

国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金

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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15

§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62

§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	66
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	国泰海通中证 500 指数增强		
基金主代码	014155		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 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	上海银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,741,766,205.80 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 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	014155	014156	025007
报告期末下属分级基金的份额总额	1,542,883,398.14 份	1,196,301,262.91 份	2,581,544.75 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 500 指数增强型证券投资基金由国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金变更而来。

国泰海通中证 500 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，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，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%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，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，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 股票投资策略为本基金的核心策略，主要包括以下几个方面： 1) 行业配置 本基金在行业配置方面尽量遵循基准指数的行业市值占比，尽量控制投资组合相对于基准指数的行业暴露带来的风险损失。 2) 个股选择

	本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证 500 指数的风险偏离度。 A、股票池的建立 考虑到 Alpha 选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上六成以上的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市时间较短的次新股；在过去一段时间流动性和规模综合排名市场排名相对靠后；被交易所标注 ST、即将退市、业绩有连续亏损风险或者被证监会立案调查或者出具警示函等高风险的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票等。 B、选股策略 本基金通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过智能化的模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本基金通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价的中短期主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。本基金的选股策略以低中高等不同调仓频率的多因子选股策略为主，多因子策略投资的详细过程需要分成因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等环节。因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交易数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。在多因子模型算法层面，以人工智能选股模型为核心，并基于股票市场的高噪音和时序性的特征，构建多维度阿尔法预测模型。在投资组合层面，均严格控制其相对于基准指数在市场主要风险因子的风险暴露程度，通过配套的风险模型和组合优化模型得到不同调仓频率的投资组合，并在基金中进行相对均衡的配置。 本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略和可转换债券、可交换债券的投资策略。
业绩比较基准	中证 500 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。
--------	---

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	周直毅
	联系电话	95521	021-68475608
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		95521	95594
传真		021-38871190	021-68476901
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	上海市黄浦区中山南路 688 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		200011	200120
法定代表人		陶耿	顾建忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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）		
	国泰海通中证 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y

本期已实现收益	411,608,322.65	288,308,525.05	433,799.69
本期利润	533,094,266.33	350,398,812.50	578,231.29
加权平均基金份额本期利润	0.3156	0.2874	0.3234
本期加权平均净值利润率	21.50%	19.86%	21.73%
本期基金份额净值增长率	24.45%	24.20%	24.80%
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	799,176,369.37	586,982,050.83	1,359,584.44
期末可供分配基金份额利润	0.5180	0.4907	0.5267
期末基金资产净值	2,500,032,066.34	1,903,584,911.48	4,206,120.96
期末基金份额净值	1.6204	1.5912	1.6293
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	62.04%	59.12%	43.55%

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 500 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	17.86%	1.57%	17.61%	1.56%	0.25%	0.01%
过去六个月	24.45%	1.60%	19.93%	1.58%	4.52%	0.02%
过去一年	53.23%	1.35%	49.68%	1.35%	3.55%	0.00%
过去三年	69.25%	1.43%	48.15%	1.41%	21.10%	0.02%
自基金合同生效起至今	62.04%	1.34%	22.75%	1.33%	39.29%	0.01%

国泰海通中证 500 指数增强 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	17.74%	1.57%	17.61%	1.56%	0.13%	0.01%
过去六个月	24.20%	1.60%	19.93%	1.58%	4.27%	0.02%
过去一年	52.62%	1.35%	49.68%	1.35%	2.94%	0.00%
过去三年	67.23%	1.43%	48.15%	1.41%	19.08%	0.02%
自基金合同生 效起至今	59.12%	1.34%	22.75%	1.33%	36.37%	0.01%

国泰海通中证 500 指数增强 Y 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	18.02%	1.57%	17.61%	1.56%	0.41%	0.01%
过去六个月	24.80%	1.60%	19.93%	1.58%	4.87%	0.02%
自基金合同生 效起至今	43.55%	1.40%	41.12%	1.39%	2.43%	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

国泰海通中证500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
(2021年12月15日-2026年06月30日)



国泰海通中证500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
(2021年12月15日-2026年06月30日)



国泰海通中证500指数增强Y累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年07月25日-2026年06月30日)



注：Y 类份额于 2025 年 7 月 25 日首次申购确认，Y 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§ 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	2021-12-15	-	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。

	任量化投资部（公募） 总经理。				
邓雅琨	国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证香港科技指数发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通高股息投资指数发起（QDII）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，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通君得盛债券基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通科技指数发起基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2024-05-16	—	5 年	邓雅琨，卡耐基梅隆大学计算金融专业，硕士研究生。2021 年 3 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。

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，中证 500 指数（涨幅 20.97%）表现较好，强于沪深 300 指数（涨幅 7.55%）和中证 1000 指数（涨幅 15.99%），弱于创业板综指（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。

中证 500 指数在进攻与防御间更为均衡，指数增强策略因兼顾 Alpha 与 Beta 需求。我们的量化体系独立自洽，不受市场宏大叙事干扰，始终坚守一贯的投资理念与组合管理方法。通过挖掘有逻辑支撑的 Alpha 因子、持续迭代底层模型、定期跟踪策略表现，力求稳定投资者的超额收益预期。增强层面，融合低相关性的基本面财务信号与实时量价信号，借助机器学习有效筛选因子，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，以稳健方式增强中证 500 指数。策略本质是积少成多、以概率取胜，因此更需长期持有。当前中证 500 指数估值处于历史相对合理区间，成长性良好，估值与盈利匹配角度仍具吸引力。我们将通过科学手段不断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中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.6204 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 24.45%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；截至报告期末国泰海通中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.5912 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 24.20%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；截至报告期末国泰海通中证 500 指数增强 Y 基金份额净值为 1.6293 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 24.80%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金

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	328,872,393.82	217,499,632.00
结算备付金		20,137,887.16	26,914,959.39
存出保证金		12,819,964.80	3,855,988.80
交易性金融资产	6.4.7.2	4,059,792,486.18	3,284,661,235.49
其中：股票投资		4,059,792,486.18	3,284,661,235.49

