.26 | 0.85 |
| F | 批发和零售业 | 62,291,381.04 | 3.08 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 46,015,344.01 | 2.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 5,400,200.00 | 0.27 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 200,672,000.52 | 9.91 |
| J | 金融业 | 23,024,661.00 | 1.14 |
| K | 房地产业 | 11,759,325.00 | 0.58 |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,154,138.57 | 0.65 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 22,404,537.86 | 1.11 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 20,303,179.45 | 1.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 567,430.00 | 0.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,046,742.00 | 0.05 |
| S | 综合 | 6,295,310.00 | 0.31 |
| | 合计 | 1,560,933,681.43 | 77.06 |

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,235,209.00 | 0.16 |
| B | 采矿业 | 1,904,580.72 | 0.09 |
| C | 制造业 | 212,899,071.64 | 10.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,861,831.00 | 0.98 |
| E | 建筑业 | 1,827,456.00 | 0.09 |
| F | 批发和零售业 | 10,723,591.90 | 0.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 251,868.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 26,755,968.45 | 1.32 |
| J | 金融业 | 5,226,433.00 | 0.26 |
| K | 房地产业 | 1,917,141.65 | 0.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 11,579,221.00 | 0.57 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 11,923,487.10 | 0.59 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 482,733.00 | 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 | 1,279,415.00 | 0.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,587,655.00 | 0.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 313,455,662.46 | 15.47 |

