

国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13

§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰海通沪深 300 指数增强发起	
基金主代码	018257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 04 月 19 日	
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 774, 160, 747. 95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通沪深 300 指数增强发起 A	国泰海通沪深 300 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	018257	018258
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 029, 166, 953. 63 份	744, 993, 794. 32 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。国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金由国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更而来。国泰海通沪深 300 指数增强型发起式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，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、参与股指期货交易策略、参

	与国债期货交易策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	汪小敏
	联系电话	95521	021-31888888
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		95521	95528
传真		021-38871190	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200011	200126
法定代表人		陶耿	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gthtzg.com
基金中期报告置备地点	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	国泰海通沪深 300 指数增强发起 A	国泰海通沪深 300 指数增强发起 C
本期已实现收益	139,032,391.36	91,955,123.22
本期利润	188,392,536.87	123,785,889.18
加权平均基金份额本期利润	0.2008	0.1952
本期加权平均净值利润率	14.66%	14.40%
本期基金份额净值增长率	15.29%	15.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	427,782,565.80	296,302,953.19
期末可供分配基金份额利润	0.4157	0.3977
期末基金资产净值	1,522,897,952.04	1,088,367,406.04
期末基金份额净值	1.4797	1.4609
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	47.97%	46.09%

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

国泰海通沪深 300 指数增强发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.53%	1.12%	11.30%	1.19%	3.23%	-0.07%
过去六个月	15.29%	1.06%	7.20%	1.07%	8.09%	-0.01%
过去一年	38.38%	0.95%	25.13%	0.97%	13.25%	-0.02%
过去三年	51.66%	1.06%	28.26%	1.06%	23.40%	0.00%
自基金合同生效起至今	47.97%	1.05%	18.90%	1.04%	29.07%	0.01%

国泰海通沪深 300 指数增强发起 C 净值表现

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

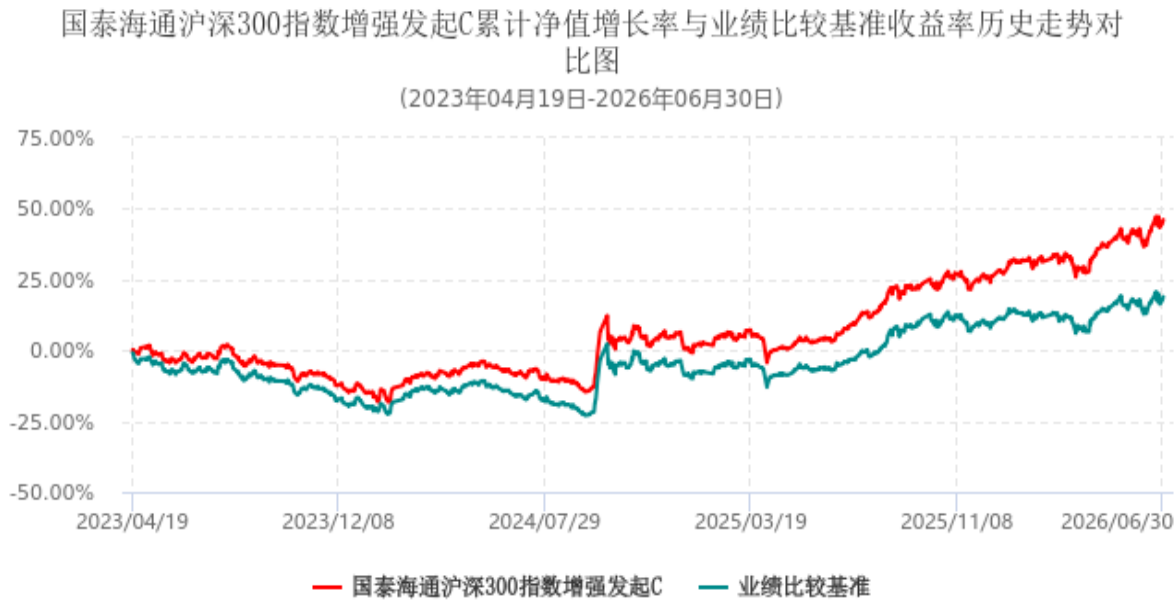
	增长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	14.42%	1.12%	11.30%	1.19%	3.12%	-0.07%
过去六个月	15.06%	1.06%	7.20%	1.07%	7.86%	-0.01%
过去一年	37.83%	0.95%	25.13%	0.97%	12.70%	-0.02%
过去三年	49.85%	1.06%	28.26%	1.06%	21.59%	0.00%
自基金合同生 效起至今	46.09%	1.05%	18.90%	1.04%	27.19%	0.01%

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

国泰海通沪深300指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023年04月19日-2026年06月30日)





§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2026 年 6 月 30 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 80 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证 券 从 业 年	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
胡崇海	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。	2023-04-19	-	15 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。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，

通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 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

2026 年上半年 A 股整体震荡上行，但月度节奏与结构明显分化。一季度初受益于春季躁动、政策偏暖和科技成长主线，风险偏好较高；2 月受海外利率偏紧、美债收益率走高和获利回吐影响，市场震荡整固，节后在宏观数据偏强和政策预期修复下，科技成长、资源品与部分顺周期方向轮动活跃。3 月受中东地缘冲突升级、能源价格攀升和美联储降息预期后移冲击，风险偏好快速下降，贵金属、煤炭、公用事业等防御方向阶段性占优。二季度市场逐步修复，稳定资本市场、支持新质生产力和科技创新的政策取向，叠加业绩验证，带动风险偏好回升。5 月结构性分化加剧，机会向 AI 算力、半导体、通信、电子、先进制造等产业趋势明确的方向集中。6 月转为高位波动，受海外流动性预期和半年末资金压力影响，资金面维持紧平衡。总体而言，上半年科技成长、硬科技和部分先进制造表现突出，传统消费、金融及红利类资产相对承压，市场机会主要由产业趋势、盈利预期和资金偏好共同驱动。上半年，沪深 300 指数（涨幅 7.55%）表现相对较弱，弱于中证 500 指数（涨幅 20.97%）、中证 1000 指数（涨幅 15.99%）、创业板综指（涨幅 24.15%）和科创综指（涨幅 53.99%）。