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		17,550,783.06	7,933,568.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,439,173,515.02	3,540,865,384.51
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		26,365,109.42	26,151,573.61
应付管理人报酬		3,477,889.49	2,856,300.02
应付托管费		521,683.45	428,444.98

应付销售服务费		596,986.06	400,804.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		134,095.99	59,647.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	254,651.83	62,431.08
负债合计		31,350,416.24	29,959,201.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,741,766,205.80	2,712,694,524.16
未分配利润	6.4.7.8	1,666,056,892.98	798,211,658.93
净资产合计		4,407,823,098.78	3,510,906,183.09
负债和净资产总计		4,439,173,515.02	3,540,865,384.51

注 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,741,766,205.80 份。其中国泰海通中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.6204 元，基金份额总额 1,542,883,398.14 份；国泰海通中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.5912 元，基金份额总额 1,196,301,262.91 份；国泰海通中证 500 指数增强 Y 基金份额净值 1.6293 元，基金份额总额 2,581,544.75 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金

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		911,857,882.46	180,037,051.36
1. 利息收入		721,821.10	391,384.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	694,518.26	368,456.53
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		27,302.84	22,927.71
2. 投资收益（损失以“-”填列）		722,894,486.78	65,916,436.89
其中：股票投资收益	6.4.7.10	690,222,880.44	51,985,798.28
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	13,423,281.61	-3,562,205.67
股利收益	6.4.7.12	19,248,324.73	17,492,844.28
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	183,720,662.73	112,734,759.92
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	4,520,911.85	994,470.31
减：二、营业总支出		27,786,572.34	14,241,406.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,016,000.44	11,114,026.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,152,400.21	1,667,104.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,485,157.83	1,374,586.86
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		48,822.18	1,366.16
8. 其他费用	6.4.7.15	84,191.68	84,322.56

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		884,071,310.12	165,795,644.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		884,071,310.12	165,795,644.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		884,071,310.12	165,795,644.87

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金

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	2,712,694,524.16	798,211,658.93	3,510,906,183.09
二、本期期初净资产	2,712,694,524.16	798,211,658.93	3,510,906,183.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	29,071,681.64	867,845,234.05	896,916,915.69
（一）、综合收益总额	-	884,071,310.12	884,071,310.12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	29,071,681.64	-16,226,076.07	12,845,605.57
其中：1. 基金申购款	2,250,820,939.21	1,007,817,345.96	3,258,638,285.17
2. 基金赎回款	-	-	-
	2,221,749,257.57	1,024,043,422.03	3,245,792,679.60
（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	2,741,766,205.80	1,666,056,892.98	4,407,823,098.78
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	2,211,021,390.31	-60,508,764.47	2,150,512,625.84
二、本期期初净资产	2,211,021,390.31	-60,508,764.47	2,150,512,625.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-267,456,073.21	163,835,650.78	-103,620,422.43
（一）、综合收益总额	-	165,795,644.87	165,795,644.87

(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）	-267,456,073.21	-1,959,994.09	-269,416,067.30
其中：1. 基金申购款	873,370,257.39	-6,473,864.35	866,896,393.04
2. 基金赎回款	- 1,140,826,330.60	4,513,870.26	- 1,136,312,460.34
(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	1,943,565,317.10	103,326,886.31	2,046,892,203.41

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

国泰海通中证 500 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 500 指数增强型证券投资基金变更而来。国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2021 年 10 月 27 日证监许可【2021】3391 号文注册募集。《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 15 日正式生效。

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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 7 月 24 日起，在原有份额的基础上增设针对个人养老金投资基金业务单独设立的 Y 类基金份额，并相应修改基金合同、招募说明书等法律文件。增加上述份额后，本基金将分设国泰君安中证 500 指数增强 A、国泰君安中证 500 指数增强 C、国泰君安中证 500 指数增强 Y 基金份额，适用不同的管理费及托管费率。

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 500 指数增强型证券投资基金变更为国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金，《国泰海通中证 500 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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《国泰海通中证 500 指数增强型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；Y 类基金份额是指仅供个人养老金资金购买的基金份额。各类基金份额将分别设置对应的基金代码并分别计算各类基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通中证 500 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)、备选成份券(包括存托凭证)、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、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 500 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 500 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	96,706,197.08
等于：本金	96,694,701.38
加：应计利息	11,495.70
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	232,166,196.74
等于：本金	232,162,901.94
加：应计利息	3,294.80
减：坏账准备	-
合计	328,872,393.82

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	3,822,688,727.33	-	4,059,792,486.18	237,103,758.85
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	3,822,688,727.33	-	4,059,792,486.18	237,103,758.85

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	103,432,623.23	-	-	-
一股指期货	103,432,623.23	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	103,432,623.23	-	-	-

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
IC2607	IC2607	6	10,713,840.00	444,277.27
IC2608	IC2608	21	37,154,880.00	821,640.00
IC2609	IC2609	20	35,045,600.00	1,267,578.59

			0	
IC2612	IC2612	14	23,918,720.00	866,920.91
合计				3,400,416.77
减：可抵销期货暂收款				3,400,416.77
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	18,065.97
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	153,275.18
合计	254,651.83

6.4.7.7 实收基金

国泰海通中证 500 指数增强 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	1,691,449,234.85	1,691,449,234.85
本期申购	812,320,517.50	812,320,517.50
本期赎回（以“-”号填列）	-960,886,354.21	-960,886,354.21
本期末	1,542,883,398.14	1,542,883,398.14

国泰海通中证 500 指数增强 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	1,020,482,300.50	1,020,482,300.50
本期申购	1,435,997,059.99	1,435,997,059.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,260,178,097.58	-1,260,178,097.58
本期末	1,196,301,262.91	1,196,301,262.91

国泰海通中证 500 指数增强 Y

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	762,988.81	762,988.81
本期申购	2,503,361.72	2,503,361.72
本期赎回（以“-”号填列）	-684,805.78	-684,805.78
本期末	2,581,544.75	2,581,544.75