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|------------------|
| 1 | 002222 | 福晶科技 | 300,400 | 16,924,536.00 | 0.84 |
| 2 | 300548 | 长芯博创 | 104,826 | 14,885,292.00 | 0.73 |
| 3 | 300620 | 光库科技 | 95,100 | 13,984,455.00 | 0.69 |
| 4 | 300008 | 天海防务 | 1,725,500 | 13,614,195.00 | 0.67 |
| 5 | 300127 | 银河磁体 | 441,800 | 13,399,794.00 | 0.66 |
| 6 | 300438 | 鹏辉能源 | 248,900 | 13,246,458.00 | 0.65 |
| 7 | 001337 | 四川黄金 | 440,000 | 12,258,400.00 | 0.61 |
| 8 | 600100 | 同方股份 | 1,337,800 | 11,933,176.00 | 0.59 |
| 9 | 000019 | 深粮控股 | 1,694,785 | 11,778,755.75 | 0.58 |
| 10 | 601126 | 四方股份 | 386,000 | 11,610,880.00 | 0.57 |
| 11 | 002487 | 大金重工 | 219,100 | 11,377,863.00 | 0.56 |
| 12 | 600782 | 新钢股份 | 2,920,900 | 11,333,092.00 | 0.56 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|-------------------|------|
| 13 | 601890 | 亚星锚链 | 1,075,300 | 11,064,837.0 0 | 0.55 |
| 14 | 002091 | 江苏国泰 | 1,223,100 | 11,044,593.0 0 | 0.55 |
| 15 | 600366 | 宁波韵升 | 799,400 | 11,023,726.0 0 | 0.54 |
| 16 | 002174 | 游族网络 | 888,000 | 10,869,120.0 0 | 0.54 |
| 17 | 000555 | 神州信息 | 650,600 | 10,767,430.0 0 | 0.53 |
| 18 | 688088 | 虹软科技 | 215,850 | 10,684,575.0 0 | 0.53 |
| 19 | 002097 | 山河智能 | 856,200 | 10,625,442.0 0 | 0.52 |
| 20 | 600267 | 海正药业 | 1,047,600 | 10,360,764.0 0 | 0.51 |
| 21 | 688062 | 迈威生物 | 266,749 | 10,261,834.0 3 | 0.51 |
| 22 | 002488 | 金固股份 | 1,118,300 | 9,829,857.00 | 0.49 |
| 23 | 600259 | 中稀有色 | 172,700 | 9,716,102.00 | 0.48 |
| 24 | 300775 | 三角防务 | 317,900 | 9,664,160.00 | 0.48 |
| 25 | 002626 | 金达威 | 465,300 | 9,171,063.00 | 0.45 |
| 26 | 300045 | 华力创通 | 314,600 | 9,095,086.00 | 0.45 |
| 27 | 002004 | 华邦健康 | 1,895,100 | 9,058,578.00 | 0.45 |
| 28 | 688182 | 灿勤科技 | 305,190 | 9,009,208.80 | 0.44 |
| 29 | 300101 | 振芯科技 | 315,500 | 8,969,665.00 | 0.44 |
| 30 | 002967 | 广电计量 | 406,500 | 8,947,065.00 | 0.44 |
| 31 | 688208 | 道通科技 | 241,205 | 8,876,344.00 | 0.44 |
| 32 | 002755 | 奥赛康 | 536,400 | 8,759,412.00 | 0.43 |
| 33 | 688141 | 杰华特 | 198,984 | 8,641,875.12 | 0.43 |
| 34 | 300768 | 迪普科技 | 466,300 | 8,640,539.00 | 0.43 |
| 35 | 300409 | 道氏技术 | 383,100 | 8,615,919.00 | 0.43 |
| 36 | 300224 | 正海磁材 | 553,979 | 8,564,515.34 | 0.42 |
| 37 | 688591 | 泰凌微 | 200,510 | 8,533,705.60 | 0.42 |
| 38 | 300113 | 顺网科技 | 421,064 | 8,522,335.36 | 0.42 |
| 39 | 600389 | 江山股份 | 333,900 | 8,440,992.00 | 0.42 |
| 40 | 600478 | 科力远 | 1,222,800 | 8,425,092.00 | 0.42 |
| 41 | 002242 | 九阳股份 | 793,300 | 8,282,052.00 | 0.41 |
| 42 | 002946 | 新乳业 | 442,572 | 8,200,859.16 | 0.40 |
| 43 | 300726 | 宏达电子 | 160,800 | 8,186,328.00 | 0.40 |
| 44 | 300917 | 特发服务 | 207,600 | 8,117,160.00 | 0.40 |
| 45 | 300065 | 海兰信 | 442,370 | 8,037,862.90 | 0.40 |
| 46 | 002550 | 千红制药 | 1,016,300 | 7,988,118.00 | 0.39 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 47 | 601022 | 宁波远洋 | 860,000 | 7,886,200.00 | 0.39 |
| 48 | 600114 | 东睦股份 | 252,000 | 7,698,600.00 | 0.38 |
| 49 | 002697 | 红旗连锁 | 1,289,702 | 7,660,829.88 | 0.38 |
| 50 | 301175 | 中科环保 | 1,274,100 | 7,529,931.00 | 0.37 |
| 51 | 301316 | 慧博云通 | 167,782 | 7,496,499.76 | 0.37 |
| 52 | 600619 | 海立股份 | 355,100 | 7,492,610.00 | 0.37 |
| 53 | 600120 | 浙江东方 | 1,211,400 | 7,474,338.00 | 0.37 |
| 54 | 002204 | 大连重工 | 956,200 | 7,314,930.00 | 0.36 |
| 55 | 601326 | 秦港股份 | 2,078,400 | 7,253,616.00 | 0.36 |
| 56 | 603005 | 晶方科技 | 259,032 | 7,164,825.12 | 0.35 |
| 57 | 300378 | 鼎捷数智 | 158,000 | 7,151,080.00 | 0.35 |
| 58 | 688779 | 五矿新能 | 953,638 | 7,142,748.62 | 0.35 |
| 59 | 603118 | 共进股份 | 619,400 | 7,123,100.00 | 0.35 |
| 60 | 002258 | 利尔化学 | 542,400 | 7,078,320.00 | 0.35 |
| 61 | 002317 | 众生药业 | 370,400 | 7,030,192.00 | 0.35 |
| 62 | 603496 | 恒为科技 | 252,200 | 6,880,016.00 | 0.34 |
| 63 | 603063 | 禾望电气 | 207,100 | 6,848,797.00 | 0.34 |
| 64 | 601083 | 锦江航运 | 612,800 | 6,838,848.00 | 0.34 |
| 65 | 688660 | 电气风电 | 394,690 | 6,713,676.90 | 0.33 |
| 66 | 002038 | 双鹭药业 | 901,050 | 6,640,738.50 | 0.33 |
| 67 | 688343 | 云天励飞 | 87,196 | 6,633,871.68 | 0.33 |
| 68 | 688700 | 东威科技 | 187,520 | 6,615,705.60 | 0.33 |
| 69 | 300456 | 赛微电子 | 117,800 | 6,592,088.00 | 0.33 |
| 70 | 000990 | 诚志股份 | 819,700 | 6,492,024.00 | 0.32 |
| 71 | 600416 | 湘电股份 | 411,300 | 6,490,314.00 | 0.32 |
| 72 | 600388 | 龙净环保 | 396,900 | 6,473,439.00 | 0.32 |
| 73 | 300573 | 兴齐眼药 | 91,500 | 6,431,535.00 | 0.32 |
| 74 | 603083 | 剑桥科技 | 47,400 | 6,369,612.00 | 0.31 |
| 75 | 002456 | 欧菲光 | 599,700 | 6,368,814.00 | 0.31 |
| 76 | 601107 | 四川成渝 | 1,045,700 | 6,357,856.00 | 0.31 |
| 77 | 603013 | 亚普股份 | 257,100 | 6,342,657.00 | 0.31 |
| 78 | 000581 | 威孚高科 | 306,200 | 6,313,844.00 | 0.31 |
| 79 | 000422 | 湖北宜化 | 443,600 | 6,303,556.00 | 0.31 |
| 80 | 301095 | 广立微 | 87,800 | 6,296,138.00 | 0.31 |
| 81 | 000833 | 粤桂股份 | 323,500 | 6,295,310.00 | 0.31 |
| 82 | 600320 | 振华重工 | 1,212,515 | 6,244,452.25 | 0.31 |
| 83 | 688158 | 优刻得 | 220,700 | 6,199,463.00 | 0.31 |
| 84 | 002023 | 海特高新 | 457,400 | 6,193,196.00 | 0.31 |
| 85 | 002537 | 海联金汇 | 675,200 | 6,117,312.00 | 0.30 |
| 86 | 002612 | 朗姿股份 | 294,900 | 6,027,756.00 | 0.30 |
| 87 | 002364 | 中恒电气 | 226,200 | 5,980,728.00 | 0.30 |
| 88 | 300602 | 飞荣达 | 177,300 | 5,879,268.00 | 0.29 |
| 89 | 688321 | 微芯生物 | 199,976 | 5,843,298.72 | 0.29 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 90 | 000902 | 新洋丰 | 373,500 | 5,834,070.00 | 0.29 |
| 91 | 002020 | 京新药业 | 305,400 | 5,796,492.00 | 0.29 |
| 92 | 002941 | 新疆交建 | 365,700 | 5,796,345.00 | 0.29 |
| 93 | 002901 | 大博医疗 | 121,800 | 5,769,666.00 | 0.28 |
| 94 | 300693 | 盛弘股份 | 150,200 | 5,749,656.00 | 0.28 |
| 95 | 600810 | 神马股份 | 628,400 | 5,649,316.00 | 0.28 |
| 96 | 300624 | 万兴科技 | 77,900 | 5,503,635.00 | 0.27 |
| 97 | 688443 | 智翔金泰 | 199,112 | 5,423,810.88 | 0.27 |
| 98 | 000065 | 北方国际 | 434,100 | 5,408,886.00 | 0.27 |
| 99 | 600258 | 首旅酒店 | 322,400 | 5,400,200.00 | 0.27 |
| 100 | 300357 | 我武生物 | 189,800 | 5,380,830.00 | 0.27 |
| 101 | 600353 | 旭光电子 | 331,600 | 5,345,392.00 | 0.26 |
| 102 | 688543 | 国科军工 | 85,935 | 5,333,985.45 | 0.26 |
| 103 | 600206 | 有研新材 | 261,200 | 5,310,196.00 | 0.26 |
| 104 | 000970 | 中科三环 | 391,100 | 5,303,316.00 | 0.26 |
| 105 | 301551 | 无线传媒 | 167,600 | 5,287,780.00 | 0.26 |
| 106 | 300341 | 麦克奥迪 | 323,600 | 5,287,624.00 | 0.26 |
| 107 | 300747 | 锐科激光 | 195,600 | 5,287,068.00 | 0.26 |
| 108 | 600063 | 皖维高新 | 894,400 | 5,268,016.00 | 0.26 |
| 109 | 002051 | 中工国际 | 580,400 | 5,264,228.00 | 0.26 |
| 110 | 688536 | 思瑞浦 | 32,544 | 5,203,134.72 | 0.26 |
| 111 | 002237 | 恒邦股份 | 384,600 | 5,161,332.00 | 0.25 |
| 112 | 601777 | 千里科技 | 485,100 | 5,156,613.00 | 0.25 |
| 113 | 002010 | 传化智联 | 885,600 | 5,145,336.00 | 0.25 |
| 114 | 002077 | 大港股份 | 344,700 | 5,125,689.00 | 0.25 |
| 115 | 000767 | 晋控电力 | 1,824,500 | 5,108,600.00 | 0.25 |
| 116 | 688331 | 荣昌生物 | 65,656 | 5,107,380.24 | 0.25 |
| 117 | 601519 | 大智慧 | 385,600 | 4,962,672.00 | 0.24 |
| 118 | 300702 | 天宇股份 | 209,200 | 4,937,120.00 | 0.24 |
| 119 | 600577 | 精达股份 | 396,100 | 4,923,523.00 | 0.24 |
| 120 | 688131 | 皓元医药 | 68,062 | 4,905,908.96 | 0.24 |
| 121 | 300315 | 掌趣科技 | 975,100 | 4,816,994.00 | 0.24 |
| 122 | 603267 | 鸿远电子 | 88,100 | 4,795,283.00 | 0.24 |
| 123 | 002254 | 泰和新材 | 470,100 | 4,710,402.00 | 0.23 |
| 124 | 301109 | 军信股份 | 311,800 | 4,677,000.00 | 0.23 |
| 125 | 002324 | 普利特 | 292,000 | 4,669,080.00 | 0.23 |
| 126 | 002093 | 国脉科技 | 405,800 | 4,666,700.00 | 0.23 |
| 127 | 301219 | 腾远钴业 | 68,100 | 4,649,868.00 | 0.23 |
| 128 | 688498 | 源杰科技 | 7,202 | 4,623,611.98 | 0.23 |
| 129 | 301511 | 德福科技 | 129,100 | 4,620,489.00 | 0.23 |
| 130 | 301217 | 铜冠铜箔 | 134,264 | 4,602,569.92 | 0.23 |
| 131 | 300047 | 天源迪科 | 366,400 | 4,598,320.00 | 0.23 |
| 132 | 002101 | 广东鸿图 | 369,300 | 4,549,776.00 | 0.22 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 133 | 600338 | 西藏珠峰 | 301,600 | 4,536,064.00 | 0.22 |
| 134 | 603039 | 泛微网络 | 84,700 | 4,534,838.00 | 0.22 |
| 135 | 300850 | 新强联 | 109,105 | 4,513,673.85 | 0.22 |
| 136 | 300171 | 东富龙 | 283,900 | 4,457,230.00 | 0.22 |
| 137 | 002484 | 江海股份 | 149,400 | 4,437,180.00 | 0.22 |
| 138 | 600717 | 天津港 | 990,483 | 4,427,459.01 | 0.22 |
| 139 | 600480 | 凌云股份 | 350,600 | 4,308,874.00 | 0.21 |
| 140 | 600686 | 金龙汽车 | 242,400 | 4,300,176.00 | 0.21 |
| 141 | 688107 | 安路科技 | 158,118 | 4,297,647.24 | 0.21 |
| 142 | 301526 | 国际复材 | 613,900 | 4,297,300.00 | 0.21 |
| 143 | 688209 | 英集芯 | 215,375 | 4,294,577.50 | 0.21 |
| 144 | 002011 | 盾安环境 | 329,100 | 4,172,988.00 | 0.21 |
| 145 | 301606 | 绿联科技 | 70,700 | 4,152,918.00 | 0.21 |
| 146 | 688110 | 东芯股份 | 31,494 | 4,136,736.90 | 0.20 |
| 147 | 601069 | 西部黄金 | 154,400 | 4,119,392.00 | 0.20 |
| 148 | 000686 | 东北证券 | 437,800 | 4,080,296.00 | 0.20 |
| 149 | 603678 | 火炬电子 | 115,500 | 4,079,460.00 | 0.20 |
| 150 | 688327 | 云从科技 | 283,179 | 4,069,282.23 | 0.20 |
| 151 | 603556 | 海兴电力 | 110,500 | 4,022,200.00 | 0.20 |
| 152 | 301339 | 通行宝 | 276,500 | 4,020,310.00 | 0.20 |
| 153 | 301665 | 泰禾股份 | 142,300 | 4,018,552.00 | 0.20 |
| 154 | 688063 | 派能科技 | 70,650 | 4,014,333.00 | 0.20 |
| 155 | 601678 | 滨化股份 | 944,001 | 4,002,564.24 | 0.20 |
| 156 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 222,100 | 3,953,380.00 | 0.20 |
| 157 | 688123 | 聚辰股份 | 31,404 | 3,943,714.32 | 0.19 |
| 158 | 002292 | 奥飞娱乐 | 437,800 | 3,874,530.00 | 0.19 |
| 159 | 000612 | 焦作万方 | 346,955 | 3,823,444.10 | 0.19 |
| 160 | 002389 | 航天彩虹 | 158,500 | 3,800,830.00 | 0.19 |
| 161 | 002545 | 东方铁塔 | 205,400 | 3,789,630.00 | 0.19 |
| 162 | 002815 | 崇达技术 | 273,900 | 3,741,474.00 | 0.18 |
| 163 | 600710 | 苏美达 | 343,400 | 3,712,154.00 | 0.18 |
| 164 | 688549 | 中巨芯 | 405,631 | 3,699,354.72 | 0.18 |
| 165 | 300296 | 利亚德 | 585,000 | 3,697,200.00 | 0.18 |
| 166 | 603583 | 捷昌驱动 | 96,900 | 3,688,983.00 | 0.18 |
| 167 | 688372 | 伟测科技 | 33,410 | 3,644,696.90 | 0.18 |
| 168 | 002345 | 潮宏基 | 291,300 | 3,641,250.00 | 0.18 |
| 169 | 300672 | 国科微 | 33,800 | 3,637,556.00 | 0.18 |
| 170 | 600961 | 株冶集团 | 225,700 | 3,633,770.00 | 0.18 |
| 171 | 301000 | 肇民科技 | 92,200 | 3,629,914.00 | 0.18 |
| 172 | 603171 | 税友股份 | 65,700 | 3,622,041.00 | 0.18 |
| 173 | 603236 | 移远通信 | 37,800 | 3,606,498.00 | 0.18 |
| 174 | 300776 | 帝尔激光 | 57,900 | 3,597,906.00 | 0.18 |
| 175 | 600075 | 新疆天业 | 722,000 | 3,573,900.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 176 | 000058 | 深赛格 | 377,404 | 3,547,597.60 | 0.18 |
| 177 | 603308 | 应流股份 | 84,700 | 3,536,225.00 | 0.17 |
| 178 | 002777 | 久远银海 | 197,100 | 3,535,974.00 | 0.17 |
| 179 | 002489 | 浙江永强 | 918,500 | 3,517,855.00 | 0.17 |
| 180 | 688515 | 裕太微 | 34,154 | 3,502,492.70 | 0.17 |
| 181 | 000811 | 冰轮环境 | 188,600 | 3,492,872.00 | 0.17 |
| 182 | 000600 | 建投能源 | 404,900 | 3,453,797.00 | 0.17 |
| 183 | 002017 | 东信和平 | 152,900 | 3,409,670.00 | 0.17 |
| 184 | 002096 | 易普力 | 251,300 | 3,347,316.00 | 0.17 |
| 185 | 603638 | 艾迪精密 | 176,300 | 3,337,359.00 | 0.16 |
| 186 | 002396 | 星网锐捷 | 107,500 | 3,257,250.00 | 0.16 |
| 187 | 300598 | 诚迈科技 | 70,700 | 3,250,079.00 | 0.16 |
| 188 | 301071 | 力量钻石 | 90,300 | 3,236,352.00 | 0.16 |
| 189 | 600654 | 中安科 | 850,800 | 3,207,516.00 | 0.16 |
| 190 | 688333 | 铂力特 | 28,600 | 3,189,186.00 | 0.16 |
| 191 | 300034 | 钢研高纳 | 160,400 | 3,140,632.00 | 0.16 |
| 192 | 600740 | 山西焦化 | 834,800 | 3,138,848.00 | 0.15 |
| 193 | 688380 | 中微半导 | 97,522 | 3,135,332.30 | 0.15 |
| 194 | 002906 | 华阳集团 | 102,500 | 3,134,450.00 | 0.15 |
| 195 | 002675 | 东诚药业 | 224,600 | 3,086,004.00 | 0.15 |
| 196 | 002468 | 申通快递 | 229,500 | 3,079,890.00 | 0.15 |
| 197 | 600729 | 重庆百货 | 118,000 | 3,068,000.00 | 0.15 |
| 198 | 600933 | 爱柯迪 | 151,100 | 3,037,110.00 | 0.15 |
| 199 | 301205 | 联特科技 | 17,800 | 2,999,478.00 | 0.15 |
| 200 | 603043 | 广州酒家 | 168,840 | 2,976,649.20 | 0.15 |
| 201 | 603915 | 国茂股份 | 160,300 | 2,951,123.00 | 0.15 |
| 202 | 600155 | 华创云信 | 440,100 | 2,913,462.00 | 0.14 |
| 203 | 600850 | 电科数字 | 98,000 | 2,904,720.00 | 0.14 |
| 204 | 300303 | 聚飞光电 | 422,500 | 2,889,900.00 | 0.14 |
| 205 | 688522 | 纳睿雷达 | 72,170 | 2,881,748.10 | 0.14 |
| 206 | 301487 | 盟固利 | 130,800 | 2,868,444.00 | 0.14 |
| 207 | 300009 | 安科生物 | 299,700 | 2,868,129.00 | 0.14 |
| 208 | 688798 | 艾为电子 | 37,472 | 2,851,993.92 | 0.14 |
| 209 | 601038 | 一拖股份 | 199,500 | 2,826,915.00 | 0.14 |
| 210 | 000837 | 秦川机床 | 219,000 | 2,820,720.00 | 0.14 |
| 211 | 603588 | 高能环境 | 365,000 | 2,817,800.00 | 0.14 |
| 212 | 300913 | 兆龙互连 | 53,500 | 2,815,705.00 | 0.14 |
| 213 | 600728 | 佳都科技 | 420,400 | 2,808,272.00 | 0.14 |
| 214 | 600305 | 恒顺醋业 | 349,774 | 2,770,210.08 | 0.14 |
| 215 | 300184 | 力源信息 | 275,380 | 2,751,046.20 | 0.14 |
| 216 | 002194 | 武汉凡谷 | 210,300 | 2,744,415.00 | 0.14 |
| 217 | 300049 | 福瑞医科 | 38,329 | 2,698,744.89 | 0.13 |
| 218 | 001287 | 中电港 | 115,100 | 2,608,166.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 219 | 301078 | 孩子王 | 250,325 | 2,595,870.25 | 0.13 |
| 220 | 688153 | 唯捷创芯 | 68,672 | 2,584,814.08 | 0.13 |
| 221 | 603337 | 杰克科技 | 59,400 | 2,573,802.00 | 0.13 |
| 222 | 300613 | 富瀚微 | 55,711 | 2,566,048.66 | 0.13 |
| 223 | 688800 | 瑞可达 | 30,668 | 2,545,444.00 | 0.13 |
| 224 | 688206 | 概伦电子 | 73,016 | 2,543,147.28 | 0.13 |
| 225 | 600428 | 中远海特 | 357,400 | 2,537,540.00 | 0.13 |
| 226 | 002511 | 中顺洁柔 | 295,973 | 2,533,528.88 | 0.13 |
| 227 | 300031 | 宝通科技 | 108,000 | 2,454,840.00 | 0.12 |
| 228 | 300102 | 乾照光电 | 88,400 | 2,436,304.00 | 0.12 |
| 229 | 002428 | 云南锗业 | 75,700 | 2,403,475.00 | 0.12 |
| 230 | 601033 | 永兴股份 | 157,100 | 2,376,923.00 | 0.12 |
| 231 | 600094 | 大名城 | 566,700 | 2,357,472.00 | 0.12 |