从主要风险因子表现看，动量和残差波动因子在上半年走势连续性较强，其中动量因子持续贡献正向收益，仅在 6 月末出现小幅度回调，市场整体动量效应显著。行业层面，科技成长赛道一骑绝尘，AI 算力、半导体、光模块、消费电子等高景气科技主线持续，资金向少数主线板块高度集中，传统消费与金融板块持续走弱。2026 年上半年 A 股 31 个申万一级行业中共有十个行业录得上涨，其余均为下跌，其中电子行业大涨 86.29%，通信上涨 73.59%，双双占据申万一级行业涨幅前二。Alpha 表现方面，价量类因子整体优于基本面因子。

我们的量化投资体系独立自洽，不盲从市场“宏大叙事”，始终坚持一贯的投资理念和组合管理方法。通过挖掘有逻辑支撑的 Alpha 因子、持续优化底层模型和定期监控策略表现，力求稳定投资者的超额收益预期。在增强层面，我们结合低相关性的基本面财务信号和实时量价信号，借助机器学习筛选因子，并严格控制组合在行业 and 主要市场风险上相对基准的暴露，以较为稳健的方式增

强沪深 300 指数，使两类信号协同共振，同时根据市场流动性与波动率动态优化。策略本质上是通过积少成多、以概率取胜来增厚收益，因此更需要投资者长期持有。当前沪深 300 指数估值仍处于历史相对合理区间，在复杂经济环境下具备较稳定的盈利能力和股东回报特征，具有一定投资性价比。我们将通过科学手段持续提升量化模型的超额收益能力，力争为投资者创造长期优质的投资体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值为 1.4797 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 15.29%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；截至报告期末国泰海通沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值为 1.4609 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 15.06%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

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 年下半年，A 股市场有望在国内经济结构转型、政策支持和流动性合理充裕的背景下保持韧性，指数层面或以震荡消化和结构轮动为主。科技成长仍有产业趋势和盈利扩张支撑，AI 算力、半导体、先进制造、创新药等方向具备中长期机会，但前期强势板块估值和交易拥挤度较高，后续表现将更多取决于中报及后续业绩兑现，内部或由主题扩散转向景气筛选。随着市场宽度变化，顺周期、制造出海、证券、消费修复及红利低波等方向也可能出现阶段性机会。总体来看，下半年市场仍具备结构性机会，需要在产业景气、盈利质量、估值水平和交易拥挤度之间保持平衡，并关注海外流动性变化和地缘风险对风险偏好的扰动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	200,743,742.51	198,350,210.78
结算备付金		19,225,327.72	17,600,946.17

存出保证金		7,373,677.08	3,995,824.14
交易性金融资产	6.4.7.2	2,406,033,317.99	1,673,846,524.02
其中：股票投资		2,406,033,317.99	1,673,846,524.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,795,987.64	2,101,919.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,642,172,052.94	1,895,895,424.27
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		27,955,023.36	86,647,805.85

应付管理人报酬		2,072,950.57	1,647,060.30
应付托管费		310,942.61	247,059.04
应付销售服务费		347,044.83	261,468.84
应付投资顾问费		—	—
应交税费		94,064.78	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	126,668.71	173,042.61
负债合计		30,906,694.86	88,976,436.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,774,160,747.95	1,413,383,631.20
未分配利润	6.4.7.8	837,104,610.13	393,535,356.43
净资产合计		2,611,265,358.08	1,806,918,987.63
负债和净资产总计		2,642,172,052.94	1,895,895,424.27

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,774,160,747.95 份。其中国泰海通沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值 1.4797 元，基金份额总额 1,029,166,953.63 份；国泰海通沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值 1.4609 元，基金份额总额 744,993,794.32 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		326,164,791.39	28,973,413.64
1. 利息收入		180,018.34	223,300.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	169,819.38	172,462.37

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		10,198.96	50,838.08
2. 投资收益（损失以“-”填列）		243,584,248.33	9,786,190.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	218,944,188.30	-9,810,031.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	3,979,321.41	-2,015,927.18
股利收益	6.4.7.12	20,660,738.62	21,612,149.02
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	81,190,911.47	18,281,421.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,209,613.25	682,501.03
减：二、营业总支出		13,986,365.34	13,579,392.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,596,650.61	9,910,839.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,589,497.62	1,486,625.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,698,772.60	2,091,203.06
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		14,690.58	227.16
8. 其他费用	6.4.7.15	86,753.93	90,496.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		312,178,426.05	15,394,021.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		312,178,426.05	15,394,021.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		312,178,426.05	15,394,021.61

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,413,383,631.20	393,535,356.43	1,806,918,987.63
二、本期期初净资产	1,413,383,631.20	393,535,356.43	1,806,918,987.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	360,777,116.75	443,569,253.70	804,346,370.45
（一）、综合收益总额	-	312,178,426.05	312,178,426.05
（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）	360,777,116.75	131,390,827.65	492,167,944.40
其中：1. 基金申购款	1,134,031,090.72	414,706,664.44	1,548,737,755.16
2. 基金赎回款	-773,253,973.97	-283,315,836.79	-1,056,569,810.76
（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	1,774,160,747.95	837,104,610.13	2,611,265,358.08
项 目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,729,604,528.22	85,975,716.31	1,815,580,244.53
二、本期期初净资产	1,729,604,528.22	85,975,716.31	1,815,580,244.53

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-81,913,161.98	21,095,245.91	-60,817,916.07
（一）、综合收益总额	-	15,394,021.61	15,394,021.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-81,913,161.98	5,701,224.30	-76,211,937.68
其中：1. 基金申购款	963,268,490.54	41,760,346.31	1,005,028,836.85
2. 基金赎回款	- 1,045,181,652.52	-36,059,122.01	- 1,081,240,774.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,647,691,366.24	107,070,962.22	1,754,762,328.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

叶明	叶明	王红莲
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更而来。国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2023 年 3 月 16 日证监许可【2023】568 号文注册募集。《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 19 日正式生效。