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

国泰海通中证 500 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	457,565,256.91	53,446,054.96	511,011,311.87
本期期初	457,565,256.91	53,446,054.96	511,011,311.87

本期利润	411,608,322.65	121,485,943.68	533,094,266.33
本期基金份额交易产生的变动数	-69,997,210.19	-16,959,699.81	-86,956,910.00
其中：基金申购款	309,993,142.34	60,201,914.12	370,195,056.46
基金赎回款	-379,990,352.53	-77,161,613.93	-457,151,966.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	799,176,369.37	157,972,298.83	957,148,668.20

国泰海通中证 500 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	255,357,287.31	31,609,938.79	286,967,226.10
本期期初	255,357,287.31	31,609,938.79	286,967,226.10
本期利润	288,308,525.05	62,090,287.45	350,398,812.50
本期基金份额交易产生的变动数	43,316,238.47	26,601,371.50	69,917,609.97
其中：基金申购款	526,660,653.60	109,792,101.43	636,452,755.03
基金赎回款	-483,344,415.13	-83,190,729.93	-566,535,145.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	586,982,050.83	120,301,597.74	707,283,648.57

国泰海通中证 500 指数增强 Y

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	209,030.70	24,090.26	233,120.96
本期期初	209,030.70	24,090.26	233,120.96
本期利润	433,799.69	144,431.60	578,231.29
本期基金份额交易产生的变动数	716,754.05	96,469.91	813,223.96
其中：基金申购款	1,014,993.80	154,540.67	1,169,534.47
基金赎回款	-298,239.75	-58,070.76	-356,310.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,359,584.44	264,991.77	1,624,576.21

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	516,573.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	41,206.34
结算备付金利息收入	136,738.32
其他	-

合计	694,518.26
----	------------

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	14,276,556,527.31
减：卖出股票成本总额	13,575,270,382.17
减：交易费用	11,063,264.70
买卖股票差价收入	690,222,880.44

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	13,968,567.65
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	406,851.49
减：交易费用	138,434.55
合计	13,423,281.61

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	19,248,324.73
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	19,248,324.73

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	181,766,526.59
——股票投资	181,766,526.59
——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	2, 020, 032. 35
——权证投资	—
——期货投资	2, 020, 032. 35
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	65, 896. 21
合计	183, 720, 662. 73

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	4, 382, 440. 17
转换费收入	138, 471. 68
合计	4, 520, 911. 85

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	81. 00
证券账户开户费	800. 00
合计	84, 191. 68

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
上海银行股份有限公司(以下简称 “上海银行”)	基金托管人、代销机构
国泰海通证券股份有限公司(以下简 称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	26,256,034,475.18	92.31%	21,137,107,766.24	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,872,187.96	89.09%	-	-
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	1,508,076.21	100.00%	-	-

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	21,016,000.44	11,114,026.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,587,519.19	4,012,547.95
应支付基金管理人的净管理费	13,428,481.25	7,101,478.91

注：本基金的各类基金份额管理费按各类基金份额前一日基金资产净值的管理费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为各类基金份额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。

本基金管理费年费率为 1.00%。本基金可对 Y 类基金份额适用的管理费率进行一定的优惠，具体详见招募说明书或相关公告。

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	3,152,400.21	1,667,104.05
----------------	--------------	--------------

注：本基金各类基金份额的托管费按各类基金份额前一日基金资产净值的托管费的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的托管费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为各类基金份额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。

本基金托管费年费率为 0.15%。本基金可对 Y 类基金份额适用的托管费率进行一定的优惠，具体详见招募说明书或相关公告。

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			
	国泰海通中证 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y	合计
国泰海通证券	-	484,220.83	-	484,220.83
国泰海通资管	-	888,639.03	-	888,639.03
上海银行	-	198,820.94	-	198,820.94
合计	-	1,571,680.80	-	1,571,680.80
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			
	国泰海通中证 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中证 500 指数增强 Y	合计
上海银行	-	2,336.40	-	2,336.40
国泰海通证券	-	295,645.42	-	295,645.42
国泰海通资管	-	364,270.22	-	364,270.22
合计	-	662,252.04	-	662,252.04

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，其中，A 类、Y 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.4%。

销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

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，R 为 C 类基金份额适用的销售服务费率。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	155,832,143.24	33,958.37	105,455,206.16	50,756.58
上海银行	96,706,197.08	528,274.76	72,556,795.42	222,253.19

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海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
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
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	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月（含）	主板打新限售	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	1-6 个月（含）	主板打新限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	1-6 个月（含）	主板打新限售	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-

		日	)							
688811	有研新材	2026 年 04 月 01 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
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	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
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	-
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
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	-

		日	)							
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行上海银行股份有限公司，其他银行存款为华宝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、广发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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、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	328,872,393.82	-	-	-	328,872,393.82
结算备付金	20,137,887.16	-	-	-	20,137,887.16
存出保证金	-	-	-	12,819,964.80	12,819,964.80
交易性金融资产	-	-	-	4,059,792,486.18	4,059,792,486.18
应收申购款	-	-	-	17,550,783.06	17,550,783.06
资产总计	349,010,280.98	-	-	4,090,163,234.04	4,439,173,515.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,365,109.42	26,365,109.42
应付管理人报酬	-	-	-	3,477,889.49	3,477,889.49
应付托管费	-	-	-	521,683.45	521,683.45
应付销售服务费	-	-	-	596,986.06	596,986.06
应交税费	-	-	-	134,095.99	134,095.99
其他负债	-	-	-	254,651.83	254,651.83
负债总计	-	-	-	31,350,416.24	31,350,416.24
利率敏感度缺口	349,010,280.98	-	-	4,058,812,817.80	4,407,823,098.78
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	217,499,632.00	-	-	-	217,499,632.00
结算备付金	26,914,959.39	-	-	-	26,914,959.39
存出保证金	-	-	-	3,855,988.80	3,855,988.80
交易性金融资产	-	-	-	3,284,661,235.49	3,284,661,235.49
应收申购款	-	-	-	7,933,568.83	7,933,568.83
资产总计	244,414,591.39	-	-	3,296,450,793.12	3,540,865,384.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,151,573.61	26,151,573.61
应付管理人报酬	-	-	-	2,856,300.02	2,856,300.02