| 232 | 300725 | 药石科技 | 61,100 | 2,356,016.00 | 0.12 |
| 233 | 002518 | 科士达 | 48,400 | 2,348,368.00 | 0.12 |
| 234 | 688584 | 上海合晶 | 106,747 | 2,342,029.18 | 0.12 |
| 235 | 600223 | 福瑞达 | 316,000 | 2,325,760.00 | 0.11 |
| 236 | 300348 | 长亮科技 | 149,000 | 2,306,520.00 | 0.11 |
| 237 | 002378 | 章源钨业 | 162,100 | 2,298,578.00 | 0.11 |
| 238 | 301029 | 怡合达 | 86,500 | 2,293,980.00 | 0.11 |
| 239 | 688097 | 博众精工 | 60,434 | 2,281,383.50 | 0.11 |
| 240 | 002015 | 协鑫能科 | 228,300 | 2,271,585.00 | 0.11 |
| 241 | 688146 | 中船特气 | 54,938 | 2,219,495.20 | 0.11 |
| 242 | 300925 | 法本信息 | 104,394 | 2,217,328.56 | 0.11 |
| 243 | 000589 | 贵州轮胎 | 423,900 | 2,195,802.00 | 0.11 |
| 244 | 688150 | 莱特光电 | 81,200 | 2,194,836.00 | 0.11 |
| 245 | 601609 | 金田股份 | 203,200 | 2,194,560.00 | 0.11 |
| 246 | 688128 | 中国电研 | 75,342 | 2,190,945.36 | 0.11 |
| 247 | 000969 | 安泰科技 | 104,100 | 2,187,141.00 | 0.11 |
| 248 | 002060 | 广东建工 | 583,800 | 2,101,680.00 | 0.10 |
| 249 | 688127 | 蓝特光学 | 54,379 | 2,093,047.71 | 0.10 |
| 250 | 300475 | 香农芯创 | 14,300 | 2,064,062.00 | 0.10 |
| 251 | 600572 | 康恩贝 | 461,400 | 2,057,844.00 | 0.10 |
| 252 | 000930 | 中粮科技 | 356,051 | 2,054,414.27 | 0.10 |
| 253 | 002399 | 海普瑞 | 171,948 | 2,027,266.92 | 0.10 |
| 254 | 688279 | 峰昭科技 | 9,900 | 2,014,551.00 | 0.10 |
| 255 | 603530 | 神马电力 | 48,300 | 1,984,164.00 | 0.10 |
| 256 | 600285 | 羚锐制药 | 95,800 | 1,984,018.00 | 0.10 |
| 257 | 002048 | 宁波华翔 | 63,000 | 1,981,980.00 | 0.10 |
| 258 | 002761 | 浙江建投 | 227,518 | 1,949,829.26 | 0.10 |
| 259 | 688001 | 华兴源创 | 64,539 | 1,947,787.02 | 0.10 |
| 260 | 002170 | 芭田股份 | 158,200 | 1,926,876.00 | 0.10 |
| 261 | 605020 | 永和股份 | 71,500 | 1,922,635.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 262 | 601869 | 长飞光纤 | 16,500 | 1,919,940.00 | 0.09 |
| 263 | 002498 | 汉缆股份 | 500,400 | 1,916,532.00 | 0.09 |
| 264 | 002073 | 软控股份 | 235,100 | 1,916,065.00 | 0.09 |
| 265 | 300468 | 四方精创 | 49,124 | 1,907,484.92 | 0.09 |
| 266 | 300131 | 英唐智控 | 129,700 | 1,901,402.00 | 0.09 |
| 267 | 000543 | 皖能电力 | 235,700 | 1,873,815.00 | 0.09 |
| 268 | 600201 | 生物股份 | 122,100 | 1,840,047.00 | 0.09 |
| 269 | 301592 | 六九一二 | 15,000 | 1,833,000.00 | 0.09 |
| 270 | 000899 | 赣能股份 | 184,971 | 1,831,212.90 | 0.09 |
| 271 | 300170 | 汉得信息 | 96,700 | 1,829,564.00 | 0.09 |
| 272 | 002897 | 意华股份 | 33,700 | 1,822,159.00 | 0.09 |
| 273 | 002507 | 涪陵榨菜 | 140,900 | 1,819,019.00 | 0.09 |
| 274 | 002706 | 良信股份 | 164,700 | 1,775,466.00 | 0.09 |
| 275 | 600210 | 紫江企业 | 240,800 | 1,769,880.00 | 0.09 |
| 276 | 601187 | 厦门银行 | 240,600 | 1,766,004.00 | 0.09 |
| 277 | 000828 | 东莞控股 | 163,100 | 1,754,956.00 | 0.09 |
| 278 | 600335 | 国机汽车 | 267,700 | 1,742,727.00 | 0.09 |
| 279 | 300777 | 中简科技 | 42,700 | 1,742,160.00 | 0.09 |
| 280 | 000848 | 承德露露 | 204,600 | 1,739,100.00 | 0.09 |
| 281 | 002987 | 京北方 | 80,100 | 1,724,553.00 | 0.09 |
| 282 | 300036 | 超图软件 | 94,400 | 1,714,304.00 | 0.08 |
| 283 | 000935 | 四川双马 | 68,700 | 1,706,508.00 | 0.08 |
| 284 | 688362 | 甬矽电子 | 52,637 | 1,705,965.17 | 0.08 |
| 285 | 300953 | 震裕科技 | 10,000 | 1,680,200.00 | 0.08 |
| 286 | 688352 | 颀中科技 | 132,902 | 1,675,894.22 | 0.08 |
| 287 | 600056 | 中国医药 | 159,100 | 1,643,503.00 | 0.08 |
| 288 | 300618 | 寒锐钴业 | 36,300 | 1,641,123.00 | 0.08 |
| 289 | 002979 | 雷赛智能 | 38,500 | 1,619,695.00 | 0.08 |
| 290 | 000597 | 东北制药 | 307,828 | 1,606,862.16 | 0.08 |
| 291 | 300674 | 宇信科技 | 65,000 | 1,576,900.00 | 0.08 |
| 292 | 688484 | 南芯科技 | 38,700 | 1,573,542.00 | 0.08 |
| 293 | 688200 | 华峰测控 | 8,086 | 1,537,957.20 | 0.08 |
| 294 | 300185 | 通裕重工 | 539,000 | 1,530,760.00 | 0.08 |
| 295 | 000030 | 富奥股份 | 265,550 | 1,524,257.00 | 0.08 |
| 296 | 600750 | 江中药业 | 64,200 | 1,487,514.00 | 0.07 |
| 297 | 002651 | 利君股份 | 126,400 | 1,477,616.00 | 0.07 |
| 298 | 002516 | 旷达科技 | 212,740 | 1,401,956.60 | 0.07 |
| 299 | 002151 | 北斗星通 | 30,800 | 1,399,244.00 | 0.07 |
| 300 | 601702 | 华峰铝业 | 68,300 | 1,398,101.00 | 0.07 |
| 301 | 002993 | 奥海科技 | 31,800 | 1,389,978.00 | 0.07 |
| 302 | 000682 | 东方电子 | 117,100 | 1,388,806.00 | 0.07 |
| 303 | 000928 | 中钢国际 | 207,900 | 1,374,219.00 | 0.07 |
| 304 | 002948 | 青岛银行 | 305,900 | 1,370,432.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 305 | 600475 | 华光环能 | 75,200 | 1,366,384.00 | 0.07 |
| 306 | 600458 | 时代新材 | 102,600 | 1,361,502.00 | 0.07 |
| 307 | 300236 | 上海新阳 | 21,200 | 1,351,712.00 | 0.07 |
| 308 | 002497 | 雅化集团 | 53,800 | 1,331,550.00 | 0.07 |
| 309 | 605599 | 菜百股份 | 80,200 | 1,312,874.00 | 0.06 |
| 310 | 601200 | 上海环境 | 162,989 | 1,312,061.45 | 0.06 |
| 311 | 002243 | 力合科创 | 127,800 | 1,271,610.00 | 0.06 |
| 312 | 600507 | 方大特钢 | 214,600 | 1,263,994.00 | 0.06 |
| 313 | 002668 | TCL 智家 | 120,800 | 1,253,904.00 | 0.06 |
| 314 | 300457 | 赢合科技 | 45,000 | 1,253,250.00 | 0.06 |
| 315 | 300130 | 新国都 | 43,600 | 1,209,028.00 | 0.06 |
| 316 | 688382 | 益方生物 | 43,703 | 1,190,469.72 | 0.06 |
| 317 | 603317 | 天味食品 | 93,200 | 1,166,864.00 | 0.06 |
| 318 | 301171 | 易点天下 | 28,800 | 1,166,400.00 | 0.06 |
| 319 | 603025 | 大豪科技 | 64,800 | 1,163,808.00 | 0.06 |
| 320 | 688313 | 仕佳光子 | 13,000 | 1,154,140.00 | 0.06 |
| 321 | 301622 | 英思特 | 17,900 | 1,152,760.00 | 0.06 |
| 322 | 002100 | 天康生物 | 155,800 | 1,148,246.00 | 0.06 |
| 323 | 603119 | 浙江荣泰 | 9,800 | 1,133,566.00 | 0.06 |
| 324 | 603508 | 思维列控 | 40,600 | 1,129,492.00 | 0.06 |
| 325 | 002649 | 博彦科技 | 85,200 | 1,123,788.00 | 0.06 |
| 326 | 600017 | 日照港 | 370,014 | 1,110,042.00 | 0.05 |
| 327 | 000099 | 中信海直 | 53,100 | 1,101,825.00 | 0.05 |
| 328 | 301155 | 海力风电 | 13,600 | 1,100,648.00 | 0.05 |
| 329 | 603328 | 依顿电子 | 99,655 | 1,092,218.80 | 0.05 |
| 330 | 002276 | 万马股份 | 64,300 | 1,087,313.00 | 0.05 |
| 331 | 002705 | 新宝股份 | 76,000 | 1,083,760.00 | 0.05 |
| 332 | 002544 | 普天科技 | 31,000 | 1,069,190.00 | 0.05 |
| 333 | 002003 | 伟星股份 | 98,900 | 1,048,340.00 | 0.05 |
| 334 | 301508 | 中机认检 | 33,500 | 1,047,210.00 | 0.05 |
| 335 | 001339 | 智微智能 | 20,300 | 1,037,533.00 | 0.05 |
| 336 | 600787 | 中储股份 | 183,600 | 1,031,832.00 | 0.05 |
| 337 | 603162 | 海通发展 | 85,200 | 1,025,808.00 | 0.05 |
| 338 | 300443 | 金雷股份 | 36,100 | 1,015,493.00 | 0.05 |
| 339 | 002698 | 博实股份 | 60,400 | 1,015,324.00 | 0.05 |
| 340 | 300416 | 苏试试验 | 56,900 | 1,015,096.00 | 0.05 |
| 341 | 605099 | 共创草坪 | 28,000 | 999,320.00 | 0.05 |
| 342 | 301626 | 苏州天脉 | 5,300 | 987,390.00 | 0.05 |
| 343 | 301589 | 诺瓦星云 | 6,000 | 987,300.00 | 0.05 |
| 344 | 603730 | 岱美股份 | 112,300 | 983,748.00 | 0.05 |
| 345 | 002867 | 周大生 | 77,800 | 947,604.00 | 0.05 |
| 346 | 688390 | 固德威 | 14,734 | 915,423.42 | 0.05 |
| 347 | 002541 | 鸿路钢构 | 55,000 | 904,200.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 348 | 600006 | 东风股份 | 122,600 | 880,268.00 | 0.04 |
| 349 | 300087 | 荃银高科 | 75,250 | 878,920.00 | 0.04 |
| 350 | 600531 | 豫光金铅 | 73,700 | 865,975.00 | 0.04 |
| 351 | 688631 | 莱斯信息 | 12,706 | 865,024.48 | 0.04 |
| 352 | 002572 | 索菲亚 | 63,100 | 858,791.00 | 0.04 |
| 353 | 002041 | 登海种业 | 89,086 | 849,880.44 | 0.04 |
| 354 | 002216 | 三全食品 | 74,120 | 836,814.80 | 0.04 |
| 355 | 603456 | 九洲药业 | 46,100 | 825,190.00 | 0.04 |
| 356 | 301363 | 美好医疗 | 34,300 | 824,915.00 | 0.04 |
| 357 | 601858 | 中国科传 | 45,000 | 816,750.00 | 0.04 |
| 358 | 301381 | 赛维时代 | 39,100 | 805,069.00 | 0.04 |
| 359 | 002019 | 亿帆医药 | 66,000 | 789,360.00 | 0.04 |
| 360 | 600773 | 西藏城投 | 63,700 | 789,243.00 | 0.04 |
| 361 | 603100 | 川仪股份 | 34,300 | 788,900.00 | 0.04 |
| 362 | 688400 | 凌云光 | 18,515 | 784,665.70 | 0.04 |
| 363 | 600459 | 贵研铂业 | 41,700 | 776,037.00 | 0.04 |
| 364 | 002727 | 一心堂 | 60,300 | 775,458.00 | 0.04 |
| 365 | 603220 | 中贝通信 | 36,300 | 773,190.00 | 0.04 |
| 366 | 300083 | 创世纪 | 83,100 | 765,351.00 | 0.04 |
| 367 | 301262 | 海看股份 | 30,200 | 751,678.00 | 0.04 |
| 368 | 300687 | 赛意信息 | 32,100 | 737,337.00 | 0.04 |
| 369 | 002588 | 史丹利 | 73,700 | 735,526.00 | 0.04 |
| 370 | 300035 | 中科电气 | 34,000 | 723,860.00 | 0.04 |
| 371 | 600651 | 飞乐音响 | 96,900 | 706,401.00 | 0.03 |
| 372 | 300363 | 博腾股份 | 30,300 | 704,172.00 | 0.03 |
| 373 | 003012 | 东鹏控股 | 107,300 | 702,815.00 | 0.03 |
| 374 | 003006 | 百亚股份 | 31,500 | 687,960.00 | 0.03 |
| 375 | 688612 | 威迈斯 | 20,786 | 685,314.42 | 0.03 |
| 376 | 600789 | 鲁抗医药 | 75,700 | 684,328.00 | 0.03 |
| 377 | 301087 | 可孚医疗 | 15,300 | 683,451.00 | 0.03 |
| 378 | 601089 | 福元医药 | 28,400 | 681,600.00 | 0.03 |
| 379 | 301571 | 国科天成 | 11,700 | 674,856.00 | 0.03 |
| 380 | 000603 | 盛达资源 | 21,400 | 662,544.00 | 0.03 |
| 381 | 605376 | 博迁新材 | 10,100 | 660,540.00 | 0.03 |
| 382 | 688519 | 南亚新材 | 8,112 | 655,936.32 | 0.03 |
| 383 | 603876 | 鼎胜新材 | 43,600 | 654,436.00 | 0.03 |
| 384 | 605198 | 安德利 | 17,200 | 647,064.00 | 0.03 |
| 385 | 600667 | 太极实业 | 81,100 | 646,367.00 | 0.03 |
| 386 | 300779 | 惠城环保 | 4,900 | 637,539.00 | 0.03 |
| 387 | 603283 | 赛腾股份 | 14,700 | 636,804.00 | 0.03 |
| 388 | 601208 | 东材科技 | 23,500 | 636,615.00 | 0.03 |
| 389 | 003039 | 顺控发展 | 37,100 | 591,003.00 | 0.03 |
| 390 | 000690 | 宝新能源 | 136,000 | 569,840.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 391 | 300244 | 迪安诊断 | 35,800 | 567,430.00 | 0.03 |
| 392 | 002745 | 木林森 | 57,400 | 549,318.00 | 0.03 |
| 393 | 688262 | 国芯科技 | 18,083 | 548,819.05 | 0.03 |
| 394 | 300080 | 易成新能 | 112,900 | 548,694.00 | 0.03 |
| 395 | 002654 | 万润科技 | 37,700 | 530,439.00 | 0.03 |
| 396 | 600761 | 安徽合力 | 25,200 | 526,428.00 | 0.03 |
| 397 | 002400 | 省广集团 | 59,331 | 526,265.97 | 0.03 |
| 398 | 002239 | 奥特佳 | 173,900 | 518,222.00 | 0.03 |
| 399 | 688091 | 上海谊众 | 10,874 | 511,078.00 | 0.03 |
| 400 | 301153 | 中科江南 | 20,200 | 499,344.00 | 0.02 |
| 401 | 600866 | 星湖科技 | 70,500 | 489,975.00 | 0.02 |
| 402 | 002373 | 千方科技 | 41,600 | 489,632.00 | 0.02 |
| 403 | 300723 | 一品红 | 14,200 | 476,410.00 | 0.02 |
| 404 | 600461 | 洪城环境 | 51,000 | 472,770.00 | 0.02 |
| 405 | 688185 | 康希诺 | 7,379 | 463,770.15 | 0.02 |
| 406 | 600971 | 恒源煤电 | 71,000 | 443,040.00 | 0.02 |
| 407 | 000089 | 深圳机场 | 63,300 | 442,467.00 | 0.02 |
| 408 | 300119 | 瑞普生物 | 23,200 | 435,464.00 | 0.02 |
| 409 | 600216 | 浙江医药 | 30,499 | 422,716.14 | 0.02 |
| 410 | 300294 | 博雅生物 | 18,700 | 422,620.00 | 0.02 |
| 411 | 300079 | 数码视讯 | 77,900 | 419,881.00 | 0.02 |
| 412 | 301565 | 中仑新材 | 17,200 | 415,208.00 | 0.02 |
| 413 | 688306 | 均普智能 | 34,600 | 401,360.00 | 0.02 |
| 414 | 002079 | 苏州固锴 | 41,204 | 393,498.20 | 0.02 |
| 415 | 600575 | 淮河能源 | 114,500 | 389,300.00 | 0.02 |
| 416 | 002882 | 金龙羽 | 12,300 | 370,968.00 | 0.02 |
| 417 | 000059 | 华锦股份 | 68,700 | 367,545.00 | 0.02 |
| 418 | 603306 | 华懋科技 | 5,600 | 352,856.00 | 0.02 |
| 419 | 603663 | 三祥新材 | 9,700 | 342,895.00 | 0.02 |
| 420 | 000917 | 电广传媒 | 32,500 | 334,100.00 | 0.02 |
| 421 | 301556 | 托普云农 | 3,300 | 323,532.00 | 0.02 |
| 422 | 601369 | 陕鼓动力 | 32,000 | 320,320.00 | 0.02 |
| 423 | 603009 | 北特科技 | 6,600 | 317,856.00 | 0.02 |
| 424 | 300319 | 麦捷科技 | 26,900 | 314,461.00 | 0.02 |
| 425 | 300493 | 润欣科技 | 15,544 | 312,278.96 | 0.02 |
| 426 | 002233 | 塔牌集团 | 34,300 | 309,043.00 | 0.02 |
| 427 | 601163 | 三角轮胎 | 21,400 | 305,806.00 | 0.02 |
| 428 | 688548 | 广钢气体 | 20,500 | 298,070.00 | 0.01 |
| 429 | 600325 | 华发股份 | 69,000 | 291,180.00 | 0.01 |
| 430 | 300821 | 东岳硅材 | 24,600 | 286,836.00 | 0.01 |
| 431 | 600718 | 东软集团 | 28,400 | 285,988.00 | 0.01 |
| 432 | 301297 | 富乐德 | 7,800 | 279,240.00 | 0.01 |
| 433 | 301345 | 涛涛车业 | 1,100 | 276,452.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 434 | 688696 | 极米科技 | 2,400 | 267,552.00 | 0.01 |
| 435 | 601975 | 招商南油 | 88,100 | 266,062.00 | 0.01 |
| 436 | 688552 | 航天南湖 | 7,300 | 265,136.00 | 0.01 |
| 437 | 603383 | 顶点软件 | 7,300 | 263,603.00 | 0.01 |
| 438 | 002635 | 安洁科技 | 18,800 | 260,568.00 | 0.01 |
| 439 | 600456 | 宝钛股份 | 6,200 | 244,590.00 | 0.01 |
| 440 | 002807 | 江阴银行 | 52,100 | 238,097.00 | 0.01 |
| 441 | 000795 | 英洛华 | 23,700 | 236,289.00 | 0.01 |
| 442 | 000680 | 山推股份 | 19,700 | 235,809.00 | 0.01 |
| 443 | 600269 | 赣粤高速 | 45,000 | 233,550.00 | 0.01 |
| 444 | 688717 | 艾罗能源 | 3,780 | 232,848.00 | 0.01 |
| 445 | 603612 | 索通发展 | 9,900 | 232,650.00 | 0.01 |
| 446 | 002690 | 美亚光电 | 11,250 | 231,412.50 | 0.01 |
| 447 | 600757 | 长江传媒 | 25,900 | 229,992.00 | 0.01 |
| 448 | 300607 | 拓斯达 | 6,800 | 223,992.00 | 0.01 |
| 449 | 600323 | 瀚蓝环境 | 7,800 | 223,080.00 | 0.01 |
| 450 | 300634 | 彩讯股份 | 8,700 | 219,501.00 | 0.01 |
| 451 | 002839 | 张家港行 | 48,000 | 219,360.00 | 0.01 |
| 452 | 601020 | 华钰矿业 | 8,100 | 217,566.00 | 0.01 |
| 453 | 301238 | 瑞泰新材 | 10,100 | 206,040.00 | 0.01 |
| 454 | 600675 | 中华企业 | 73,800 | 199,998.00 | 0.01 |
| 455 | 300809 | 华辰装备 | 5,200 | 197,964.00 | 0.01 |
| 456 | 000681 | 视觉中国 | 8,000 | 190,480.00 | 0.01 |
| 457 | 688048 | 长光华芯 | 1,519 | 190,406.65 | 0.01 |
| 458 | 300657 | 弘信电子 | 6,800 | 188,088.00 | 0.01 |
| 459 | 300088 | 长信科技 | 29,500 | 178,770.00 | 0.01 |
| 460 | 000650 | 仁和药业 | 31,100 | 175,715.00 | 0.01 |
| 461 | 688639 | 华恒生物 | 5,200 | 169,416.00 | 0.01 |
| 462 | 600618 | 氯碱化工 | 13,400 | 159,192.00 | 0.01 |
| 463 | 002913 | 奥士康 | 3,700 | 158,138.00 | 0.01 |
| 464 | 002390 | 信邦制药 | 49,100 | 158,102.00 | 0.01 |
| 465 | 300595 | 欧普康视 | 10,400 | 152,776.00 | 0.01 |
| 466 | 002928 | 华夏航空 | 13,100 | 144,755.00 | 0.01 |
| 467 | 002006 | 精工科技 | 6,000 | 138,960.00 | 0.01 |
| 468 | 301215 | 中汽股份 | 19,700 | 134,945.00 | 0.01 |
| 469 | 600020 | 中原高速 | 31,300 | 133,338.00 | 0.01 |
| 470 | 002716 | 湖南白银 | 18,600 | 128,712.00 | 0.01 |
| 471 | 600057 | 厦门象屿 | 14,400 | 122,688.00 | 0.01 |
| 472 | 601636 | 旗滨集团 | 19,400 | 115,042.00 | 0.01 |