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，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金，《国泰海通沪深 300 指数增强型发起式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《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 15,019,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资

者认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券(包括存托凭证、下同)、备选成份券(包括存托凭证、下同)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	87,673,181.74
等于：本金	87,667,819.50
加：应计利息	5,362.24
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	113,070,560.77
等于：本金	113,068,724.57
加：应计利息	1,836.20
减：坏账准备	—
合计	200,743,742.51

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,269,161,727.51	—	2,406,033,317.99	136,871,590.48
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,269,161,727.51	—	2,406,033,317.99	136,871,590.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	60,096,529.04	—	—	—
一股指期货	60,096,529.04	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	60,096,529.04	—	—	—

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2608	IF2608	2	2,927,520.00	19,746.67
IF2609	IF2609	33	48,013,020.00	459,064.29
IF2612	IF2612	7	9,998,940.00	364,140.00

合计				842,950.96
减：可抵销期货暂收款				842,950.96
净额				0.00

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31,034.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	23,803.31
其他应付	12,324.00
合计	126,668.71

6.4.7.7 实收基金

国泰海通沪深 300 指数增强发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	895,359,195.34	895,359,195.34
本期申购	425,508,844.38	425,508,844.38
本期赎回（以“-”号填列）	-291,701,086.09	-291,701,086.09
本期末	1,029,166,953.63	1,029,166,953.63

国泰海通沪深 300 指数增强发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	518,024,435.86	518,024,435.86
本期申购	708,522,246.34	708,522,246.34
本期赎回（以“-”号填列）	-481,552,887.88	-481,552,887.88
本期末	744,993,794.32	744,993,794.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰海通沪深 300 指数增强发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	240,600,203.45	13,239,304.87	253,839,508.32
本期期初	240,600,203.45	13,239,304.87	253,839,508.32
本期利润	139,032,391.36	49,360,145.51	188,392,536.87
本期基金份额交易产生的变动数	48,149,970.99	3,348,982.23	51,498,953.22
其中：基金申购款	147,812,874.68	15,876,154.42	163,689,029.10
基金赎回款	-99,662,903.69	-12,527,172.19	-112,190,075.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	427,782,565.80	65,948,432.61	493,730,998.41

国泰海通沪深 300 指数增强发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	132,188,764.52	7,507,083.59	139,695,848.11
本期期初	132,188,764.52	7,507,083.59	139,695,848.11
本期利润	91,955,123.22	31,830,765.96	123,785,889.18

本期基金份额交易产生的变动数	72,159,065.45	7,732,808.98	79,891,874.43
其中：基金申购款	228,559,636.33	22,457,999.01	251,017,635.34
基金赎回款	-156,400,570.88	-14,725,190.03	-171,125,760.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	296,302,953.19	47,070,658.53	343,373,611.72

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	116,409.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	23,158.45
结算备付金利息收入	30,251.67
其他	-
合计	169,819.38

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	6,199,800,844.97
减：卖出股票成本总额	5,976,011,018.56
减：交易费用	4,845,638.11
买卖股票差价收入	218,944,188.30

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	4,203,140.15
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	122,421.56
减：交易费用	101,397.18
合计	3,979,321.41

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	20,660,738.62
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,660,738.62

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	80,348,169.83
——股票投资	80,348,169.83
——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	870,239.85
——权证投资	-
——期货投资	870,239.85
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	27,498.21
合计	81,190,911.47

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,175,039.87
转换费收入	34,573.38
合计	1,209,613.25

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	23,803.31

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,443.25
合计	86,753.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰海通证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰海通资管”)	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦东发展银行”)	基金托管人
国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	11,213,725,694.4	87.42%	11,493,981,946.9	79.92%

	3		1	
--	---	--	---	--

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	799,507.17	86.59%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	819,523.69	78.64%	0.00	0.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,596,650.61	9,910,839.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,054,592.44	1,824,731.15
应支付基金管理人的净管理费	7,542,058.17	8,086,108.26

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

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,589,497.62	1,486,625.95

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰海通沪深 300 指数 增强发起 A	国泰海通沪深 300 指数 增强发起 C	合计
浦东发展银行	-	7,494.93	7,494.93
国泰海通资管	-	525,035.27	525,035.27
国泰海通证券	-	350,862.46	350,862.46
合计	-	883,392.66	883,392.66
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰海通沪深 300 指数 增强发起 A	国泰海通沪深 300 指数 增强发起 C	合计
国泰海通资管	-	1,255,662.91	1,255,662.91
浦东发展银行	-	743.53	743.53
国泰海通证券	-	225,624.46	225,624.46
合计	-	1,482,030.90	1,482,030.90

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰海通沪深 300 指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	24,777,756.72	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	14,768,756.72
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	24,777,756.72	-
报告期末持有的基金份额	-	24,777,756.72
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.00%	2.78%

国泰海通沪深 300 指数增强发起 C

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期内申购/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	5,010,000.00	—
报告期末持有的基金份额	—	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.00%	0.66%

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

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
国泰海通证券	66,065,198.18	15,528.39	68,921,741.84	43,222.19
浦东发展银行	87,673,181.74	116,409.26	100,811,862.08	109,466.02

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

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

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

低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	筹划发行股份及支付现金购买资产	832.00	2026-07-13	890.99	3,866	2,836,268.45	3,216,512.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席

风险官)、风险管理部门, 以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行股份有限公司, 其他银行存款为光大证券股份有限公司保证金、国泰海通证券股份有限公司保证金, 与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算, 违约风险可能性很小; 在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2026 年 6 月 30 日, 本基金未持有信用类债券(2025 年 12 月 31 日: 本基金未持有信用类债券)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2026 年 6 月 30 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司

可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	200,743,742.5	-	-	-	200,743,742.51