应付托管费	-	-	-	428,444.98	428,444.98
应付销售服务费	-	-	-	400,804.72	400,804.72
应交税费	-	-	-	59,647.01	59,647.01
其他负债	-	-	-	62,431.08	62,431.08
负债总计	-	-	-	29,959,201.42	29,959,201.42
利率敏感度缺口	244,414,591.39	-	-	3,266,491,591.70	3,510,906,183.09

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	4,059,792,486.18	92.10	3,284,661,235.49	93.56
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	4,059,792,486.18	92.10	3,284,661,235.49	93.56

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%	217,718,904.06	175,608,317.90
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-217,718,904.06	-175,608,317.90

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	4,059,062,438.90	3,284,097,214.67
第二层次	—	—
第三层次	730,047.28	564,020.82
合计	4,059,792,486.18	3,284,661,235.49

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	4,059,792,486.18	91.45
	其中：股票	4,059,792,486.18	91.45
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	349,010,280.98	7.86
8	其他各项资产	30,370,747.86	0.68
9	合计	4,439,173,515.02	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,883,980.40	0.31
B	采矿业	96,272,979.20	2.18
C	制造业	2,543,198,944.69	57.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,284,100.75	1.50
E	建筑业	8,991,980.00	0.20
F	批发和零售业	83,103,931.24	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	32,873,243.34	0.75
H	住宿和餐饮业	2,646,329.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,836,542.76	3.38
J	金融业	201,106,728.76	4.56
K	房地产业	1,267,993.04	0.03
L	租赁和商务服务业	27,090,916.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	9,177,558.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	9,406,641.20	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,407,732.44	0.05
S	综合	-	-
	合计	3,246,549,600.82	73.65

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	18,847,617.00	0.43
B	采矿业	48,651,947.14	1.10

C	制造业	620,429,896.93	14.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,121,472.00	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,328,647.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	15,100,978.46	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,031,942.83	0.95
J	金融业	20,288,305.00	0.46
K	房地产业	2,343,023.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	30,344,414.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	710,246.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,044,396.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	813,242,885.36	18.45

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	300223	北京君正	303,200	75,466,480.00	1.71
2	300475	香农芯创	239,450	71,835,000.00	1.63
3	300136	信维通信	520,695	62,092,878.75	1.41
4	688347	华虹宏力	177,787	59,789,768.10	1.36
5	688469	芯联集成	5,621,154	59,640,443.94	1.35
6	001389	广合科技	232,700	55,208,075.00	1.25

				0	
7	688498	源杰科技	28,353	53,473,758.0 0	1.21
8	600601	方正科技	3,713,300	51,392,072.0 0	1.17
9	688220	翱捷科技	403,448	50,156,655.3 6	1.14
10	301536	星宸科技	374,400	48,189,024.0 0	1.09
11	002281	光迅科技	186,800	47,996,392.0 0	1.09
12	002851	麦格米特	285,600	47,746,608.0 0	1.08
13	300346	南大光电	502,244	46,532,906.6 0	1.06
14	000519	中兵红箭	2,199,732	46,348,353.2 4	1.05
15	300620	光库科技	119,000	45,005,800.0 0	1.02
16	002821	凯莱英	274,200	44,420,400.0 0	1.01
17	300604	长川科技	127,600	43,565,192.0 0	0.99
18	603728	鸣志电器	711,720	43,357,982.4 0	0.98
19	003022	联泓新科	1,563,600	40,497,240.0 0	0.92
20	301611	珂玛科技	221,140	39,820,679.8 0	0.90
21	002273	水晶光电	1,059,892	37,604,968.1 6	0.85
22	688266	泽璟制药	321,599	37,517,739.3 4	0.85
23	300857	协创数据	109,140	37,096,686.0 0	0.84
24	600105	永鼎股份	549,600	37,087,008.0 0	0.84
25	688301	奕瑞科技	296,700	36,790,800.0 0	0.83
26	000703	恒逸石化	2,664,809	36,161,458.1 3	0.82
27	002064	华峰化学	3,756,300	35,647,287.0 0	0.81

28	600369	西南证券	8,595,602	34,554,320.0 4	0.78
29	002738	中矿资源	584,600	34,485,554.0 0	0.78
30	688728	格科微	1,598,626	33,635,091.0 4	0.76
31	688629	华丰科技	177,833	33,345,465.8 3	0.76
32	601699	潞安环能	2,195,200	31,347,456.0 0	0.71
33	600988	赤峰黄金	1,166,900	30,712,808.0 0	0.70
34	688343	云天励飞	374,440	30,576,770.4 0	0.69
35	688172	燕东微	348,864	29,185,962.2 4	0.66
36	688166	博瑞医药	769,118	26,926,821.1 8	0.61
37	600008	首创环保	9,890,900	26,903,248.0 0	0.61
38	300623	捷捷微电	594,600	26,751,054.0 0	0.61
39	600498	烽火通信	361,800	26,628,480.0 0	0.60
40	601997	贵阳银行	5,174,500	26,545,185.0 0	0.60
41	600352	浙江龙盛	2,155,404	26,101,942.4 4	0.59
42	000967	盈峰环境	2,468,500	25,993,305.0 0	0.59
43	002812	恩捷股份	386,900	25,887,479.0 0	0.59
44	001309	德明利	27,400	25,835,460.0 0	0.59
45	600816	建元信托	10,480,56 0	25,572,566.4 0	0.58
46	601665	齐鲁银行	4,301,500	24,819,655.0 0	0.56
47	301526	国际复材	524,600	24,483,082.0 0	0.56
48	300373	扬杰科技	151,800	23,867,514.0 0	0.54
49	600109	国金证券	2,713,300	23,822,774.0 0	0.54