| 473 | 600273 | 嘉化能源 | 12,500 | 109,250.00 | 0.01 |
| 474 | 300007 | 汉威科技 | 1,900 | 101,840.00 | 0.01 |
| 475 | 002275 | 桂林三金 | 6,200 | 87,420.00 | 0.00 |
| 476 | 600596 | 新安股份 | 7,050 | 80,863.50 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 477 | 603219 | 富佳股份 | 4,600 | 77,464.00 | 0.00 |
| 478 | 603194 | 中力股份 | 1,900 | 74,689.00 | 0.00 |
| 479 | 301047 | 义翘神州 | 1,100 | 74,360.00 | 0.00 |
| 480 | 600662 | 外服控股 | 14,800 | 74,296.00 | 0.00 |
| 481 | 002063 | 远光软件 | 12,000 | 72,840.00 | 0.00 |
| 482 | 300685 | 艾德生物 | 2,200 | 45,012.00 | 0.00 |
| 483 | 002249 | 大洋电机 | 4,100 | 44,690.00 | 0.00 |
| 484 | 600508 | 上海能源 | 3,286 | 38,676.22 | 0.00 |
| 485 | 300593 | 新雷能 | 1,100 | 32,736.00 | 0.00 |
| 486 | 301061 | 匠心家居 | 200 | 18,960.00 | 0.00 |
| 487 | 002960 | 青鸟消防 | 1,500 | 15,765.00 | 0.00 |
| 488 | 300455 | 航天智装 | 300 | 9,012.00 | 0.00 |
| 489 | 600446 | 金证股份 | 500 | 7,960.00 | 0.00 |
| 490 | 001914 | 招商积余 | 400 | 4,272.00 | 0.00 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|------------------|
| 1 | 002940 | 昂利康 | 250,400 | 8,393,408.00 | 0.41 |
| 2 | 002734 | 利民股份 | 403,700 | 6,434,978.00 | 0.32 |
| 3 | 002281 | 光迅科技 | 88,700 | 6,204,565.00 | 0.31 |
| 4 | 300604 | 长川科技 | 56,300 | 5,703,753.00 | 0.28 |
| 5 | 002137 | 实益达 | 624,600 | 5,359,068.00 | 0.26 |
| 6 | 300299 | 富春股份 | 637,100 | 4,523,410.00 | 0.22 |
| 7 | 300172 | 中电环保 | 792,100 | 4,316,945.00 | 0.21 |
| 8 | 000421 | 南京公用 | 613,800 | 4,241,358.00 | 0.21 |
| 9 | 002878 | 元隆雅图 | 224,400 | 4,088,568.00 | 0.20 |
| 10 | 002365 | 永安药业 | 257,900 | 3,847,868.00 | 0.19 |
| 11 | 600573 | 惠泉啤酒 | 320,200 | 3,819,986.00 | 0.19 |
| 12 | 300277 | 海联讯 | 290,500 | 3,791,025.00 | 0.19 |
| 13 | 688148 | 芳源股份 | 423,492 | 3,714,024.84 | 0.18 |
| 14 | 603682 | 锦和商管 | 561,400 | 3,699,626.00 | 0.18 |
| 15 | 600590 | 泰豪科技 | 378,300 | 3,559,803.00 | 0.18 |
| 16 | 001389 | 广合科技 | 42,900 | 3,501,927.00 | 0.17 |
| 17 | 688322 | 奥比中光 | 38,474 | 3,449,963.58 | 0.17 |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 37,900 | 3,435,256.00 | 0.17 |
| 19 | 002246 | 北化股份 | 189,900 | 3,421,998.00 | 0.17 |
| 20 | 002593 | 日上集团 | 574,800 | 3,397,068.00 | 0.17 |
| 21 | 688336 | 三生国健 | 54,215 | 3,229,587.55 | 0.16 |
| 22 | 002398 | 垒知集团 | 572,700 | 3,218,574.00 | 0.16 |
| 23 | 688108 | 赛诺医疗 | 163,600 | 3,147,664.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 24 | 000993 | 闽东电力 | 260,100 | 3,115,998.00 | 0.15 |
| 25 | 002950 | 奥美医疗 | 271,200 | 2,961,504.00 | 0.15 |
| 26 | 603367 | 辰欣药业 | 170,400 | 2,951,328.00 | 0.15 |
| 27 | 600571 | 信雅达 | 185,300 | 2,942,564.00 | 0.15 |
| 28 | 002811 | 郑中设计 | 190,900 | 2,832,956.00 | 0.14 |
| 29 | 300458 | 全志科技 | 66,800 | 2,807,604.00 | 0.14 |
| 30 | 600126 | 杭钢股份 | 337,900 | 2,757,264.00 | 0.14 |
| 31 | 000949 | 新乡化纤 | 471,800 | 2,594,900.00 | 0.13 |
| 32 | 600919 | 江苏银行 | 248,200 | 2,581,280.00 | 0.13 |
| 33 | 301052 | 果麦文化 | 66,100 | 2,524,359.00 | 0.12 |
| 34 | 002440 | 闰土股份 | 333,300 | 2,489,751.00 | 0.12 |
| 35 | 300898 | 熊猫乳品 | 87,700 | 2,361,761.00 | 0.12 |
| 36 | 300153 | 科泰电源 | 80,600 | 2,343,042.00 | 0.12 |
| 37 | 603697 | 有友食品 | 191,000 | 2,339,750.00 | 0.12 |
| 38 | 688280 | 精进电动 | 266,727 | 2,320,524.90 | 0.11 |
| 39 | 300283 | 温州宏丰 | 301,900 | 2,273,307.00 | 0.11 |
| 40 | 002636 | 金安国纪 | 135,600 | 2,265,876.00 | 0.11 |
| 41 | 301536 | 星辰科技 | 37,300 | 2,234,643.00 | 0.11 |
| 42 | 002803 | 吉宏股份 | 135,800 | 2,221,688.00 | 0.11 |
| 43 | 003015 | 日久光电 | 142,000 | 2,215,200.00 | 0.11 |
| 44 | 000601 | 韶能股份 | 469,300 | 2,205,710.00 | 0.11 |
| 45 | 600644 | 乐山电力 | 222,800 | 2,172,300.00 | 0.11 |
| 46 | 601086 | 国芳集团 | 211,100 | 2,146,887.00 | 0.11 |
| 47 | 688095 | 福昕软件 | 23,935 | 2,136,677.45 | 0.11 |
| 48 | 300033 | 同花顺 | 6,500 | 2,094,170.00 | 0.10 |
| 49 | 300570 | 太辰光 | 17,800 | 2,056,790.00 | 0.10 |
| 50 | 600598 | 北大荒 | 137,500 | 2,055,625.00 | 0.10 |
| 51 | 301365 | 矩阵股份 | 83,200 | 1,983,488.00 | 0.10 |
| 52 | 002942 | 新农股份 | 101,100 | 1,943,142.00 | 0.10 |
| 53 | 600795 | 国电电力 | 371,300 | 1,871,352.00 | 0.09 |
| 54 | 688373 | 盟科药业 | 305,228 | 1,843,577.12 | 0.09 |
| 55 | 688365 | 光云科技 | 105,062 | 1,772,395.94 | 0.09 |
| 56 | 603185 | 弘元绿能 | 58,100 | 1,772,050.00 | 0.09 |
| 57 | 301150 | 中一科技 | 41,800 | 1,755,182.00 | 0.09 |
| 58 | 002658 | 雪迪龙 | 191,700 | 1,731,051.00 | 0.09 |
| 59 | 603166 | 福达股份 | 109,000 | 1,711,300.00 | 0.08 |
| 60 | 002119 | 康强电子 | 103,400 | 1,702,998.00 | 0.08 |
| 61 | 300139 | 晓程科技 | 54,200 | 1,645,512.00 | 0.08 |
| 62 | 688772 | 珠海冠宇 | 73,400 | 1,580,302.00 | 0.08 |
| 63 | 600785 | 新华百货 | 116,100 | 1,573,155.00 | 0.08 |
| 64 | 300709 | 精研科技 | 33,300 | 1,570,428.00 | 0.08 |
| 65 | 002931 | 锋龙股份 | 49,200 | 1,559,640.00 | 0.08 |
| 66 | 603799 | 华友钴业 | 22,300 | 1,522,198.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 67 | 300945 | 曼卡龙 | 93,900 | 1,517,424.00 | 0.07 |
| 68 | 000017 | 深中华 A | 191,100 | 1,503,957.00 | 0.07 |
| 69 | 300805 | 电声股份 | 142,500 | 1,503,375.00 | 0.07 |
| 70 | 002248 | 华东数控 | 130,200 | 1,501,206.00 | 0.07 |
| 71 | 600392 | 盛和资源 | 69,700 | 1,500,641.00 | 0.07 |
| 72 | 600309 | 万华化学 | 19,400 | 1,487,592.00 | 0.07 |
| 73 | 002250 | 联化科技 | 110,200 | 1,474,476.00 | 0.07 |
| 74 | 300644 | 南京聚隆 | 38,800 | 1,432,108.00 | 0.07 |
| 75 | 688222 | 成都先导 | 60,732 | 1,424,165.40 | 0.07 |
| 76 | 688629 | 华丰科技 | 14,002 | 1,401,040.12 | 0.07 |
| 77 | 002165 | 红宝丽 | 182,800 | 1,381,968.00 | 0.07 |
| 78 | 300727 | 润禾材料 | 38,400 | 1,368,576.00 | 0.07 |
| 79 | 600031 | 三一重工 | 63,900 | 1,350,207.00 | 0.07 |
| 80 | 300043 | 星辉娱乐 | 234,700 | 1,326,055.00 | 0.07 |
| 81 | 002916 | 深南电路 | 5,700 | 1,324,053.00 | 0.07 |
| 82 | 002090 | 金智科技 | 110,600 | 1,305,080.00 | 0.06 |
| 83 | 688435 | 英方软件 | 27,178 | 1,271,115.06 | 0.06 |
| 84 | 002116 | 中国海诚 | 122,700 | 1,261,356.00 | 0.06 |
| 85 | 002016 | 世荣兆业 | 215,900 | 1,247,902.00 | 0.06 |
| 86 | 002181 | 粤传媒 | 143,500 | 1,236,970.00 | 0.06 |
| 87 | 300503 | 昊志机电 | 19,000 | 1,210,680.00 | 0.06 |
| 88 | 301338 | 凯格精机 | 13,700 | 1,207,107.00 | 0.06 |
| 89 | 688275 | 万润新能 | 15,836 | 1,194,034.40 | 0.06 |
| 90 | 002614 | 奥佳华 | 162,900 | 1,190,799.00 | 0.06 |
| 91 | 301038 | 深水规院 | 49,700 | 1,165,465.00 | 0.06 |
| 92 | 603890 | 春秋电子 | 72,100 | 1,162,973.00 | 0.06 |
| 93 | 300016 | 北陆药业 | 141,500 | 1,123,510.00 | 0.06 |
| 94 | 002558 | 巨人网络 | 25,900 | 1,121,211.00 | 0.06 |
| 95 | 300394 | 天孚通信 | 5,500 | 1,116,665.00 | 0.06 |
| 96 | 301558 | 三态股份 | 136,400 | 1,111,660.00 | 0.05 |
| 97 | 300684 | 中石科技 | 22,400 | 1,102,528.00 | 0.05 |
| 98 | 002624 | 完美世界 | 66,800 | 1,094,852.00 | 0.05 |
| 99 | 002467 | 二六三 | 179,700 | 1,094,373.00 | 0.05 |
| 100 | 002255 | 海陆重工 | 86,400 | 1,090,368.00 | 0.05 |
| 101 | 300100 | 双林股份 | 27,500 | 1,089,550.00 | 0.05 |
| 102 | 603008 | 喜临门 | 52,800 | 1,081,344.00 | 0.05 |
| 103 | 603466 | 风语筑 | 113,600 | 1,063,296.00 | 0.05 |
| 104 | 688499 | 利元亨 | 18,400 | 1,062,048.00 | 0.05 |
| 105 | 300735 | 光弘科技 | 42,300 | 1,051,578.00 | 0.05 |
| 106 | 300063 | 天龙集团 | 122,600 | 1,050,682.00 | 0.05 |
| 107 | 002587 | 奥拓电子 | 154,500 | 1,044,420.00 | 0.05 |
| 108 | 002184 | 海得控制 | 78,900 | 1,032,801.00 | 0.05 |
| 109 | 603986 | 兆易创新 | 4,800 | 1,028,400.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 110 | 000100 | TCL 科技 | 224,100 | 1,017,414.00 | 0.05 |
| 111 | 603181 | 皇马科技 | 69,300 | 990,297.00 | 0.05 |
| 112 | 002117 | 东港股份 | 71,300 | 984,653.00 | 0.05 |
| 113 | 300418 | 昆仑万维 | 23,500 | 979,950.00 | 0.05 |
| 114 | 600738 | 丽尚国潮 | 189,600 | 978,336.00 | 0.05 |
| 115 | 688031 | 星环科技 | 9,000 | 973,710.00 | 0.05 |
| 116 | 002404 | 嘉欣丝绸 | 137,900 | 966,679.00 | 0.05 |
| 117 | 603126 | 中材节能 | 143,300 | 962,976.00 | 0.05 |
| 118 | 600019 | 宝钢股份 | 128,600 | 958,070.00 | 0.05 |
| 119 | 600327 | 大东方 | 191,900 | 949,905.00 | 0.05 |
| 120 | 603489 | 八方股份 | 30,732 | 939,784.56 | 0.05 |
| 121 | 002286 | 保龄宝 | 105,100 | 939,594.00 | 0.05 |
| 122 | 600354 | 敦煌种业 | 141,500 | 915,505.00 | 0.05 |
| 123 | 300289 | 利德曼 | 129,700 | 904,009.00 | 0.04 |
| 124 | 301141 | 中科磁业 | 17,100 | 892,962.00 | 0.04 |
| 125 | 300787 | 海能实业 | 75,660 | 889,005.00 | 0.04 |
| 126 | 688220 | 翱捷科技 | 10,679 | 882,192.19 | 0.04 |
| 127 | 601956 | 东贝集团 | 122,000 | 869,860.00 | 0.04 |
| 128 | 600300 | 维维股份 | 243,900 | 856,089.00 | 0.04 |
| 129 | 002162 | 悦心健康 | 180,000 | 838,800.00 | 0.04 |
| 130 | 002765 | 蓝黛科技 | 62,000 | 828,940.00 | 0.04 |
| 131 | 301138 | 华研精机 | 21,100 | 818,680.00 | 0.04 |
| 132 | 300696 | 爱乐达 | 25,200 | 804,132.00 | 0.04 |
| 133 | 002406 | 远东传动 | 100,500 | 797,970.00 | 0.04 |
| 134 | 300995 | 奇德新材 | 18,900 | 780,759.00 | 0.04 |
| 135 | 300206 | 理邦仪器 | 60,028 | 767,758.12 | 0.04 |
| 136 | 300553 | 集智股份 | 19,000 | 767,410.00 | 0.04 |
| 137 | 688661 | 和林微纳 | 14,608 | 756,110.08 | 0.04 |
| 138 | 001376 | 百通能源 | 44,600 | 751,064.00 | 0.04 |
| 139 | 002669 | 康达新材 | 48,700 | 740,240.00 | 0.04 |
| 140 | 002981 | 朝阳科技 | 25,700 | 734,249.00 | 0.04 |
| 141 | 002863 | 今飞凯达 | 122,300 | 717,901.00 | 0.04 |
| 142 | 301021 | 英诺激光 | 14,600 | 710,290.00 | 0.04 |
| 143 | 002555 | 三七互娱 | 30,000 | 708,000.00 | 0.03 |
| 144 | 300381 | 溢多利 | 107,300 | 699,596.00 | 0.03 |
| 145 | 002185 | 华天科技 | 63,300 | 694,401.00 | 0.03 |
| 146 | 002553 | 南方精工 | 25,400 | 693,674.00 | 0.03 |
| 147 | 002846 | 英联股份 | 40,500 | 653,670.00 | 0.03 |
| 148 | 002153 | 石基信息 | 60,100 | 650,883.00 | 0.03 |
| 149 | 603956 | 威派格 | 99,900 | 645,354.00 | 0.03 |
| 150 | 600685 | 中船防务 | 22,500 | 640,125.00 | 0.03 |
| 151 | 002849 | 威星智能 | 39,500 | 628,050.00 | 0.03 |
| 152 | 300513 | 恒实科技 | 63,900 | 606,411.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 153 | 688385 | 复旦微电 | 7,900 | 582,230.00 | 0.03 |
| 154 | 600887 | 伊利股份 | 19,900 | 569,140.00 | 0.03 |
| 155 | 301082 | 久盛电气 | 31,655 | 566,624.50 | 0.03 |
| 156 | 688231 | 隆达股份 | 21,609 | 561,834.00 | 0.03 |
| 157 | 600982 | 宁波能源 | 125,600 | 545,104.00 | 0.03 |
| 158 | 688049 | 炬芯科技 | 10,309 | 542,253.40 | 0.03 |
| 159 | 002111 | 威海广泰 | 51,200 | 538,624.00 | 0.03 |
| 160 | 600965 | 福成股份 | 89,900 | 534,905.00 | 0.03 |
| 161 | 603980 | 吉华集团 | 105,880 | 533,635.20 | 0.03 |
| 162 | 002307 | 北新路桥 | 105,400 | 532,270.00 | 0.03 |
| 163 | 002826 | 易明医药 | 28,700 | 527,506.00 | 0.03 |
| 164 | 002386 | 天原股份 | 94,800 | 514,764.00 | 0.03 |
| 165 | 301611 | 珂玛科技 | 5,800 | 497,234.00 | 0.02 |
| 166 | 301299 | 卓创资讯 | 9,000 | 489,420.00 | 0.02 |
| 167 | 300274 | 阳光电源 | 2,700 | 461,808.00 | 0.02 |
| 168 | 603106 | 恒银科技 | 43,100 | 460,739.00 | 0.02 |
| 169 | 300219 | 鸿利智汇 | 63,900 | 460,719.00 | 0.02 |
| 170 | 000011 | 深物业 A | 50,965 | 459,194.65 | 0.02 |
| 171 | 603341 | 龙旗科技 | 10,400 | 439,504.00 | 0.02 |
| 172 | 300980 | 祥源新材 | 13,300 | 433,979.00 | 0.02 |
| 173 | 603901 | 永创智能 | 30,400 | 431,680.00 | 0.02 |
| 174 | 300380 | 安硕信息 | 10,300 | 426,111.00 | 0.02 |
| 175 | 600558 | 大西洋 | 69,100 | 421,510.00 | 0.02 |
| 176 | 002402 | 和而泰 | 10,400 | 406,848.00 | 0.02 |
| 177 | 301120 | 新特电气 | 23,500 | 405,845.00 | 0.02 |
| 178 | 300510 | 金冠股份 | 96,300 | 397,719.00 | 0.02 |
| 179 | 688720 | 艾森股份 | 5,600 | 394,128.00 | 0.02 |
| 180 | 688512 | 慧智微 | 34,700 | 387,252.00 | 0.02 |
| 181 | 002167 | 东方锆业 | 30,586 | 377,737.10 | 0.02 |
| 182 | 300403 | 汉宇集团 | 25,800 | 371,778.00 | 0.02 |
| 183 | 300400 | 劲拓股份 | 18,100 | 358,380.00 | 0.02 |
| 184 | 688396 | 华润微 | 6,700 | 354,162.00 | 0.02 |
| 185 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,900 | 351,463.00 | 0.02 |
| 186 | 300801 | 泰和科技 | 12,600 | 348,138.00 | 0.02 |
| 187 | 300502 | 新易盛 | 800 | 344,704.00 | 0.02 |
| 188 | 600617 | 国新能源 | 108,400 | 340,376.00 | 0.02 |
| 189 | 002172 | 澳洋健康 | 83,000 | 329,510.00 | 0.02 |
| 190 | 603115 | 海星股份 | 17,300 | 323,683.00 | 0.02 |
| 191 | 002975 | 博杰股份 | 4,200 | 323,400.00 | 0.02 |
| 192 | 000933 | 神火股份 | 11,200 | 307,664.00 | 0.02 |
| 193 | 000020 | 深华发 A | 21,900 | 303,753.00 | 0.01 |
| 194 | 002758 | 浙农股份 | 30,100 | 303,107.00 | 0.01 |
| 195 | 300921 | 南凌科技 | 13,100 | 300,907.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 196 | 688219 | 会通股份 | 23,800 | 295,596.00 | 0.01 |
| 197 | 300546 | 雄帝科技 | 11,200 | 293,328.00 | 0.01 |
| 198 | 300973 | 立高食品 | 6,800 | 292,400.00 | 0.01 |
| 199 | 600722 | 金牛化工 | 49,000 | 291,060.00 | 0.01 |
| 200 | 300129 | 泰胜风能 | 27,500 | 287,650.00 | 0.01 |
| 201 | 601939 | 建设银行 | 29,800 | 276,544.00 | 0.01 |
| 202 | 000050 | 深天马 A | 30,600 | 276,318.00 | 0.01 |
| 203 | 688084 | 晶品特装 | 3,333 | 275,972.40 | 0.01 |
| 204 | 688416 | 恒烁股份 | 5,000 | 275,650.00 | 0.01 |
| 205 | 300118 | 东方日升 | 18,800 | 275,608.00 | 0.01 |
| 206 | 002772 | 众兴菌业 | 18,100 | 264,079.00 | 0.01 |
| 207 | 600011 | 华能国际 | 35,300 | 263,338.00 | 0.01 |
| 208 | 000725 | 京东方 A | 62,500 | 263,125.00 | 0.01 |
| 209 | 601298 | 青岛港 | 30,200 | 251,868.00 | 0.01 |
| 210 | 301408 | 华人健康 | 13,400 | 248,704.00 | 0.01 |
| 211 | 300708 | 聚灿光电 | 26,800 | 237,984.00 | 0.01 |
| 212 | 600212 | 绿能慧充 | 29,500 | 237,475.00 | 0.01 |
| 213 | 688981 | 中芯国际 | 1,900 | 233,377.00 | 0.01 |
| 214 | 300221 | 银禧科技 | 22,200 | 229,104.00 | 0.01 |
| 215 | 300905 | 宝丽迪 | 7,100 | 228,833.00 | 0.01 |
| 216 | 000729 | 燕京啤酒 | 20,300 | 227,969.00 | 0.01 |
| 217 | 301022 | 海泰科 | 6,600 | 218,394.00 | 0.01 |
| 218 | 301009 | 可靠股份 | 16,900 | 214,292.00 | 0.01 |
| 219 | 002314 | 南山控股 | 73,700 | 210,045.00 | 0.01 |
| 220 | 002394 | 联发股份 | 13,100 | 207,766.00 | 0.01 |
| 221 | 300407 | 凯发电气 | 17,800 | 201,496.00 | 0.01 |
| 222 | 603211 | 晋拓股份 | 8,900 | 200,695.00 | 0.01 |
| 223 | 603811 | 诚意药业 | 18,900 | 198,450.00 | 0.01 |