	1				
结算备付金	19,225,327.72	-	-	-	19,225,327.72
存出保证金	-	-	-	7,373,677.08	7,373,677.08
交易性金融资产	-	-	-	2,406,033,317.99	2,406,033,317.99
应收申购款	-	-	-	8,795,987.64	8,795,987.64
资产总计	219,969,070.23	-	-	2,422,202,982.71	2,642,172,052.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,955,023.36	27,955,023.36
应付管理人报酬	-	-	-	2,072,950.57	2,072,950.57
应付托管费	-	-	-	310,942.61	310,942.61
应付销售服务费	-	-	-	347,044.83	347,044.83
应交税费	-	-	-	94,064.78	94,064.78
其他负债	-	-	-	126,668.71	126,668.71
负债总计	-	-	-	30,906,694.86	30,906,694.86
利率敏感度缺口	219,969,070.23	-	-	2,391,296,287.85	2,611,265,358.08
上年度末 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	198,350,210.78	-	-	-	198,350,210.78
结算备付金	17,600,946.17	-	-	-	17,600,946.17
存出保证金	-	-	-	3,995,824.14	3,995,824.14
交易性金融资产	-	-	-	1,673,846,524.02	1,673,846,524.02
应收申购款	-	-	-	2,101,919.16	2,101,919.16
资产总计	215,951,156.95	-	-	1,679,944,267.32	1,895,895,424.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	86,647,805.85	86,647,805.85
应付管理人报酬	-	-	-	1,647,060.30	1,647,060.30
应付托管费	-	-	-	247,059.04	247,059.04
应付销售服务费	-	-	-	261,468.84	261,468.84

其他负债	-	-	-	173,042.61	173,042.61
负债总计	-	-	-	88,976,436.64	88,976,436.64
利率敏感度缺口	215,951,156.95	-	-	1,590,967,830.68	1,806,918,987.63

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00%(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	2,406,033,317.99	92.14	1,673,846,524.02	92.64
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	2,406,033,317.99	92.14	1,673,846,524.02	92.64

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%	125,857,774.24	91,624,477.92
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-125,857,774.24	-91,624,477.92

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,402,729,839.54	1,667,701,676.00
第二层次	3,216,512.00	5,619,313.00
第三层次	86,966.45	525,535.02
合计	2,406,033,317.99	1,673,846,524.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,406,033,317.99	91.06
	其中：股票	2,406,033,317.99	91.06
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	219,969,070.23	8.33
8	其他各项资产	16,169,664.72	0.61
9	合计	2,642,172,052.94	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	137,212,502.00	5.25
C	制造业	1,142,730,972.38	43.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,239,688.71	2.23
E	建筑业	40,117,443.42	1.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	49,351,574.28	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,738,514.64	3.63
J	金融业	391,573,400.62	15.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,161,968.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	39,843,200.00	1.53
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,970,969,264.05	75.48

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,351,850.00	0.20
C	制造业	362,676,313.78	13.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,955,886.00	0.23

E	建筑业	288,960.00	0.01
F	批发和零售业	24,661,720.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	17,756,841.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,161,124.16	0.39
J	金融业	5,673,839.00	0.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,168,904.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,368,616.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	435,064,053.94	16.66

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	108,247	137,473,690.00	5.26
2	300750	宁德时代	212,052	83,338,556.52	3.19
3	300502	新易盛	135,084	81,995,988.00	3.14
4	688256	寒武纪	37,817	60,338,914.35	2.31
5	603986	兆易创新	54,900	44,743,500.00	1.71
6	600030	中信证券	1,509,390	43,364,774.70	1.66
7	601398	工商银行	5,904,100	41,741,987.00	1.60
8	603259	药明康德	320,000	39,843,200.00	1.53
9	600519	贵州茅台	33,000	39,121,170.00	1.50
10	688981	中芯国际	240,399	38,180,169.18	1.46
11	601899	紫金矿业	1,335,400	33,571,956.00	1.29
12	601328	交通银行	5,029,501	32,339,691.43	1.24
13	300408	三环集团	186,500	31,126,850.00	1.19

14	688041	海光信息	83,758	31,015,587.40	1.19
15	600999	招商证券	1,406,890	29,685,379.00	1.14
16	600019	宝钢股份	5,047,300	27,406,839.00	1.05
17	688012	中微公司	57,658	27,012,773.00	1.03
18	300033	同花顺	110,420	26,611,220.00	1.02
19	688183	生益电子	194,315	25,727,306.00	0.99
20	601600	中国铝业	3,128,000	25,712,160.00	0.98
21	601995	中金公司	702,100	25,380,915.00	0.97
22	600104	上汽集团	2,481,333	24,217,810.08	0.93
23	600741	华域汽车	1,520,917	23,604,631.84	0.90
24	601985	中国核电	2,599,400	23,472,582.00	0.90
25	600919	江苏银行	2,161,600	23,302,048.00	0.89
26	300661	圣邦股份	161,300	23,143,324.00	0.89
27	600183	生益科技	133,200	23,096,880.00	0.88
28	600938	中国海油	826,100	22,428,615.00	0.86
29	000333	美的集团	292,700	22,107,631.00	0.85
30	601898	中煤能源	1,808,050	22,022,049.00	0.84
31	601857	中国石油	2,496,900	21,673,092.00	0.83
32	600309	万华化学	316,402	21,645,060.82	0.83
33	601658	邮储银行	4,342,100	21,406,553.00	0.82
34	000651	格力电器	569,534	21,357,525.00	0.82
35	688008	澜起科技	67,649	20,964,425.10	0.80
36	601225	陕西煤业	986,940	20,084,229.00	0.77
37	601668	中国建筑	4,619,613	20,049,120.42	0.77
38	601318	中国平安	415,500	19,835,970.00	0.76
39	300476	胜宏科技	55,700	19,296,151.00	0.74
40	688396	华润微	195,871	19,107,216.05	0.73
41	601117	中国化学	2,585,200	19,001,220.00	0.73
42	600011	华能国际	2,483,500	18,849,765.00	0.72
43	600585	海螺水泥	1,086,693	18,419,446.35	0.71
44	600989	宝丰能源	905,300	18,404,749.00	0.70
45	601009	南京银行	1,750,200	17,309,478.00	0.66
46	000001	平安银行	1,678,238	16,866,291.90	0.65
47	600460	士兰微	300,400	16,419,864.00	0.63
48	002001	新和成	569,920	16,197,126.40	0.62
49	600415	小商品城	1,591,900	16,173,704.00	0.62
50	601138	工业富联	223,600	16,132,740.00	0.62
51	688111	金山办公	73,827	15,728,842.35	0.60
52	000807	云铝股份	691,000	15,298,740.00	0.59
53	600150	中国船舶	449,200	15,178,468.00	0.58
54	600036	招商银行	420,400	14,924,200.00	0.57
55	601766	中国中车	2,772,400	14,416,480.00	0.55
56	600547	山东黄金	568,800	13,133,592.00	0.50