50	601696	中银证券	1,825,000	23,086,250.0 0	0.52
51	601106	中国一重	6,902,000	22,776,600.0 0	0.52
52	600808	马钢股份	9,095,749	22,739,372.5 0	0.52
53	603345	安井食品	280,600	22,501,314.0 0	0.51
54	600801	华新建材	1,435,800	22,398,480.0 0	0.51
55	600299	安迪苏	2,793,820	21,931,487.0 0	0.50
56	001696	宗申动力	998,686	20,782,655.6 6	0.47
57	603806	福斯特	1,229,100	20,636,589.0 0	0.47
58	002850	科达利	108,000	20,444,400.0 0	0.46
59	002432	九安医疗	288,800	20,412,384.0 0	0.46
60	601000	唐山港	4,876,600	20,237,890.0 0	0.46
61	300458	全志科技	501,780	19,800,238.8 0	0.45
62	300487	蓝晓科技	333,800	19,644,130.0 0	0.45
63	002487	大金重工	333,100	19,309,807.0 0	0.44
64	000921	海信家电	676,400	18,479,248.0 0	0.42
65	688018	乐鑫科技	143,781	18,392,465.5 2	0.42
66	600486	扬农化工	359,900	18,246,930.0 0	0.41
67	002756	永兴材料	315,644	17,878,076.1 6	0.41
68	000415	渤海租赁	4,391,300	17,872,591.0 0	0.41
69	603308	应流股份	293,200	17,709,280.0 0	0.40
70	002414	高德红外	1,329,743	17,632,392.1 8	0.40
71	300054	鼎龙股份	159,100	16,859,827.0 0	0.38

72	600499	科达制造	1,209,483	16,690,865.4 0	0.38
73	002008	大族激光	110,400	16,572,144.0 0	0.38
74	688615	合合信息	141,351	15,986,798.1 0	0.36
75	688192	迪哲医药	391,265	15,623,211.4 5	0.35
76	688387	信科移动	769,655	15,269,955.2 0	0.35
77	603659	璞泰来	484,500	14,016,585.0 0	0.32
78	600298	安琪酵母	386,102	13,976,892.4 0	0.32
79	000831	中国稀土	251,800	13,972,382.0 0	0.32
80	600598	北大荒	1,280,810	13,883,980.4 0	0.31
81	601139	深圳燃气	2,451,400	13,874,924.0 0	0.31
82	000050	深天马 A	1,373,700	13,613,367.0 0	0.31
83	300496	中科创达	215,600	13,321,924.0 0	0.30
84	300339	润和软件	333,300	12,835,383.0 0	0.29
85	300570	太辰光	51,700	12,754,907.0 0	0.29
86	002138	顺络电子	173,500	12,682,850.0 0	0.29
87	600282	南钢股份	2,753,514	12,638,629.2 6	0.29
88	603605	珀莱雅	210,400	12,607,168.0 0	0.29
89	002025	航天电器	165,000	12,576,300.0 0	0.29
90	600884	杉杉股份	927,788	12,571,527.4 0	0.29
91	600166	福田汽车	4,210,000	12,251,100.0 0	0.28
92	600339	中油工程	3,977,000	12,209,390.0 0	0.28
93	300567	精测电子	38,400	12,195,840.0 0	0.28

94	300748	金力永磁	394,600	12,173,410.0 0	0.28
95	000883	湖北能源	2,727,700	11,783,664.0 0	0.27
96	000893	亚钾国际	286,100	11,698,629.0 0	0.27
97	300390	天华新能	122,443	11,449,644.9 3	0.26
98	688318	财富趋势	157,307	11,217,562.1 7	0.25
99	601608	中信重工	2,269,150	10,823,845.5 0	0.25
100	300666	江丰电子	29,300	10,799,980.0 0	0.25
101	688235	百济神州	42,196	10,743,523.5 6	0.24
102	603486	科沃斯	205,400	10,424,050.0 0	0.24
103	600316	洪都航空	372,900	10,418,826.0 0	0.24
104	300548	长芯博创	37,100	10,313,800.0 0	0.23
105	688180	君实生物	291,440	9,856,500.80	0.22
106	688599	天合光能	693,995	9,799,209.40	0.22
107	688385	复旦微电	134,391	9,580,734.39	0.22
108	300751	迈为股份	33,700	9,518,902.00	0.22
109	600685	中船防务	370,600	9,428,064.00	0.21
110	002266	浙富控股	1,859,020	9,406,641.20	0.21
111	001286	陕西能源	926,800	9,397,752.00	0.21
112	002131	利欧股份	1,940,700	9,218,325.00	0.21
113	002465	海格通信	720,300	9,198,231.00	0.21
114	003035	南网能源	1,576,900	9,177,558.00	0.21
115	000987	越秀资本	1,173,041	9,173,180.62	0.21
116	000032	深桑达 A	360,400	8,991,980.00	0.20
117	600595	中孚实业	1,582,100	8,891,402.00	0.20
118	688772	珠海冠宇	447,514	8,784,699.82	0.20
119	601108	财通证券	1,011,500	8,749,475.00	0.20
120	002153	石基信息	1,202,065	8,690,929.95	0.20
121	300002	神州泰岳	1,094,700	8,549,607.00	0.19
122	300763	锦浪科技	93,900	8,483,865.00	0.19
123	002271	东方雨虹	703,900	8,355,293.00	0.19
124	002155	湖南黄金	348,700	8,323,469.00	0.19
125	300919	中伟新材	186,900	8,176,875.00	0.19