| 224 | 300328 | 宜安科技 | 11,200 | 191,184.00 | 0.01 |
| 225 | 600082 | 海泰发展 | 43,600 | 177,016.00 | 0.01 |
| 226 | 300066 | 三川智慧 | 28,400 | 176,932.00 | 0.01 |
| 227 | 600071 | 凤凰光学 | 8,200 | 176,300.00 | 0.01 |
| 228 | 002414 | 高德红外 | 11,900 | 174,573.00 | 0.01 |
| 229 | 301305 | 朗坤科技 | 7,500 | 168,525.00 | 0.01 |
| 230 | 300018 | 中元股份 | 15,200 | 167,200.00 | 0.01 |
| 231 | 002970 | 锐明技术 | 3,400 | 164,900.00 | 0.01 |
| 232 | 600576 | 祥源文旅 | 26,100 | 162,864.00 | 0.01 |
| 233 | 002912 | 中新赛克 | 5,000 | 150,700.00 | 0.01 |
| 234 | 601898 | 中煤能源 | 12,100 | 150,524.00 | 0.01 |
| 235 | 002603 | 以岭药业 | 8,700 | 148,509.00 | 0.01 |
| 236 | 300847 | 中船汉光 | 8,500 | 145,690.00 | 0.01 |
| 237 | 000565 | 渝三峡 A | 19,900 | 145,270.00 | 0.01 |
| 238 | 002823 | 凯中精密 | 9,000 | 144,540.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 239 | 300719 | 安达维尔 | 7,900 | 143,069.00 | 0.01 |
| 240 | 000166 | 申万宏源 | 26,500 | 139,655.00 | 0.01 |
| 241 | 002085 | 万丰奥威 | 8,500 | 136,085.00 | 0.01 |
| 242 | 003041 | 真爱美家 | 2,500 | 135,825.00 | 0.01 |
| 243 | 002917 | 金奥博 | 10,100 | 135,138.00 | 0.01 |
| 244 | 600999 | 招商证券 | 8,100 | 134,784.00 | 0.01 |
| 245 | 688136 | 科兴制药 | 4,200 | 133,014.00 | 0.01 |
| 246 | 300310 | 宜通世纪 | 22,400 | 132,384.00 | 0.01 |
| 247 | 002156 | 通富微电 | 3,500 | 131,950.00 | 0.01 |
| 248 | 600526 | 菲达环保 | 24,300 | 130,248.00 | 0.01 |
| 249 | 605136 | 丽人丽妆 | 11,700 | 128,115.00 | 0.01 |
| 250 | 601010 | 文峰股份 | 46,000 | 125,580.00 | 0.01 |
| 251 | 603538 | 美诺华 | 6,500 | 125,060.00 | 0.01 |
| 252 | 002107 | 沃华医药 | 19,700 | 122,928.00 | 0.01 |
| 253 | 601218 | 吉鑫科技 | 24,000 | 121,440.00 | 0.01 |
| 254 | 603677 | 奇精机械 | 6,400 | 116,352.00 | 0.01 |
| 255 | 603917 | 合力科技 | 7,800 | 115,362.00 | 0.01 |
| 256 | 301028 | 鼎熔岩 | 7,800 | 113,724.00 | 0.01 |
| 257 | 300259 | 新天科技 | 25,100 | 111,444.00 | 0.01 |
| 258 | 600698 | 湖南天雁 | 12,000 | 108,480.00 | 0.01 |
| 259 | 688795 | 摩尔线程 | 258 | 107,374.44 | 0.01 |
| 260 | 001280 | 中国铀业 | 2,277 | 103,284.72 | 0.01 |
| 261 | 301178 | 天亿马 | 1,900 | 93,252.00 | 0.00 |
| 262 | 600980 | 北矿科技 | 3,800 | 87,324.00 | 0.00 |
| 263 | 600380 | 健康元 | 7,500 | 86,625.00 | 0.00 |
| 264 | 688202 | 美迪西 | 1,348 | 76,027.20 | 0.00 |
| 265 | 688668 | 鼎通科技 | 600 | 74,400.00 | 0.00 |
| 266 | 603296 | 华勤技术 | 800 | 72,592.00 | 0.00 |
| 267 | 002419 | 天虹股份 | 13,100 | 72,443.00 | 0.00 |
| 268 | 603109 | 神驰机电 | 2,800 | 72,212.00 | 0.00 |
| 269 | 000959 | 首钢股份 | 14,100 | 69,090.00 | 0.00 |
| 270 | 002560 | 通达股份 | 6,700 | 67,536.00 | 0.00 |
| 271 | 603585 | 苏利股份 | 3,500 | 66,010.00 | 0.00 |
| 272 | 603085 | 天成自控 | 5,400 | 63,990.00 | 0.00 |
| 273 | 301439 | 泓淋电力 | 4,100 | 61,131.00 | 0.00 |
| 274 | 300664 | 鹏鹞环保 | 10,400 | 55,744.00 | 0.00 |
| 275 | 000554 | 泰山石油 | 8,500 | 55,080.00 | 0.00 |
| 276 | 300698 | 万马科技 | 1,300 | 54,769.00 | 0.00 |
| 277 | 688809 | 强一股份 | 259 | 52,657.29 | 0.00 |
| 278 | 300358 | 楚天科技 | 5,300 | 51,887.00 | 0.00 |
| 279 | 300141 | 和顺电气 | 4,100 | 51,537.00 | 0.00 |
| 280 | 688255 | 凯尔达 | 1,400 | 51,282.00 | 0.00 |
| 281 | 000888 | 峨眉山 A | 3,800 | 49,856.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 282 | 000715 | 中兴商业 | 7,900 | 49,691.00 | 0.00 |
| 283 | 300515 | 三德科技 | 2,500 | 49,150.00 | 0.00 |
| 284 | 300867 | 圣元环保 | 2,400 | 45,744.00 | 0.00 |
| 285 | 688802 | 沐曦股份 | 102 | 40,729.62 | 0.00 |
| 286 | 603817 | 海峡环保 | 5,400 | 38,286.00 | 0.00 |
| 287 | 002728 | 特一药业 | 3,400 | 36,890.00 | 0.00 |
| 288 | 300681 | 英搏尔 | 1,400 | 35,084.00 | 0.00 |
| 289 | 600039 | 四川路桥 | 3,400 | 33,830.00 | 0.00 |
| 290 | 300753 | 爱朋医疗 | 1,100 | 30,525.00 | 0.00 |
| 291 | 001386 | 马可波罗 | 1,626 | 30,129.78 | 0.00 |
| 292 | 002284 | 亚太股份 | 2,000 | 29,860.00 | 0.00 |
| 293 | 688608 | 恒玄科技 | 100 | 22,694.00 | 0.00 |
| 294 | 688727 | 恒坤新材 | 563 | 19,631.81 | 0.00 |
| 295 | 688796 | 百奥赛图 | 423 | 17,871.75 | 0.00 |
| 296 | 301632 | 广东建科 | 656 | 15,534.08 | 0.00 |
| 297 | 301563 | 云汉芯城 | 110 | 14,705.90 | 0.00 |
| 298 | 301491 | 汉桑科技 | 245 | 13,501.95 | 0.00 |
| 299 | 002293 | 罗莱生活 | 1,300 | 13,351.00 | 0.00 |
| 300 | 603390 | 通达电气 | 1,000 | 13,070.00 | 0.00 |
| 301 | 001369 | 双欣环保 | 897 | 11,562.33 | 0.00 |
| 302 | 301609 | 山大电力 | 277 | 11,354.23 | 0.00 |
| 303 | 301687 | 新广益 | 195 | 10,606.05 | 0.00 |
| 304 | 688790 | 昂瑞微 | 86 | 10,078.34 | 0.00 |
| 305 | 301667 | 纳百川 | 151 | 8,617.57 | 0.00 |
| 306 | 688805 | 健信超导 | 265 | 8,578.05 | 0.00 |
| 307 | 603175 | 超颖电子 | 169 | 8,206.64 | 0.00 |
| 308 | 603092 | 德力佳 | 146 | 8,126.36 | 0.00 |
| 309 | 301668 | 昊创瑞通 | 165 | 7,392.00 | 0.00 |
| 310 | 003031 | 中瓷电子 | 100 | 7,316.00 | 0.00 |
| 311 | 301449 | 天溯计量 | 112 | 7,305.76 | 0.00 |
| 312 | 601026 | 道生天合 | 451 | 6,440.28 | 0.00 |
| 313 | 301575 | 艾芬达 | 126 | 6,243.30 | 0.00 |
| 314 | 603406 | 天富龙 | 153 | 6,144.48 | 0.00 |
| 315 | 002990 | 盛视科技 | 200 | 5,662.00 | 0.00 |
| 316 | 301389 | 隆扬电子 | 100 | 5,458.00 | 0.00 |
| 317 | 600188 | 兖矿能源 | 400 | 5,260.00 | 0.00 |
| 318 | 300201 | 海伦哲 | 600 | 4,098.00 | 0.00 |
| 319 | 001388 | 信通电子 | 94 | 4,036.36 | 0.00 |
| 320 | 603370 | 华新精科 | 82 | 3,800.70 | 0.00 |
| 321 | 001396 | 誉帆科技 | 69 | 2,441.91 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 300045 | 华力创通 | 78,810,073.00 | 6.11 |
| 2 | 600550 | 保变电气 | 74,615,654.08 | 5.78 |
| 3 | 300548 | 长芯博创 | 69,641,213.36 | 5.40 |
| 4 | 300170 | 汉得信息 | 68,707,912.33 | 5.32 |
| 5 | 600478 | 科力远 | 68,426,006.00 | 5.30 |
| 6 | 300113 | 顺网科技 | 67,511,079.53 | 5.23 |
| 7 | 688343 | 云天励飞 | 66,092,631.69 | 5.12 |
| 8 | 300180 | 华峰超纤 | 65,409,777.00 | 5.07 |
| 9 | 600100 | 同方股份 | 65,125,172.58 | 5.05 |
| 10 | 002400 | 省广集团 | 63,906,177.74 | 4.95 |
| 11 | 300570 | 太辰光 | 60,609,468.21 | 4.70 |
| 12 | 002204 | 大连重工 | 59,291,202.00 | 4.59 |
| 13 | 300409 | 道氏技术 | 58,526,680.39 | 4.53 |
| 14 | 601126 | 四方股份 | 57,687,401.24 | 4.47 |
| 15 | 688347 | 华虹公司 | 57,020,115.06 | 4.42 |
| 16 | 300026 | 红日药业 | 56,208,109.55 | 4.35 |
| 17 | 600782 | 新钢股份 | 55,887,868.00 | 4.33 |
| 18 | 002004 | 华邦健康 | 55,778,619.51 | 4.32 |
| 19 | 600320 | 振华重工 | 54,982,636.60 | 4.26 |
| 20 | 002378 | 章源钨业 | 54,587,875.89 | 4.23 |
| 21 | 688062 | 迈威生物 | 54,311,661.48 | 4.21 |
| 22 | 688336 | 三生国健 | 54,262,231.11 | 4.20 |
| 23 | 688327 | 云从科技 | 53,896,721.35 | 4.18 |
| 24 | 301316 | 慧博云通 | 53,829,133.64 | 4.17 |
| 25 | 603118 | 共进股份 | 52,763,821.00 | 4.09 |
| 26 | 301526 | 国际复材 | 52,704,155.00 | 4.08 |
| 27 | 600812 | 华北制药 | 52,608,038.00 | 4.08 |
| 28 | 688322 | 奥比中光 | 52,465,300.01 | 4.06 |
| 29 | 600006 | 东风股份 | 51,477,789.00 | 3.99 |
| 30 | 002626 | 金达威 | 51,167,849.00 | 3.96 |
| 31 | 600267 | 海正药业 | 50,814,324.00 | 3.94 |
| 32 | 002151 | 北斗星通 | 50,732,258.00 | 3.93 |
| 33 | 300456 | 赛微电子 | 50,711,073.00 | 3.93 |
| 34 | 603083 | 剑桥科技 | 50,512,518.00 | 3.91 |
| 35 | 002258 | 利尔化学 | 50,332,791.36 | 3.90 |
| 36 | 603236 | 移远通信 | 49,951,706.28 | 3.87 |
| 37 | 300184 | 力源信息 | 49,584,854.00 | 3.84 |
| 38 | 300493 | 润欣科技 | 48,698,332.68 | 3.77 |
| 39 | 002761 | 浙江建投 | 48,560,353.84 | 3.76 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 40 | 000837 | 秦川机床 | 47,843,935.00 | 3.71 |
| 41 | 002097 | 山河智能 | 47,193,426.31 | 3.66 |
| 42 | 600618 | 氯碱化工 | 47,024,512.59 | 3.64 |
| 43 | 600459 | 贵研铂业 | 46,443,886.57 | 3.60 |
| 44 | 601678 | 滨化股份 | 46,044,298.58 | 3.57 |
| 45 | 300101 | 振芯科技 | 45,751,247.00 | 3.54 |
| 46 | 300224 | 正海磁材 | 45,707,279.99 | 3.54 |
| 47 | 603005 | 晶方科技 | 45,635,063.29 | 3.54 |
| 48 | 688088 | 虹软科技 | 44,811,305.55 | 3.47 |
| 49 | 300468 | 四方精创 | 44,363,544.05 | 3.44 |
| 50 | 002901 | 大博医疗 | 44,314,754.70 | 3.43 |
| 51 | 002174 | 游族网络 | 43,817,445.00 | 3.39 |
| 52 | 688018 | 乐鑫科技 | 43,523,003.45 | 3.37 |
| 53 | 688321 | 微芯生物 | 43,429,773.99 | 3.36 |
| 54 | 000019 | 深粮控股 | 43,389,826.60 | 3.36 |
| 55 | 688306 | 均普智能 | 43,203,370.52 | 3.35 |
| 56 | 002815 | 崇达技术 | 42,705,646.00 | 3.31 |
| 57 | 000058 | 深赛格 | 42,565,110.00 | 3.30 |
| 58 | 300624 | 万兴科技 | 42,479,210.34 | 3.29 |
| 59 | 601519 | 大智慧 | 42,425,735.00 | 3.29 |
| 60 | 002249 | 大洋电机 | 42,323,519.00 | 3.28 |
| 61 | 002396 | 星网锐捷 | 42,044,474.00 | 3.26 |
| 62 | 688141 | 杰华特 | 42,024,946.48 | 3.26 |
| 63 | 000930 | 中粮科技 | 41,888,244.56 | 3.25 |
| 64 | 000969 | 安泰科技 | 41,777,059.00 | 3.24 |
| 65 | 688280 | 精进电动 | 41,641,737.72 | 3.23 |
| 66 | 601068 | 中铝国际 | 41,561,042.00 | 3.22 |
| 67 | 300634 | 彩讯股份 | 41,499,706.00 | 3.22 |
| 68 | 300913 | 兆龙互连 | 41,065,698.40 | 3.18 |
| 69 | 002402 | 和而泰 | 40,889,977.00 | 3.17 |
| 70 | 000756 | 新华制药 | 40,882,358.00 | 3.17 |
| 71 | 000597 | 东北制药 | 40,875,076.62 | 3.17 |
| 72 | 688660 | 电气风电 | 40,170,664.85 | 3.11 |
| 73 | 300768 | 迪普科技 | 40,073,675.50 | 3.10 |
| 74 | 688443 | 智翔金泰 | 40,011,051.88 | 3.10 |
| 75 | 600409 | 三友化工 | 39,866,241.30 | 3.09 |
| 76 | 300296 | 利亚德 | 39,504,544.00 | 3.06 |
| 77 | 301297 | 富乐德 | 39,423,371.08 | 3.05 |
| 78 | 000686 | 东北证券 | 39,318,297.00 | 3.05 |
| 79 | 600717 | 天津港 | 39,220,050.23 | 3.04 |
| 80 | 688331 | 荣昌生物 | 39,204,962.18 | 3.04 |
| 81 | 002011 | 盾安环境 | 39,064,894.00 | 3.03 |
| 82 | 601022 | 宁波远洋 | 38,738,147.00 | 3.00 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 83 | 002697 | 红旗连锁 | 38,678,309.00 | 3.00 |
| 84 | 300747 | 锐科激光 | 38,480,131.49 | 2.98 |
| 85 | 300620 | 光库科技 | 38,424,045.09 | 2.98 |
| 86 | 301171 | 易点天下 | 38,262,938.00 | 2.96 |
| 87 | 600210 | 紫江企业 | 38,117,147.00 | 2.95 |
| 88 | 002489 | 浙江永强 | 37,912,221.00 | 2.94 |
| 89 | 600597 | 光明乳业 | 37,767,387.00 | 2.93 |
| 90 | 688110 | 东芯股份 | 37,672,723.35 | 2.92 |
| 91 | 002276 | 万马股份 | 37,651,170.00 | 2.92 |
| 92 | 300257 | 开山股份 | 37,042,482.10 | 2.87 |
| 93 | 301095 | 广立微 | 36,972,638.63 | 2.86 |
| 94 | 601949 | 中国出版 | 36,898,570.00 | 2.86 |
| 95 | 300672 | 国科微 | 36,842,156.49 | 2.85 |
| 96 | 300925 | 法本信息 | 36,785,804.92 | 2.85 |
| 97 | 300171 | 东富龙 | 36,628,379.00 | 2.84 |
| 98 | 001337 | 四川黄金 | 36,543,285.24 | 2.83 |
| 99 | 688380 | 中微半导 | 36,447,071.98 | 2.82 |
| 100 | 000657 | 中钨高新 | 36,378,926.08 | 2.82 |
| 101 | 603533 | 掌阅科技 | 36,281,839.00 | 2.81 |
| 102 | 600075 | 新疆天业 | 36,244,865.00 | 2.81 |
| 103 | 002777 | 久远银海 | 36,236,118.00 | 2.81 |
| 104 | 300598 | 诚迈科技 | 36,121,852.30 | 2.80 |
| 105 | 688183 | 生益电子 | 36,055,059.73 | 2.79 |
| 106 | 688400 | 凌云光 | 35,886,799.30 | 2.78 |
| 107 | 000829 | 天音控股 | 35,849,223.00 | 2.78 |
| 108 | 688403 | 汇成股份 | 35,757,568.38 | 2.77 |
| 109 | 300232 | 洲明科技 | 35,677,805.00 | 2.76 |
| 110 | 601326 | 秦港股份 | 35,626,007.00 | 2.76 |
| 111 | 002243 | 力合科创 | 35,517,484.00 | 2.75 |
| 112 | 300303 | 聚飞光电 | 35,403,842.00 | 2.74 |
| 113 | 000422 | 湖北宜化 | 35,266,270.12 | 2.73 |
| 114 | 600601 | 方正科技 | 35,217,681.20 | 2.73 |
| 115 | 600458 | 时代新材 | 35,095,044.00 | 2.72 |
| 116 | 002755 | 奥赛康 | 35,065,600.30 | 2.72 |
| 117 | 600017 | 日照港 | 35,032,511.15 | 2.71 |
| 118 | 600718 | 东软集团 | 34,743,573.58 | 2.69 |
| 119 | 301175 | 中科环保 | 34,501,351.00 | 2.67 |
| 120 | 000600 | 建投能源 | 34,258,698.00 | 2.65 |
| 121 | 002010 | 传化智联 | 34,169,332.00 | 2.65 |
| 122 | 300079 | 数码视讯 | 34,161,946.00 | 2.65 |
| 123 | 000555 | 神州信息 | 34,091,535.00 | 2.64 |
| 124 | 002706 | 良信股份 | 33,933,202.00 | 2.63 |
| 125 | 300102 | 乾照光电 | 33,688,987.00 | 2.61 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 126 | 600635 | 大众公用 | 33,439,390.00 | 2.59 |
| 127 | 600710 | 苏美达 | 33,386,516.00 | 2.59 |
| 128 | 002315 | 焦点科技 | 33,368,832.00 | 2.59 |
| 129 | 002349 | 精华制药 | 33,234,312.00 | 2.57 |
| 130 | 002237 | 恒邦股份 | 33,151,780.66 | 2.57 |
| 131 | 688372 | 伟测科技 | 33,104,989.53 | 2.56 |
| 132 | 688107 | 安路科技 | 32,985,932.05 | 2.56 |
| 133 | 600780 | 通宝能源 | 32,938,968.02 | 2.55 |
| 134 | 000899 | 赣能股份 | 32,921,643.52 | 2.55 |
| 135 | 002038 | 双鹭药业 | 32,919,739.00 | 2.55 |
| 136 | 301511 | 德福科技 | 32,795,250.00 | 2.54 |
| 137 | 601609 | 金田股份 | 32,675,789.00 | 2.53 |
| 138 | 688270 | 臻镭科技 | 32,603,403.48 | 2.53 |
| 139 | 600557 | 康缘药业 | 32,593,020.00 | 2.53 |
| 140 | 300613 | 富瀚微 | 32,572,193.90 | 2.52 |
| 141 | 600366 | 宁波韵升 | 32,521,400.00 | 2.52 |
| 142 | 688177 | 百奥泰 | 32,261,552.81 | 2.50 |
| 143 | 002967 | 广电计量 | 32,097,861.00 | 2.49 |
| 144 | 300917 | 特发服务 | 31,983,060.12 | 2.48 |
| 145 | 301069 | 凯盛新材 | 31,935,818.00 | 2.47 |
| 146 | 688206 | 概伦电子 | 31,738,255.23 | 2.46 |
| 147 | 002091 | 江苏国泰 | 31,523,728.00 | 2.44 |
| 148 | 002458 | 益生股份 | 31,404,579.28 | 2.43 |
| 149 | 600063 | 皖维高新 | 31,365,537.00 | 2.43 |
| 150 | 301205 | 联特科技 | 31,306,190.00 | 2.43 |
| 151 | 300398 | 飞凯材料 | 31,252,644.00 | 2.42 |
| 152 | 603267 | 鸿远电子 | 31,082,724.80 | 2.41 |
| 153 | 301558 | 三态股份 | 31,078,925.00 | 2.41 |
| 154 | 688165 | 埃夫特 | 30,994,609.12 | 2.40 |
| 155 | 600623 | 华谊集团 | 30,954,921.00 | 2.40 |
| 156 | 688549 | 中巨芯 | 30,949,645.48 | 2.40 |
| 157 | 002048 | 宁波华翔 | 30,912,648.00 | 2.39 |
| 158 | 002222 | 福晶科技 | 30,909,760.59 | 2.39 |
| 159 | 000737 | 北方铜业 | 30,741,154.00 | 2.38 |
| 160 | 688629 | 华丰科技 | 30,494,699.30 | 2.36 |
| 161 | 603013 | 亚普股份 | 30,411,516.00 | 2.36 |
| 162 | 000030 | 富奥股份 | 30,411,125.00 | 2.36 |
| 163 | 600577 | 精达股份 | 30,406,430.00 | 2.36 |
| 164 | 002434 | 万里扬 | 30,398,138.00 | 2.36 |
| 165 | 002194 | 武汉凡谷 | 30,102,388.00 | 2.33 |
| 166 | 002015 | 协鑫能科 | 30,080,692.98 | 2.33 |
| 167 | 000612 | 焦作万方 | 30,015,856.17 | 2.33 |
| 168 | 300725 | 药石科技 | 29,928,139.82 | 2.32 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 169 | 002265 | 建设工业 | 29,877,607.00 | 2.31 |
| 170 | 600869 | 远东股份 | 29,877,568.00 | 2.31 |
| 171 | 301217 | 铜冠铜箔 | 29,760,217.00 | 2.31 |