57	601939	建设银行	1,277,690	12,304,154.70	0.47
58	002371	北方华创	13,800	12,206,928.00	0.47
59	002648	卫星化学	514,358	12,082,269.42	0.46
60	600018	上港集团	2,542,400	12,000,128.00	0.46
61	600809	山西汾酒	103,500	11,319,795.00	0.43
62	601816	京沪高铁	2,492,600	11,291,478.00	0.43
63	600887	伊利股份	436,500	10,458,540.00	0.40
64	600426	华鲁恒升	430,625	10,300,550.00	0.39
65	688521	芯原股份	27,271	10,121,358.94	0.39
66	603893	瑞芯微	51,500	9,700,540.00	0.37
67	601872	招商轮船	522,304	9,176,881.28	0.35
68	601229	上海银行	1,039,900	9,026,332.00	0.35
69	000100	TCL 科技	1,533,577	8,925,418.14	0.34
70	300803	指南针	96,200	8,818,654.00	0.34
71	603799	华友钴业	176,200	8,503,412.00	0.33
72	600690	海尔智家	412,400	8,417,084.00	0.32
73	002475	立讯精密	116,700	8,215,680.00	0.31
74	601066	中信建投	282,300	8,206,461.00	0.31
75	600026	中远海能	448,700	8,049,678.00	0.31
76	600176	中国巨石	106,000	7,725,280.00	0.30
77	601998	中信银行	1,113,413	7,715,952.09	0.30
78	601881	中国银河	609,500	7,661,415.00	0.29
79	002384	东山精密	28,800	7,555,680.00	0.29
80	601919	中远海控	494,000	6,550,440.00	0.25
81	300274	阳光电源	38,880	6,182,697.60	0.24
82	600031	三一重工	353,500	6,108,480.00	0.23
83	601288	农业银行	967,800	5,874,546.00	0.22
84	600886	国投电力	394,320	5,248,399.20	0.20
85	300394	天孚通信	17,060	5,163,720.80	0.20
86	300442	润泽科技	61,600	5,117,112.00	0.20
87	600900	长江电力	186,213	4,929,058.11	0.19
88	000568	泸州老窖	61,794	4,790,270.88	0.18
89	605117	德业股份	43,400	4,608,212.00	0.18
90	601127	赛力斯	73,200	4,483,500.00	0.17
91	601988	中国银行	751,700	4,299,724.00	0.16
92	600027	华电国际	948,500	4,220,825.00	0.16
93	600482	中国动力	126,500	4,149,200.00	0.16
94	002463	沪电股份	26,460	4,043,088.00	0.15
95	600196	复星医药	177,400	3,986,178.00	0.15
96	002916	深南电路	8,700	3,983,730.00	0.15
97	600875	东方电气	127,600	3,671,052.00	0.14
98	688072	拓荆科技	3,866	3,216,512.00	0.12
99	600346	恒力石化	180,900	3,203,739.00	0.12

100	000725	京东方 A	348,700	3,026,716.00	0.12
101	601688	华泰证券	145,200	2,994,024.00	0.11
102	601916	浙商银行	1,047,700	2,755,451.00	0.11
103	600276	恒瑞医药	50,720	2,639,468.80	0.10
104	301308	江波龙	3,700	2,604,060.00	0.10
105	002532	天山铝业	234,500	2,516,185.00	0.10
106	000792	盐湖股份	80,700	2,436,333.00	0.09
107	002625	光启技术	74,200	2,249,744.00	0.09
108	601728	中国电信	411,300	2,134,647.00	0.08
109	600028	中国石化	477,700	2,130,542.00	0.08
110	601166	兴业银行	115,800	1,917,648.00	0.07
111	601788	光大证券	124,300	1,793,649.00	0.07
112	000708	中信特钢	130,200	1,643,124.00	0.06
113	601377	兴业证券	268,500	1,621,740.00	0.06
114	600803	新奥股份	96,143	1,519,059.40	0.06
115	600188	兖矿能源	85,100	1,512,227.00	0.06
116	600066	宇通客车	44,700	1,198,407.00	0.05
117	301165	锐捷网络	14,200	1,142,390.00	0.04
118	600009	上海机场	47,400	1,094,940.00	0.04
119	000776	广发证券	46,700	1,092,780.00	0.04
120	601390	中国中铁	255,900	1,067,103.00	0.04
121	002415	海康威视	30,100	1,029,420.00	0.04
122	002028	思源电气	5,800	1,003,400.00	0.04
123	601888	中国中免	18,400	988,264.00	0.04
124	300124	汇川技术	13,900	921,987.00	0.04
125	002050	三花智控	20,000	876,600.00	0.03
126	000408	藏格矿业	12,100	838,772.00	0.03
127	601901	方正证券	112,379	809,128.80	0.03
128	000617	中油资本	119,900	790,141.00	0.03
129	600029	南方航空	139,300	721,574.00	0.03
130	600050	中国联通	168,200	672,800.00	0.03
131	000975	山金国际	38,600	656,200.00	0.03
132	601077	渝农商行	101,400	619,554.00	0.02
133	002938	鹏鼎控股	5,500	579,590.00	0.02
134	603288	海天味业	15,500	513,980.00	0.02
135	000596	古井贡酒	6,200	494,760.00	0.02
136	002558	巨人网络	17,400	479,544.00	0.02
137	000938	紫光股份	16,200	467,532.00	0.02
138	601111	中国国航	77,100	466,455.00	0.02
139	300014	亿纬锂能	5,300	344,659.00	0.01
140	601336	新华保险	4,900	292,334.00	0.01
141	603501	豪威集团	2,900	275,065.00	0.01
142	002600	领益智造	14,500	251,430.00	0.01