126	600909	华安证券	734,000	8,154,740.00	0.19
127	301358	湖南裕能	101,100	7,670,457.00	0.17
128	600704	物产中大	1,606,092	7,580,754.24	0.17
129	000750	国海证券	2,048,805	7,539,602.40	0.17
130	688692	达梦数据	29,355	7,171,132.95	0.16
131	000629	钒钛股份	2,130,415	7,115,586.10	0.16
132	002078	太阳纸业	560,100	6,995,649.00	0.16
133	603379	三美股份	90,200	6,845,278.00	0.16
134	300073	当升科技	140,900	6,768,836.00	0.15
135	688361	中科飞测	15,600	6,708,000.00	0.15
136	688002	睿创微纳	41,391	6,402,773.79	0.15
137	000088	盐田港	1,549,180	6,336,146.20	0.14
138	002265	建设工业	348,100	6,056,940.00	0.14
139	601228	广州港	2,143,877	6,045,733.14	0.14
140	002299	圣农发展	396,300	6,007,908.00	0.14
141	603920	世运电路	120,600	5,793,624.00	0.13
142	002056	横店东磁	186,200	5,675,376.00	0.13
143	688120	华海清科	17,502	5,638,794.36	0.13
144	000009	中国宝安	897,110	5,588,995.30	0.13
145	688538	和辉光电	2,061,600	5,360,160.00	0.12
146	603156	养元饮品	108,000	5,299,560.00	0.12
147	601666	平煤股份	739,000	5,283,850.00	0.12
148	603650	彤程新材	52,400	5,134,152.00	0.12
149	003031	中瓷电子	27,200	4,904,160.00	0.11
150	603179	新泉股份	96,260	4,779,309.00	0.11
151	600871	石化油服	2,332,100	4,734,163.00	0.11
152	300953	震裕科技	33,200	4,438,840.00	0.10
153	603077	和邦生物	1,895,300	4,397,096.00	0.10
154	000959	首钢股份	1,227,100	4,307,121.00	0.10
155	300718	长盛轴承	70,300	4,286,191.00	0.10
156	300454	深信服	43,950	4,227,990.00	0.10
157	601212	白银有色	831,600	4,224,528.00	0.10
158	601399	国机重装	1,149,700	4,023,950.00	0.09
159	002195	岩山科技	611,250	3,997,575.00	0.09
160	688778	厦钨新能	72,910	3,966,304.00	0.09
161	300432	富临精工	195,700	3,931,613.00	0.09
162	688578	艾力斯	33,260	3,631,992.00	0.08
163	688065	凯赛生物	73,742	3,528,554.70	0.08
164	600032	浙江新能	497,700	3,508,785.00	0.08
165	002517	恺英网络	198,200	3,220,750.00	0.07
166	000034	神州数码	103,820	2,881,005.00	0.07
167	600535	天士力	207,400	2,743,902.00	0.06
168	600754	锦江酒店	147,100	2,646,329.00	0.06

169	600637	东方明珠	307,300	2,553,663.00	0.06
170	600977	中国电影	186,357	2,407,732.44	0.05
171	002065	东华软件	332,800	2,376,192.00	0.05
172	000733	振华科技	40,500	2,293,920.00	0.05
173	603000	人民网	150,800	2,230,332.00	0.05
174	300724	捷佳伟创	30,900	2,181,540.00	0.05
175	300474	景嘉微	35,600	2,153,088.00	0.05
176	300285	国瓷材料	20,100	2,073,918.00	0.05
177	601869	长飞光纤	3,400	1,856,060.00	0.04
178	600546	山煤国际	161,200	1,761,916.00	0.04
179	688336	三生国健	32,166	1,708,014.60	0.04
180	601216	君正集团	380,300	1,696,138.00	0.04
181	002966	苏州银行	242,100	1,685,016.00	0.04
182	603786	科博达	39,320	1,608,581.20	0.04
183	605358	立昂微	20,300	1,575,280.00	0.04
184	000887	中鼎股份	85,300	1,526,017.00	0.03
185	002436	兴森科技	29,900	1,523,405.00	0.03
186	002423	中粮资本	165,500	1,362,065.00	0.03
187	300395	菲利华	10,100	1,350,673.00	0.03
188	601233	桐昆股份	59,400	1,286,010.00	0.03
189	688052	纳芯微	4,300	1,239,733.00	0.03
190	600663	陆家嘴	182,468	1,145,899.04	0.03
191	000830	鲁西化工	93,800	1,125,600.00	0.03
192	002152	广电运通	119,744	1,123,198.72	0.03
193	688676	金盘科技	12,734	1,077,805.76	0.02
194	300037	新宙邦	11,600	1,077,060.00	0.02
195	600985	淮北矿业	70,900	996,145.00	0.02
196	688188	柏楚电子	8,805	939,493.50	0.02
197	603596	伯特利	35,600	884,304.00	0.02
198	600098	广州发展	138,025	815,727.75	0.02
199	301200	大族数控	2,200	793,430.00	0.02
200	688281	华秦科技	15,000	753,450.00	0.02
201	603119	浙江荣泰	10,800	716,472.00	0.02
202	600655	豫园股份	154,200	633,762.00	0.01
203	600688	上海石化	203,400	595,962.00	0.01
204	000825	太钢不锈	159,500	543,895.00	0.01
205	000898	鞍钢股份	275,047	514,337.89	0.01
206	688702	盛科通信	1,300	506,987.00	0.01
207	002429	兆驰股份	47,200	490,408.00	0.01
208	600177	雅戈尔	64,668	486,950.04	0.01
209	600536	中国软件	17,000	478,040.00	0.01
210	000932	华菱钢铁	136,800	474,696.00	0.01
211	300679	电连技术	7,000	419,930.00	0.01