| 172 | 688209 | 英集芯 | 29,592,534.32 | 2.29 |
| 173 | 002302 | 西部建设 | 29,517,140.92 | 2.29 |
| 174 | 002275 | 桂林三金 | 29,466,125.92 | 2.28 |
| 175 | 300674 | 宇信科技 | 29,435,363.10 | 2.28 |
| 176 | 600420 | 国药现代 | 29,291,525.56 | 2.27 |
| 177 | 300726 | 宏达电子 | 29,157,819.00 | 2.26 |
| 178 | 300166 | 东方国信 | 29,116,864.94 | 2.26 |
| 179 | 000550 | 江铃汽车 | 28,949,294.18 | 2.24 |
| 180 | 002456 | 欧菲光 | 28,712,533.45 | 2.22 |
| 181 | 603328 | 依顿电子 | 28,522,439.00 | 2.21 |
| 182 | 300008 | 天海防务 | 28,421,096.00 | 2.20 |
| 183 | 600619 | 海立股份 | 28,342,351.00 | 2.20 |
| 184 | 600675 | 中华企业 | 28,280,274.00 | 2.19 |
| 185 | 600338 | 西藏珠峰 | 28,273,090.00 | 2.19 |
| 186 | 603876 | 鼎胜新材 | 28,210,494.40 | 2.19 |
| 187 | 002946 | 新乳业 | 28,202,701.56 | 2.18 |
| 188 | 002101 | 广东鸿图 | 28,155,819.00 | 2.18 |
| 189 | 603915 | 国茂股份 | 28,106,659.96 | 2.18 |
| 190 | 600120 | 浙江东方 | 28,011,765.04 | 2.17 |
| 191 | 300348 | 长亮科技 | 28,011,430.00 | 2.17 |
| 192 | 002643 | 万润股份 | 27,681,501.50 | 2.14 |
| 193 | 600787 | 中储股份 | 27,553,808.00 | 2.13 |
| 194 | 300660 | 江苏雷利 | 27,537,601.44 | 2.13 |
| 195 | 300735 | 光弘科技 | 27,486,064.31 | 2.13 |
| 196 | 600480 | 凌云股份 | 27,430,263.40 | 2.13 |
| 197 | 002511 | 中顺洁柔 | 27,387,621.55 | 2.12 |
| 198 | 002414 | 高德红外 | 27,227,872.51 | 2.11 |
| 199 | 600313 | 农发种业 | 27,196,681.50 | 2.11 |
| 200 | 002312 | 川发龙蟒 | 27,108,421.00 | 2.10 |
| 201 | 601777 | 千里科技 | 26,907,395.00 | 2.08 |
| 202 | 300602 | 飞荣达 | 26,903,386.00 | 2.08 |
| 203 | 688192 | 迪哲医药 | 26,868,319.44 | 2.08 |
| 204 | 688779 | 五矿新能 | 26,837,064.34 | 2.08 |
| 205 | 688208 | 道通科技 | 26,835,457.58 | 2.08 |
| 206 | 002649 | 博彦科技 | 26,726,809.00 | 2.07 |
| 207 | 601107 | 四川成渝 | 26,718,325.00 | 2.07 |
| 208 | 000758 | 中色股份 | 26,618,074.02 | 2.06 |
| 209 | 002550 | 千红制药 | 26,586,570.00 | 2.06 |
| 210 | 300185 | 通裕重工 | 26,543,700.00 | 2.06 |
| 211 | 300183 | 东软载波 | 26,539,296.00 | 2.06 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 212 | 000767 | 晋控电力 | 26,494,803.00 | 2.05 |
| 213 | 603063 | 禾望电气 | 26,459,881.00 | 2.05 |
| 214 | 600305 | 恒顺醋业 | 26,267,397.00 | 2.04 |
| 215 | 002716 | 湖南白银 | 26,223,335.80 | 2.03 |
| 216 | 688502 | 茂莱光学 | 26,144,010.89 | 2.03 |
| 217 | 600961 | 株冶集团 | 26,041,470.00 | 2.02 |
| 218 | 002786 | 银宝山新 | 25,885,480.00 | 2.01 |
| 219 | 002487 | 大金重工 | 25,849,184.00 | 2.00 |
| 220 | 688048 | 长光华芯 | 25,837,690.70 | 2.00 |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 300045 | 华力创通 | 81,956,827.11 | 6.35 |
| 2 | 600550 | 保变电气 | 79,971,881.34 | 6.20 |
| 3 | 002204 | 大连重工 | 73,411,989.00 | 5.69 |
| 4 | 300170 | 汉得信息 | 70,443,892.09 | 5.46 |
| 5 | 688347 | 华虹公司 | 68,746,454.88 | 5.33 |
| 6 | 300180 | 华峰超纤 | 68,744,103.95 | 5.33 |
| 7 | 600478 | 科力远 | 67,553,907.67 | 5.23 |
| 8 | 002400 | 省广集团 | 66,279,245.38 | 5.13 |
| 9 | 002378 | 章源钨业 | 66,132,004.28 | 5.12 |
| 10 | 688343 | 云天励飞 | 65,935,024.78 | 5.11 |
| 11 | 300548 | 长芯博创 | 65,823,941.84 | 5.10 |
| 12 | 300113 | 顺网科技 | 64,574,401.17 | 5.00 |
| 13 | 002249 | 大洋电机 | 63,666,864.33 | 4.93 |
| 14 | 300570 | 太辰光 | 63,460,090.97 | 4.92 |
| 15 | 002151 | 北斗星通 | 62,941,619.60 | 4.88 |
| 16 | 600100 | 同方股份 | 59,610,354.24 | 4.62 |
| 17 | 603118 | 共进股份 | 59,175,525.60 | 4.58 |
| 18 | 600812 | 华北制药 | 58,707,694.00 | 4.55 |
| 19 | 300409 | 道氏技术 | 58,613,376.89 | 4.54 |
| 20 | 002626 | 金达威 | 58,495,966.78 | 4.53 |
| 21 | 300026 | 红日药业 | 56,667,520.81 | 4.39 |
| 22 | 600267 | 海正药业 | 55,730,759.00 | 4.32 |
| 23 | 300184 | 力源信息 | 55,427,524.90 | 4.29 |
| 24 | 301526 | 国际复材 | 55,251,758.99 | 4.28 |
| 25 | 688336 | 三生国健 | 55,085,944.40 | 4.27 |
| 26 | 002004 | 华邦健康 | 54,460,489.87 | 4.22 |
| 27 | 002396 | 星网锐捷 | 54,190,820.85 | 4.20 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 28 | 601126 | 四方股份 | 53,993,932.84 | 4.18 |
| 29 | 000837 | 秦川机床 | 53,207,135.00 | 4.12 |
| 30 | 688327 | 云从科技 | 52,937,818.69 | 4.10 |
| 31 | 600320 | 振华重工 | 52,461,626.39 | 4.06 |
| 32 | 600006 | 东风股份 | 52,446,243.00 | 4.06 |
| 33 | 000969 | 安泰科技 | 51,068,377.86 | 3.96 |
| 34 | 301316 | 慧博云通 | 50,654,141.65 | 3.92 |
| 35 | 600618 | 氯碱化工 | 50,106,124.31 | 3.88 |
| 36 | 688322 | 奥比中光 | 49,840,251.56 | 3.86 |
| 37 | 601068 | 中铝国际 | 49,587,390.00 | 3.84 |
| 38 | 002761 | 浙江建投 | 49,232,815.00 | 3.81 |
| 39 | 300493 | 润欣科技 | 49,207,336.27 | 3.81 |
| 40 | 600459 | 贵研铂业 | 49,134,562.00 | 3.81 |
| 41 | 603083 | 剑桥科技 | 49,101,603.00 | 3.80 |
| 42 | 688018 | 乐鑫科技 | 49,094,112.95 | 3.80 |
| 43 | 300634 | 彩讯股份 | 48,768,002.54 | 3.78 |
| 44 | 603236 | 移远通信 | 48,760,031.20 | 3.78 |
| 45 | 688306 | 均普智能 | 47,907,366.70 | 3.71 |
| 46 | 002258 | 利尔化学 | 47,669,822.40 | 3.69 |
| 47 | 600210 | 紫江企业 | 47,370,726.67 | 3.67 |
| 48 | 300456 | 赛微电子 | 47,370,006.80 | 3.67 |
| 49 | 300079 | 数码视讯 | 46,950,346.00 | 3.64 |
| 50 | 002489 | 浙江永强 | 46,037,402.00 | 3.57 |
| 51 | 300101 | 振芯科技 | 45,508,153.96 | 3.53 |
| 52 | 300398 | 飞凯材料 | 45,282,999.09 | 3.51 |
| 53 | 002815 | 崇达技术 | 44,775,184.00 | 3.47 |
| 54 | 600782 | 新钢股份 | 44,505,530.00 | 3.45 |
| 55 | 300232 | 洲明科技 | 44,277,124.30 | 3.43 |
| 56 | 300598 | 诚迈科技 | 43,907,482.71 | 3.40 |
| 57 | 002097 | 山河智能 | 43,710,731.00 | 3.39 |
| 58 | 301297 | 富乐德 | 43,534,950.80 | 3.37 |
| 59 | 300257 | 开山股份 | 43,516,594.46 | 3.37 |
| 60 | 601949 | 中国出版 | 43,201,122.02 | 3.35 |
| 61 | 002402 | 和而泰 | 42,715,463.00 | 3.31 |
| 62 | 000686 | 东北证券 | 42,515,131.80 | 3.29 |
| 63 | 688183 | 生益电子 | 41,789,326.13 | 3.24 |
| 64 | 601678 | 滨化股份 | 41,744,598.44 | 3.23 |
| 65 | 688280 | 精进电动 | 41,699,268.67 | 3.23 |
| 66 | 688321 | 微芯生物 | 41,523,032.37 | 3.22 |
| 67 | 688088 | 虹软科技 | 41,520,051.52 | 3.22 |
| 68 | 300468 | 四方精创 | 41,463,665.35 | 3.21 |
| 69 | 601519 | 大智慧 | 41,386,787.00 | 3.21 |
| 70 | 000058 | 深赛格 | 41,353,026.03 | 3.20 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 71 | 000756 | 新华制药 | 41,311,032.00 | 3.20 |
| 72 | 000930 | 中粮科技 | 41,119,999.00 | 3.19 |
| 73 | 688400 | 凌云光 | 40,942,997.58 | 3.17 |
| 74 | 688062 | 迈威生物 | 40,855,254.97 | 3.17 |
| 75 | 600017 | 日照港 | 40,656,543.57 | 3.15 |
| 76 | 600409 | 三友化工 | 40,609,273.76 | 3.15 |
| 77 | 002276 | 万马股份 | 39,964,998.90 | 3.10 |
| 78 | 000597 | 东北制药 | 39,714,468.30 | 3.08 |
| 79 | 300913 | 兆龙互连 | 39,593,465.31 | 3.07 |
| 80 | 600718 | 东软集团 | 39,545,942.56 | 3.06 |
| 81 | 300224 | 正海磁材 | 39,492,426.38 | 3.06 |
| 82 | 600717 | 天津港 | 39,421,398.13 | 3.05 |
| 83 | 002011 | 盾安环境 | 39,210,982.70 | 3.04 |
| 84 | 603005 | 晶方科技 | 39,144,405.86 | 3.03 |
| 85 | 000657 | 中钨高新 | 39,100,631.78 | 3.03 |
| 86 | 002434 | 万里扬 | 39,050,434.53 | 3.03 |
| 87 | 301171 | 易点天下 | 38,632,938.40 | 2.99 |
| 88 | 600601 | 方正科技 | 38,616,493.06 | 2.99 |
| 89 | 002901 | 大博医疗 | 38,210,272.04 | 2.96 |
| 90 | 300624 | 万兴科技 | 38,127,769.58 | 2.95 |
| 91 | 000829 | 天音控股 | 37,797,721.00 | 2.93 |
| 92 | 600557 | 康缘药业 | 37,699,133.20 | 2.92 |
| 93 | 300672 | 国科微 | 37,639,095.18 | 2.92 |
| 94 | 688110 | 东芯股份 | 37,350,357.30 | 2.89 |
| 95 | 600597 | 光明乳业 | 37,318,334.84 | 2.89 |
| 96 | 688403 | 汇成股份 | 37,277,354.47 | 2.89 |
| 97 | 688380 | 中微半导 | 37,212,826.37 | 2.88 |
| 98 | 300102 | 乾照光电 | 36,959,285.00 | 2.86 |
| 99 | 688209 | 英集芯 | 36,954,391.85 | 2.86 |
| 100 | 688331 | 荣昌生物 | 36,940,783.95 | 2.86 |
| 101 | 688660 | 电气风电 | 36,694,840.18 | 2.84 |
| 102 | 300296 | 利亚德 | 36,612,382.00 | 2.84 |
| 103 | 601022 | 宁波远洋 | 36,350,697.00 | 2.82 |
| 104 | 688372 | 伟测科技 | 36,104,547.98 | 2.80 |
| 105 | 002243 | 力合科创 | 36,090,192.92 | 2.80 |
| 106 | 600635 | 大众公用 | 36,030,079.00 | 2.79 |
| 107 | 002349 | 精华制药 | 35,952,437.49 | 2.79 |
| 108 | 600780 | 通宝能源 | 35,905,532.95 | 2.78 |
| 109 | 600531 | 豫光金铅 | 35,690,780.00 | 2.77 |
| 110 | 300039 | 上海凯宝 | 35,673,271.06 | 2.76 |
| 111 | 002697 | 红旗连锁 | 35,463,507.78 | 2.75 |
| 112 | 600075 | 新疆天业 | 35,361,798.10 | 2.74 |
| 113 | 600458 | 时代新材 | 35,252,212.00 | 2.73 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 114 | 600710 | 苏美达 | 35,194,306.40 | 2.73 |
| 115 | 002174 | 游族网络 | 35,118,962.00 | 2.72 |
| 116 | 603533 | 掌阅科技 | 34,940,069.00 | 2.71 |
| 117 | 688443 | 智翔金泰 | 34,850,611.59 | 2.70 |
| 118 | 688270 | 臻镭科技 | 34,703,789.92 | 2.69 |
| 119 | 300674 | 宇信科技 | 34,650,496.80 | 2.68 |
| 120 | 601609 | 金田股份 | 34,363,627.54 | 2.66 |
| 121 | 301069 | 凯盛新材 | 34,273,205.00 | 2.66 |
| 122 | 300735 | 光弘科技 | 34,227,270.06 | 2.65 |
| 123 | 300768 | 迪普科技 | 34,208,506.50 | 2.65 |
| 124 | 600420 | 国药现代 | 34,138,875.49 | 2.64 |
| 125 | 300747 | 锐科激光 | 33,964,389.86 | 2.63 |
| 126 | 002315 | 焦点科技 | 33,906,395.00 | 2.63 |
| 127 | 000737 | 北方铜业 | 33,639,967.10 | 2.61 |
| 128 | 300925 | 法本信息 | 33,518,702.00 | 2.60 |
| 129 | 688141 | 杰华特 | 33,339,458.14 | 2.58 |
| 130 | 688177 | 百奥泰 | 33,276,999.40 | 2.58 |
| 131 | 002015 | 协鑫能科 | 33,150,855.99 | 2.57 |
| 132 | 301205 | 联特科技 | 33,066,997.00 | 2.56 |
| 133 | 002706 | 良信股份 | 33,042,539.90 | 2.56 |
| 134 | 002414 | 高德红外 | 32,874,112.74 | 2.55 |
| 135 | 688165 | 埃夫特 | 32,731,569.39 | 2.54 |
| 136 | 000019 | 深粮控股 | 32,413,892.60 | 2.51 |
| 137 | 600869 | 远东股份 | 32,395,895.18 | 2.51 |
| 138 | 603766 | 隆鑫通用 | 32,326,595.89 | 2.50 |
| 139 | 300303 | 聚飞光电 | 32,302,362.87 | 2.50 |
| 140 | 000600 | 建投能源 | 32,136,891.00 | 2.49 |
| 141 | 000899 | 赣能股份 | 31,991,179.00 | 2.48 |
| 142 | 688629 | 华丰科技 | 31,967,718.13 | 2.48 |
| 143 | 002987 | 京北方 | 31,948,926.08 | 2.48 |
| 144 | 000550 | 江铃汽车 | 31,894,466.00 | 2.47 |
| 145 | 002237 | 恒邦股份 | 31,853,922.90 | 2.47 |
| 146 | 300171 | 东富龙 | 31,804,538.00 | 2.46 |
| 147 | 002302 | 西部建设 | 31,669,800.23 | 2.45 |
| 148 | 688502 | 茂莱光学 | 31,563,867.82 | 2.45 |
| 149 | 301175 | 中科环保 | 31,458,378.54 | 2.44 |
| 150 | 300725 | 药石科技 | 31,441,688.65 | 2.44 |
| 151 | 600667 | 太极实业 | 31,301,351.76 | 2.43 |
| 152 | 002777 | 久远银海 | 31,190,233.40 | 2.42 |
| 153 | 002194 | 武汉凡谷 | 31,076,683.40 | 2.41 |
| 154 | 600338 | 西藏珠峰 | 31,063,130.00 | 2.41 |
| 155 | 301511 | 德福科技 | 30,848,378.83 | 2.39 |
| 156 | 603888 | 新华网 | 30,690,574.10 | 2.38 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 157 | 600623 | 华谊集团 | 30,647,795.00 | 2.37 |
| 158 | 688107 | 安路科技 | 30,518,401.81 | 2.36 |
| 159 | 688206 | 概伦电子 | 30,342,223.51 | 2.35 |
| 160 | 600577 | 精达股份 | 30,339,771.00 | 2.35 |
| 161 | 002649 | 博彦科技 | 30,226,054.00 | 2.34 |
| 162 | 601326 | 秦港股份 | 30,214,290.00 | 2.34 |
| 163 | 002458 | 益生股份 | 30,211,985.66 | 2.34 |
| 164 | 300088 | 长信科技 | 30,162,278.00 | 2.34 |
| 165 | 002275 | 桂林三金 | 30,105,998.04 | 2.33 |
| 166 | 603876 | 鼎胜新材 | 30,061,291.20 | 2.33 |
| 167 | 301558 | 三态股份 | 29,977,484.00 | 2.32 |
| 168 | 002265 | 建设工业 | 29,925,796.00 | 2.32 |
| 169 | 300166 | 东方国信 | 29,838,516.00 | 2.31 |
| 170 | 000030 | 富奥股份 | 29,708,161.00 | 2.30 |
| 171 | 600640 | 国脉文化 | 29,667,694.00 | 2.30 |
| 172 | 603328 | 依顿电子 | 29,607,281.23 | 2.29 |
| 173 | 002010 | 传化智联 | 29,494,722.50 | 2.29 |
| 174 | 002643 | 万润股份 | 29,476,627.50 | 2.28 |
| 175 | 002456 | 欧菲光 | 29,420,065.72 | 2.28 |
| 176 | 600305 | 恒顺醋业 | 29,365,679.46 | 2.28 |
| 177 | 688128 | 中国电研 | 29,208,277.95 | 2.26 |
| 178 | 300613 | 富瀚微 | 29,181,710.18 | 2.26 |
| 179 | 002773 | 康弘药业 | 28,992,430.14 | 2.25 |
| 180 | 300620 | 光库科技 | 28,738,848.50 | 2.23 |
| 181 | 600063 | 皖维高新 | 28,738,785.60 | 2.23 |
| 182 | 600480 | 凌云股份 | 28,665,571.30 | 2.22 |
| 183 | 300602 | 飞荣达 | 28,632,614.58 | 2.22 |
| 184 | 300183 | 东软载波 | 28,621,012.00 | 2.22 |
| 185 | 600675 | 中华企业 | 28,602,843.00 | 2.22 |
| 186 | 002048 | 宁波华翔 | 28,375,660.00 | 2.20 |
| 187 | 688549 | 中巨芯 | 28,366,611.06 | 2.20 |
| 188 | 601107 | 四川成渝 | 28,305,716.00 | 2.19 |
| 189 | 301095 | 广立微 | 28,189,563.00 | 2.18 |
| 190 | 002550 | 千红制药 | 28,184,448.00 | 2.18 |
| 191 | 603267 | 鸿远电子 | 28,090,819.00 | 2.18 |
| 192 | 000901 | 航天科技 | 27,886,277.68 | 2.16 |
| 193 | 002716 | 湖南白银 | 27,791,453.96 | 2.15 |
| 194 | 600313 | 农发种业 | 27,685,036.65 | 2.14 |
| 195 | 000422 | 湖北宜化 | 27,456,703.00 | 2.13 |
| 196 | 300315 | 掌趣科技 | 27,432,491.00 | 2.13 |
| 197 | 300660 | 江苏雷利 | 27,426,858.60 | 2.12 |
| 198 | 002786 | 银宝山新 | 27,391,261.00 | 2.12 |
| 199 | 300726 | 宏达电子 | 27,370,941.00 | 2.12 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 200 | 002312 | 川发龙蟒 | 27,344,163.00 | 2.12 |
| 201 | 601369 | 陕鼓动力 | 27,335,720.00 | 2.12 |
| 202 | 300363 | 博腾股份 | 27,286,291.00 | 2.11 |
| 203 | 301293 | 三博脑科 | 27,280,372.10 | 2.11 |
| 204 | 688192 | 迪哲医药 | 27,272,459.40 | 2.11 |
| 205 | 300348 | 长亮科技 | 27,184,163.54 | 2.11 |
| 206 | 600728 | 佳都科技 | 27,016,347.21 | 2.09 |
| 207 | 600961 | 株冶集团 | 26,922,870.44 | 2.09 |
| 208 | 301217 | 铜冠铜箔 | 26,790,608.04 | 2.08 |
| 209 | 600966 | 博汇纸业 | 26,784,116.00 | 2.08 |
| 210 | 002747 | 埃斯顿 | 26,775,082.00 | 2.07 |
| 211 | 688048 | 长光华芯 | 26,765,378.96 | 2.07 |
| 212 | 000758 | 中色股份 | 26,714,369.21 | 2.07 |
| 213 | 000555 | 神州信息 | 26,697,879.00 | 2.07 |
| 214 | 002913 | 奥士康 | 26,663,521.00 | 2.07 |
| 215 | 600059 | 古越龙山 | 26,657,008.00 | 2.07 |
| 216 | 001337 | 四川黄金 | 26,566,411.00 | 2.06 |
| 217 | 000612 | 焦作万方 | 26,505,259.52 | 2.05 |
| 218 | 603915 | 国茂股份 | 26,152,509.00 | 2.03 |
| 219 | 688235 | 百济神州 | 26,061,119.24 | 2.02 |
| 220 | 002539 | 云图控股 | 25,931,935.00 | 2.01 |
| 221 | 603171 | 税友股份 | 25,874,820.00 | 2.00 |
| 222 | 603013 | 亚普股份 | 25,865,636.20 | 2.00 |
| 223 | 688185 | 康希诺 | 25,834,574.27 | 2.00 |
| 224 | 002906 | 华阳集团 | 25,819,255.76 | 2.00 |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|-------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 19,837,472,298.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 19,745,329,404.53 |