143	002049	紫光国微	2,600	230,750.00	0.01
144	600918	中泰证券	39,700	211,204.00	0.01
145	000338	潍柴动力	6,900	188,025.00	0.01
146	300418	昆仑万维	3,600	145,296.00	0.01
147	000858	五粮液	1,900	140,600.00	0.01
148	600893	航发动力	3,500	134,190.00	0.01
149	000301	东方盛虹	8,600	98,470.00	0.00
150	300866	安克创新	200	20,900.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000933	神火股份	1,068,800	22,658,560.00	0.87
2	300475	香农芯创	70,300	21,090,000.00	0.81
3	600269	赣粤高速	4,423,823	17,606,815.54	0.67
4	300223	北京君正	57,700	14,361,530.00	0.55
5	001389	广合科技	58,000	13,760,500.00	0.53
6	301607	富特科技	237,200	12,393,700.00	0.47
7	002668	TCL 智家	990,972	10,979,969.76	0.42
8	300283	温州宏丰	518,700	10,659,285.00	0.41
9	688525	佰维存储	21,366	10,570,401.18	0.40
10	688110	东芯股份	51,838	10,559,400.60	0.40
11	002851	麦格米特	62,400	10,432,032.00	0.40
12	301611	珂玛科技	52,900	9,525,703.00	0.36
13	300570	太辰光	36,300	8,955,573.00	0.34
14	301536	星宸科技	67,500	8,687,925.00	0.33
15	300857	协创数据	24,740	8,409,126.00	0.32
16	300136	信维通信	67,000	7,989,750.00	0.31
17	301389	隆扬电子	91,700	7,958,643.00	0.30
18	301511	德福科技	53,300	7,667,205.00	0.29

19	688221	前沿生物	337,420	7,558,208.00	0.29
20	300438	鹏辉能源	87,300	7,232,805.00	0.28
21	000589	贵州轮胎	1,767,700	7,176,862.00	0.27
22	603083	剑桥科技	26,200	6,677,594.00	0.26
23	688469	芯联集成	580,883	6,163,168.63	0.24
24	002364	中恒电气	113,400	6,100,920.00	0.23
25	300620	光库科技	15,900	6,013,380.00	0.23
26	002885	京泉华	145,300	5,936,958.00	0.23
27	688772	珠海冠宇	298,974	5,868,859.62	0.22
28	002245	蔚蓝锂芯	306,516	5,734,914.36	0.22
29	688629	华丰科技	30,330	5,687,178.30	0.22
30	300069	金利华电	178,500	5,681,655.00	0.22
31	300491	通合科技	130,400	4,979,976.00	0.19
32	600908	无锡银行	948,000	4,815,840.00	0.18
33	300483	首华燃气	266,700	4,688,586.00	0.18
34	000690	宝新能源	849,800	3,994,060.00	0.15
35	688352	硕中科技	152,419	3,685,491.42	0.14
36	300153	科泰电源	162,741	3,681,201.42	0.14
37	000932	华菱钢铁	1,012,900	3,514,763.00	0.13
38	301099	雅创电子	36,300	3,466,650.00	0.13
39	688365	光云科技	217,338	3,427,420.26	0.13
40	688257	新锐股份	33,554	3,419,152.60	0.13
41	688559	海目星	37,738	3,166,972.96	0.12
42	301310	鑫宏业	47,900	2,645,996.00	0.10
43	688249	晶合集成	41,477	2,448,387.31	0.09
44	300602	飞荣达	46,600	2,385,920.00	0.09
45	600498	烽火通信	32,100	2,362,560.00	0.09
46	000519	中兵红箭	111,600	2,351,412.00	0.09
47	688045	必易微	28,699	2,318,305.22	0.09
48	002169	智光电气	155,500	2,276,520.00	0.09
49	688728	格科微	104,457	2,197,775.28	0.08
50	600801	华新建材	140,441	2,190,879.60	0.08
51	003025	思进智能	155,174	2,184,849.92	0.08
52	688343	云天励飞	25,598	2,090,332.68	0.08
53	688678	福立旺	85,058	2,055,851.86	0.08
54	605123	派克新材	20,900	2,027,509.00	0.08
55	688456	有研粉材	14,192	1,981,203.20	0.08
56	688220	翱捷科技	15,763	1,959,656.16	0.08
57	603897	长城科技	60,200	1,954,092.00	0.07
58	300488	恒锋工具	41,300	1,934,079.00	0.07
59	002034	旺能环境	125,400	1,899,810.00	0.07
60	688353	华盛锂电	15,100	1,752,657.00	0.07
61	688416	恒烁股份	12,423	1,739,220.00	0.07

62	603486	科沃斯	32,800	1,664,600.00	0.06
63	688197	首药控股	47,684	1,593,122.44	0.06
64	300576	容大感光	31,000	1,587,820.00	0.06
65	603507	振江股份	47,100	1,549,119.00	0.06
66	688208	道通科技	59,026	1,486,864.94	0.06
67	688332	中科蓝讯	9,245	1,456,087.50	0.06
68	688653	康希通信	77,561	1,348,010.18	0.05
69	688035	德邦科技	14,200	1,303,560.00	0.05
70	688499	利元亨	24,619	1,293,728.45	0.05
71	688388	嘉元科技	27,600	1,214,400.00	0.05
72	002792	通宇通讯	33,700	1,198,709.00	0.05
73	600267	海正药业	116,500	1,177,815.00	0.05
74	000415	渤海租赁	287,200	1,168,904.00	0.04
75	688049	炬芯科技	24,603	1,154,126.73	0.04
76	300613	富瀚微	14,400	1,153,152.00	0.04
77	301297	富乐德	18,400	1,126,816.00	0.04
78	603327	福蓉科技	132,031	1,119,622.88	0.04
79	001266	宏英智能	22,700	1,114,570.00	0.04
80	600619	海立股份	69,200	1,096,820.00	0.04
81	688498	源杰科技	572	1,078,792.00	0.04
82	688266	泽璟制药	9,198	1,073,038.68	0.04
83	000050	深天马 A	97,900	970,189.00	0.04
84	300260	新莱应材	9,500	954,370.00	0.04
85	300496	中科创达	15,100	933,029.00	0.04
86	688166	博瑞医药	25,700	899,757.00	0.03
87	300905	宝丽迪	17,600	890,560.00	0.03
88	603068	博通集成	21,800	877,014.00	0.03
89	601665	齐鲁银行	148,700	857,999.00	0.03
90	002918	蒙娜丽莎	84,200	846,210.00	0.03
91	002338	奥普光电	14,000	800,800.00	0.03
92	003043	华亚智能	7,900	785,181.00	0.03
93	300779	惠城环保	15,546	780,409.20	0.03
94	688107	安路科技	17,028	776,476.80	0.03
95	688192	迪哲医药	19,424	775,600.32	0.03
96	688261	东微半导	7,013	735,874.09	0.03
97	300489	光智科技	2,300	717,485.00	0.03
98	688062	迈威生物	24,570	694,102.50	0.03
99	688378	奥来德	10,956	679,272.00	0.03
100	600988	赤峰黄金	25,200	663,264.00	0.03
101	300693	盛弘股份	13,400	653,250.00	0.03
102	300809	华辰装备	23,100	624,855.00	0.02
103	688766	普冉股份	800	613,280.00	0.02
104	300681	英搏尔	20,900	598,158.00	0.02