212	600380	健康元	41,800	393,756.00	0.01
213	301498	乖宝宠物	9,700	393,723.00	0.01
214	688331	荣昌生物	2,892	376,711.92	0.01
215	600390	五矿资本	78,500	357,960.00	0.01
216	600348	华阳股份	44,200	338,130.00	0.01
217	688582	芯动联科	4,900	318,500.00	0.01
218	003021	兆威机电	2,900	253,315.00	0.01
219	000937	冀中能源	51,940	206,721.20	0.00
220	603979	金诚信	3,200	188,896.00	0.00
221	300972	万辰集团	1,000	173,410.00	0.00
222	600711	盛屯矿业	15,500	170,035.00	0.00
223	601298	青岛港	18,200	146,510.00	0.00
224	603444	吉比特	400	143,368.00	0.00
225	601155	新城控股	11,900	122,094.00	0.00
226	688213	思特威	1,131	121,096.17	0.00
227	601866	中远海发	48,400	106,964.00	0.00
228	002500	山西证券	18,400	94,944.00	0.00
229	688777	中控技术	500	58,750.00	0.00
230	688322	奥比中光	400	52,220.00	0.00
231	601112	振石股份	775	13,632.25	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	688110	东芯股份	175,769	35,804,145.30	0.81
2	002484	江海股份	294,100	30,880,500.00	0.70
3	603083	剑桥科技	120,600	30,737,322.00	0.70
4	601069	西部黄金	1,069,600	23,531,200.00	0.53
5	300489	光智科技	75,100	23,427,445.00	0.53
6	300260	新莱应材	214,100	21,508,486.00	0.49
7	688456	有研粉材	134,386	18,760,285.60	0.43
8	000048	京基智农	841,700	18,593,153.00	0.42
9	301297	富乐德	257,300	15,757,052.00	0.36

				0	
10	000933	神火股份	713,160	15,118,992.00	0.34
11	603516	淳中科技	105,300	14,174,433.00	0.32
12	603259	药明康德	113,200	14,094,532.00	0.32
13	002338	奥普光电	207,900	11,891,880.00	0.27
14	688107	安路科技	249,712	11,386,867.20	0.26
15	688090	瑞松科技	106,414	11,327,770.30	0.26
16	002843	泰嘉股份	524,700	11,265,309.00	0.26
17	300438	鹏辉能源	135,200	11,201,320.00	0.25
18	300483	首华燃气	623,700	10,964,646.00	0.25
19	300715	凯伦股份	665,700	10,957,422.00	0.25
20	002317	众生药业	430,345	10,573,576.65	0.24
21	688559	海目星	125,864	10,562,506.88	0.24
22	001337	四川黄金	274,102	10,048,579.32	0.23
23	002886	沃特股份	356,000	10,000,040.00	0.23
24	300607	拓斯达	236,500	9,750,895.00	0.22
25	601126	四方股份	146,700	9,271,440.00	0.21
26	688598	金博股份	186,562	9,225,490.90	0.21
27	002885	京泉华	217,200	8,874,792.00	0.20
28	300308	中际旭创	6,497	8,251,190.00	0.19
29	688115	思林杰	99,394	8,175,156.50	0.19
30	601777	千里科技	1,000,900	8,167,344.00	0.19
31	688256	寒武纪	4,883	7,791,070.65	0.18
32	600903	贵州燃气	1,114,800	7,402,272.00	0.17
33	300400	劲拓股份	195,400	7,356,810.00	0.17
34	300576	容大感光	141,420	7,243,532.40	0.16
35	688499	利元亨	137,650	7,233,507.50	0.16
36	002558	巨人网络	259,700	7,157,332.00	0.16
37	688382	益方生物	396,868	7,143,624.00	0.16

38	688396	华润微	69,900	6,818,745.00	0.15
39	301021	英诺激光	54,100	6,594,790.00	0.15
40	605123	派克新材	64,900	6,295,949.00	0.14
41	688320	禾川科技	151,138	6,264,670.10	0.14
42	300779	惠城环保	118,520	5,949,704.00	0.13
43	300863	卡倍亿	77,600	5,946,488.00	0.13
44	603439	三力制药	469,400	5,919,134.00	0.13
45	603006	联明股份	413,300	5,889,525.00	0.13
46	601872	招商轮船	334,700	5,880,679.00	0.13
47	601995	中金公司	161,500	5,838,225.00	0.13
48	301349	信德新材	78,800	5,799,680.00	0.13
49	603010	万盛股份	317,640	5,755,636.80	0.13
50	600999	招商证券	269,900	5,694,890.00	0.13
51	301389	隆扬电子	64,700	5,615,313.00	0.13
52	301095	广立微	47,000	5,548,350.00	0.13
53	001339	智微智能	52,660	5,386,064.80	0.12
54	001212	中旗新材	110,800	5,249,704.00	0.12
55	003025	思进智能	369,000	5,195,520.00	0.12
56	600619	海立股份	313,100	4,962,635.00	0.11
57	300283	温州宏丰	237,500	4,880,625.00	0.11
58	002468	申通快递	329,800	4,801,888.00	0.11
59	688609	九联科技	433,990	4,778,229.90	0.11
60	300033	同花顺	19,800	4,771,800.00	0.11
61	688208	道通科技	186,884	4,707,607.96	0.11
62	600026	中远海能	246,200	4,416,828.00	0.10
63	600888	新疆众和	277,300	4,406,297.00	0.10
64	603270	金帝股份	131,320	4,400,533.20	0.10
65	002057	中钢天源	339,500	4,219,985.00	0.10
66	688433	华曙高科	47,450	4,061,720.00	0.09
67	301511	德福科技	27,600	3,970,260.00	0.09
68	300319	麦捷科技	133,300	3,949,679.00	0.09
69	603876	鼎胜新材	151,800	3,948,318.00	0.09
70	300687	赛意信息	124,500	3,859,500.00	0.09
71	688255	凯尔达	138,241	3,843,099.80	0.09
72	688690	纳微科技	86,367	3,808,784.70	0.09
73	603078	江化微	77,000	3,805,340.00	0.09
74	601066	中信建投	130,500	3,793,635.00	0.09
75	600938	中国海油	130,600	3,545,790.00	0.08
76	688108	赛诺医疗	189,581	3,512,935.93	0.08
77	600727	鲁北化工	516,552	3,471,229.44	0.08
78	301218	华是科技	78,200	3,221,840.00	0.07
79	603068	博通集成	79,200	3,186,216.00	0.07
80	300491	通合科技	82,716	3,158,924.04	0.07