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金可投资国债期货。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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 4,634,649.60 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,979,318.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,613,968.45 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份 额 | 持有人结构 | | | |
|--------------------|--------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份 额比 例 | 持有份额 | 占总份 额比 例 |
| 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 43,538 | 16,170.80 | 334,642,504.37 | 47.53% | 369,401,928.18 | 52.47% |
| 国泰海通中证 | 79,377 | 8,499.65 | 259,890,738.73 | 38.52% | 414,785,821.60 | 61.48% |

| | | | | | | |
|-------------|---------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
| 1000 指数增强 C | | | | | | |
| 合计 | 122,915 | 11,216.87 | 594,533,243.10 | 43.12% | 784,187,749.78 | 56.88% |

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 2,564,272.79 | 0.3642% |
| | 国泰海通中证 1000 指数增强 C | 2,749,721.84 | 0.4076% |
| | 合计 | 5,313,994.63 | 0.3854% |

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|--------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | >100 |
| | 国泰海通中证 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 | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | >100 |
| | 国泰海通中证 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（含基金投资和部门负责人）和基金经理的，其持有份额总量的数量区间分别计算在内。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国泰海通中证 1000 指数增强 A | 国泰海通中证 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 | 850,631,304.03 | 1,769,289,613.89 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 778,142,428.39 | 1,693,317,719.05 |
| 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 | 704,044,432.55 | 674,676,560.33 |