105	688176	亚虹医药	55,629	551,839.68	0.02
106	600601	方正科技	38,000	525,920.00	0.02
107	688443	智翔金泰	22,514	523,450.50	0.02
108	300590	移为通信	36,200	519,470.00	0.02
109	688612	威迈斯	17,400	514,866.00	0.02
110	603530	神马电力	10,100	514,090.00	0.02
111	301568	思泰克	4,500	502,200.00	0.02
112	002443	金洲管道	52,200	497,466.00	0.02
113	603728	鸣志电器	7,800	475,176.00	0.02
114	688676	金盘科技	5,500	465,520.00	0.02
115	688028	沃尔德	2,952	460,128.24	0.02
116	002653	海思科	6,600	437,844.00	0.02
117	300953	震裕科技	3,100	414,470.00	0.02
118	688235	百济神州	1,600	407,376.00	0.02
119	688181	八亿时空	6,500	406,900.00	0.02
120	600686	金龙汽车	32,900	371,441.00	0.01
121	603659	璞泰来	12,800	370,304.00	0.01
122	688719	爱科赛博	4,535	349,195.00	0.01
123	300400	劲拓股份	9,200	346,380.00	0.01
124	001314	亿道信息	5,300	327,540.00	0.01
125	688231	隆达股份	8,900	326,897.00	0.01
126	603725	天安新材	28,400	320,920.00	0.01
127	301360	荣旗科技	4,400	301,356.00	0.01
128	000090	天健集团	96,000	288,960.00	0.01
129	688323	瑞华泰	5,007	282,895.50	0.01
130	002881	美格智能	7,400	269,656.00	0.01
131	688627	精智达	366	261,690.00	0.01
132	300691	联合光电	16,000	252,960.00	0.01
133	002284	亚太股份	26,300	249,587.00	0.01
134	003012	东鹏控股	56,800	247,648.00	0.01
135	002886	沃特股份	8,700	244,383.00	0.01
136	688372	伟测科技	1,300	241,800.00	0.01
137	300840	酷特智能	10,900	224,867.00	0.01
138	301021	英诺激光	1,700	207,230.00	0.01
139	600808	马钢股份	81,800	204,500.00	0.01
140	002273	水晶光电	5,700	202,236.00	0.01
141	603538	美诺华	6,000	195,300.00	0.01
142	688147	微导纳米	1,100	178,068.00	0.01
143	688690	纳微科技	3,900	171,990.00	0.01
144	688700	东威科技	1,800	160,920.00	0.01
145	600033	福建高速	46,100	148,442.00	0.01
146	301396	宏景科技	400	132,640.00	0.01
147	688090	瑞松科技	1,000	106,450.00	0.00

148	301095	广立微	900	106,245.00	0.00
149	603071	物产环能	9,500	105,070.00	0.00
150	301246	宏源药业	3,800	102,220.00	0.00
151	002821	凯莱英	500	81,000.00	0.00
152	688301	奕瑞科技	600	74,400.00	0.00
153	688522	纳睿雷达	3,679	73,653.58	0.00
154	600008	首创环保	22,800	62,016.00	0.00
155	002947	恒铭达	800	60,840.00	0.00
156	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
157	300623	捷捷微电	1,000	44,990.00	0.00
158	300395	菲利华	300	40,119.00	0.00
159	002487	大金重工	600	34,782.00	0.00
160	688299	长阳科技	2,000	33,420.00	0.00
161	300566	激智科技	900	33,255.00	0.00
162	002048	宁波华翔	1,400	32,200.00	0.00
163	300619	金银河	840	26,132.40	0.00
164	002484	江海股份	200	21,000.00	0.00
165	300790	宇瞳光学	800	20,888.00	0.00
166	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
167	601777	千里科技	1,800	14,688.00	0.00
168	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
169	603305	旭升集团	1,100	13,332.00	0.00
170	600623	华谊集团	1,400	11,298.00	0.00
171	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
172	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	97,953,608.61	5.42
2	300502	新易盛	83,086,625.09	4.60
3	300394	天孚通信	81,912,710.36	4.53
4	300750	宁德时代	75,600,004.00	4.18
5	300476	胜宏科技	69,188,271.60	3.83