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陶耿同志担任公司董事长，谢乐斌同志不再担任公司董事长，生效日期为 2025 年 4 月 25 日。

2025 年 9 月 30 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、公司章程（2025 年 7 月修订）规定，公司不再设职工监事，原公司第二届第二次职工代表大会选举产生的职工监事王红莲不再任职公司职工监事。

2025 年 10 月 14 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据公司章程规定，经公司股东国泰海通证券股份有限公司研究决定，董博阳同志不再担任公司监事职务。

2025 年 12 月 25 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，左秀海同志担任公司副总裁，生效日期为 2025 年 12 月 24 日。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

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。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 48,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为 2024 年 11 月 5 日至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|-------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰海 | 2 | 39,043,603,926.8 | 98.64% | 2,783,445.2 | 98.57% | - |

| | | | | | | |
|------------------------|---|----------------|-------|-----------|-------|---|
| 通证券 股份有 限公司 | | 2 | | 2 | | |
| 光大证 券股份 有限公 司 | 2 | 536,541,318.96 | 1.36% | 40,439.32 | 1.43% | - |
| 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。

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-------------------------------|------------|
| 1 | 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 | 上海证券报、中国证券报、证 | 2025-04-22 |

| | | | |
|----|---|--|------------|
| | 限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告 | 券时报、证券日报 | |
| 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 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-07-21 |
| 14 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 2 季度报告提示性公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025-07-21 |
| 15 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告 | 证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-07-25 |
| 16 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025-07-26 |
| 17 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-02 |
| 18 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-02 |
| 19 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 1 号） | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-02 |
| 20 | 关于上海国泰海通证券资产管理有限公司管理人官网地址变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-08-09 |
| 21 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-15 |
| 22 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-15 |
| 23 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 2 号） | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-15 |

| | | | |
|----|--|--|------------|
| 24 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司关于吸收合并事项通知债权人的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-08-27 |
| 25 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025-08-29 |
| 26 | 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-08-29 |
| 27 | 上海国泰海通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 | 2025-09-05 |
| 28 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-09-26 |
| 29 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-29 |
| 30 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-29 |
| 31 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-29 |
| 32 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-29 |
| 33 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金（更新）（2025 年第 3 号） | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-29 |
| 34 | 关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-10-14 |
| 35 | 国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-10-28 |
| 36 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 3 季度报告提示性公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025-10-28 |
| 37 | 上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-12-25 |
| 38 | 在本报告期内刊登的其他公告 | - | - |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<https://www.gthtzg.com>。

13.3 查阅方式

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

上海国泰海通证券资产管理有限公司

二〇二六年三月三十一日