6	601600	中国铝业	63,428,492.2 7	3.51
7	688256	寒武纪	62,844,118.0 6	3.48
8	000651	格力电器	59,860,236.4 0	3.31
9	603259	药明康德	58,982,756.0 0	3.26
10	688041	海光信息	55,296,510.9 8	3.06
11	600030	中信证券	51,741,116.6 9	2.86
12	600104	上汽集团	51,309,685.3 7	2.84
13	688008	澜起科技	51,202,959.7 3	2.83
14	688183	生益电子	49,784,049.6 3	2.76
15	601919	中远海控	49,332,141.0 0	2.73
16	601288	农业银行	46,945,573.0 0	2.60
17	601398	工商银行	46,764,627.0 0	2.59
18	000333	美的集团	45,967,025.1 3	2.54
19	601225	陕西煤业	44,245,862.6 0	2.45
20	601898	中煤能源	44,207,037.1 8	2.45
21	600989	宝丰能源	42,109,776.1 9	2.33
22	600519	贵州茅台	42,046,785.6 0	2.33
23	002001	新和成	41,857,050.0 0	2.32
24	300274	阳光电源	41,806,640.0 0	2.31
25	600547	山东黄金	41,263,928.8 5	2.28
26	688111	金山办公	41,215,203.2 8	2.28
27	601166	兴业银行	40,793,590.0 0	2.26

28	600150	中国船舶	40,671,499.06	2.25
29	603799	华友钴业	40,418,805.00	2.24
30	603986	兆易创新	40,385,864.00	2.24
31	600938	中国海油	40,009,891.00	2.21
32	000807	云铝股份	39,967,892.00	2.21
33	002463	沪电股份	39,551,859.75	2.19
34	600887	伊利股份	38,523,447.00	2.13
35	601658	邮储银行	38,403,183.00	2.13
36	688981	中芯国际	38,106,342.89	2.11
37	000001	平安银行	36,314,233.86	2.01
38	601899	紫金矿业	36,178,239.00	2.00
39	601985	中国核电	36,170,389.00	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300394	天孚通信	99,862,365.74	5.53
2	300502	新易盛	68,671,532.40	3.80
3	601318	中国平安	62,645,786.76	3.47
4	000651	格力电器	62,318,377.01	3.45
5	688041	海光信息	62,242,152.72	3.44
6	300274	阳光电源	59,130,838.80	3.27

7	300750	宁德时代	58,831,814.0 0	3.26
8	688008	澜起科技	58,336,079.3 0	3.23
9	300308	中际旭创	58,299,815.0 0	3.23
10	603259	药明康德	57,707,923.0 0	3.19
11	300476	胜宏科技	55,745,842.0 0	3.09
12	601166	兴业银行	50,531,208.0 0	2.80
13	601919	中远海控	48,977,378.0 0	2.71
14	600887	伊利股份	47,415,628.9 2	2.62
15	688256	寒武纪	43,962,122.5 4	2.43
16	002463	沪电股份	43,696,572.2 0	2.42
17	002916	深南电路	42,926,239.0 0	2.38
18	601600	中国铝业	42,499,147.0 0	2.35
19	600919	江苏银行	40,070,143.0 0	2.22
20	601898	中煤能源	39,412,066.2 0	2.18
21	000333	美的集团	38,750,388.1 5	2.14
22	601288	农业银行	38,381,657.0 0	2.12
23	603799	华友钴业	38,174,854.0 0	2.11
24	600519	贵州茅台	37,760,236.6 0	2.09
25	000338	潍柴动力	37,684,011.0 0	2.09
26	600150	中国船舶	37,528,904.1 4	2.08
27	600188	兖矿能源	36,579,149.1 5	2.02
28	600030	中信证券	36,436,156.8 9	2.02

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,627,849,642.70
卖出股票收入（成交）总额	6,199,800,844.97

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的前十名证券发行主体中国工商银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信证券股份有限公司，2025 年 7 月因违规经营被中国银行间市场交易商协会调查。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约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约定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,373,677.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,795,987.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,169,664.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级 别	持有人 户数 (户)	户均持 有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
国泰海 通沪深 300 指 数增强 发起 A	132,258	7,781.5 1	681,380,414.75	66.21%	347,786,538.8 8	33.79%
国泰海 通沪深 300 指 数增强 发起 C	112,877	6,600.0 5	488,340,219.42	65.55%	256,653,574.9 0	34.45%
合计	245,135	7,237.4 8	1,169,720,634.1 7	65.93%	604,440,113.7 8	34.07%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰海通沪深 300 指数增强发起 A	562,635.07	0.0547%
	国泰海通沪深 300 指数增强发起 C	72,476.15	0.0097%
	合计	635,111.22	0.0358%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰海通沪深 300 指数增强发起 A	10~50
	国泰海通沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通沪深 300 指数增强发起 A	10~50
	国泰海通沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	10~50

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占基 金总份额比例	发起份额 总数	发起份额占基 金总份额比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	—	—	—	—	—
基金管理人高级管理人员	17,761.02	0.00%	—	—	—
基金经理等人员	392,452.88	0.02%	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	224,897.32	0.01%	—	—	—
合计	635,111.22	0.03%	—	—	—

注：本基金的发起份额承诺持有期已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通沪深 300 指数 增强发起 A	国泰海通沪深 300 指数 增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）基金 份额总额	10,009,999.00	5,010,000.00
本报告期期初基金份额总额	895,359,195.34	518,024,435.86
本报告期基金总申购份额	425,508,844.38	708,522,246.34
减：本报告期基金总赎回份额	291,701,086.09	481,552,887.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,029,166,953.63	744,993,794.32

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 3 月 24 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》，陈颖同志担任公司首席信息官，叶明同志不再代为履行公司首席信息官职责，生效日期为 2026 年 3 月 23 日。

2026 年 6 月 13 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》，叶明同志担任公司总裁、财务负责人，陶耿同志不再兼任公司总裁、财务负责人职务，生效日期为 2026 年 6 月 12 日。

2、本报告期内本基金托管人专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券股份有限公司	2	11,213,725,694.43	87.42%	799,507.17	86.59%	-
光大证券股份有限公司	3	1,613,691,424.76	12.58%	123,788.21	13.41%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
2	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 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	2026-01-22
3	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	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	2026-03-24
4	上海国泰海通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（2025 年度）	证监会指定网站、公司官网	2026-03-28
5	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 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	2026-03-31
6	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
7	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2026-04-17
8	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2026-04-17
9	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2026-04-17
10	国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
11	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
12	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-30
13	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-05-06
14	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金产品在直销平台实施认购及申购费率优惠的公告	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	2026-05-22
15	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

上海国泰海通证券资产管理有限公司
二〇二六年八月三十一日