81	688199	久日新材	79,756	2,753,974.68	0.06
82	301310	鑫宏业	49,600	2,739,904.00	0.06
83	600810	神马股份	443,300	2,735,161.00	0.06
84	603980	吉华集团	406,300	2,697,832.00	0.06
85	301248	杰创智能	31,700	2,660,581.00	0.06
86	601985	中国核电	281,500	2,541,945.00	0.06
87	688416	恒烁股份	17,331	2,426,340.00	0.06
88	688262	国芯科技	53,300	2,304,159.00	0.05
89	300809	华辰装备	84,800	2,293,840.00	0.05
90	002577	雷柏科技	120,100	2,205,036.00	0.05
91	688350	富淼科技	62,821	2,169,209.13	0.05
92	600426	华鲁恒升	90,600	2,167,152.00	0.05
93	002249	大洋电机	273,700	2,052,750.00	0.05
94	300672	国科微	6,900	2,035,500.00	0.05
95	001266	宏英智能	37,500	1,841,250.00	0.04
96	600893	航发动力	47,000	1,801,980.00	0.04
97	600989	宝丰能源	85,100	1,730,083.00	0.04
98	603538	美诺华	52,400	1,705,620.00	0.04
99	688302	海创药业	47,681	1,676,940.77	0.04
100	300069	金利华电	52,400	1,667,892.00	0.04
101	301607	富特科技	31,560	1,649,010.00	0.04
102	688062	迈威生物	57,564	1,626,183.00	0.04
103	000026	飞亚达	68,400	1,473,336.00	0.03
104	002245	蔚蓝锂芯	77,800	1,455,638.00	0.03
105	688176	亚虹医药	138,070	1,369,654.40	0.03
106	688378	奥来德	21,500	1,333,000.00	0.03
107	002990	盛视科技	16,600	1,311,400.00	0.03
108	001314	亿道信息	21,100	1,303,980.00	0.03
109	688653	康希通信	74,400	1,293,072.00	0.03
110	688627	精智达	1,800	1,287,000.00	0.03
111	600088	中视传媒	117,200	1,276,308.00	0.03
112	002177	御银股份	225,200	1,274,632.00	0.03
113	603327	福蓉科技	148,500	1,259,280.00	0.03
114	002016	世荣兆业	310,900	1,243,600.00	0.03
115	300121	阳谷华泰	95,100	1,198,260.00	0.03
116	300820	英杰电气	12,600	1,136,898.00	0.03
117	002331	皖通科技	143,200	1,058,248.00	0.02
118	600641	先导基电	26,000	1,036,360.00	0.02
119	600176	中国巨石	14,200	1,034,896.00	0.02
120	688221	前沿生物	45,729	1,024,329.60	0.02
121	301265	华新科技	36,900	1,016,595.00	0.02
122	300731	科创新源	17,200	1,003,792.00	0.02
123	301316	慧博云通	23,400	921,492.00	0.02

124	688365	光云科技	55,730	878,862.10	0.02
125	600019	宝钢股份	160,144	869,581.92	0.02
126	688175	高凌信息	33,719	848,032.85	0.02
127	002979	雷赛智能	15,000	836,700.00	0.02
128	300726	宏达电子	9,600	811,872.00	0.02
129	688291	金橙子	13,546	792,170.08	0.02
130	603928	兴业股份	53,100	785,880.00	0.02
131	301550	斯菱智驱	8,400	768,012.00	0.02
132	300905	宝丽迪	15,100	764,060.00	0.02
133	300418	昆仑万维	18,900	762,804.00	0.02
134	300661	圣邦股份	5,200	746,096.00	0.02
135	000151	中成股份	69,700	745,790.00	0.02
136	300860	锋尚文化	28,700	734,720.00	0.02
137	300870	欧陆通	2,100	725,949.00	0.02
138	301085	亚康股份	11,900	721,259.00	0.02
139	688700	东威科技	8,000	715,200.00	0.02
140	002952	亚世光电	32,000	704,960.00	0.02
141	688373	盟科药业	153,130	693,678.90	0.02
142	301057	汇隆新材	29,000	667,000.00	0.02
143	300681	英搏尔	23,100	661,122.00	0.01
144	600150	中国船舶	19,400	655,526.00	0.01
145	603826	坤彩科技	25,100	641,556.00	0.01
146	002297	博云新材	21,800	631,982.00	0.01
147	688603	天承科技	3,000	623,850.00	0.01
148	600037	歌华有线	97,900	613,833.00	0.01
149	688620	安凯微	35,900	581,580.00	0.01
150	600460	士兰微	10,500	573,930.00	0.01
151	300488	恒锋工具	12,200	571,326.00	0.01
152	688337	普源精电	7,543	565,196.99	0.01
153	301071	力量钻石	5,960	551,300.00	0.01
154	603090	宏盛股份	10,600	541,236.00	0.01
155	301213	观想科技	10,940	537,591.60	0.01
156	605117	德业股份	4,900	520,282.00	0.01
157	301365	矩阵股份	13,000	492,830.00	0.01
158	002169	智光电气	33,500	490,440.00	0.01
159	002757	南兴股份	26,400	476,520.00	0.01
160	688719	爱科赛博	6,100	469,700.00	0.01
161	003016	欣贺股份	75,400	462,202.00	0.01
162	603390	通达电气	43,700	456,228.00	0.01
163	603678	火炬电子	5,300	439,900.00	0.01
164	000935	四川双马	16,800	438,312.00	0.01
165	301322	绿通科技	8,200	437,470.00	0.01
166	300277	汽轮科技	28,800	433,152.00	0.01

167	300191	潜能恒信	15,000	414,750.00	0.01
168	301305	朗坤科技	14,500	413,540.00	0.01
169	301487	盟固利	21,500	411,725.00	0.01
170	002391	长青股份	77,300	376,451.00	0.01
171	688183	生益电子	2,782	368,336.80	0.01
172	300921	南凌科技	17,440	354,206.40	0.01
173	300315	掌趣科技	88,400	344,760.00	0.01
174	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
175	300107	建新股份	58,300	326,480.00	0.01
176	300568	星源材质	16,900	316,368.00	0.01
177	603305	旭升集团	24,500	296,940.00	0.01
178	301360	荣旗科技	4,300	294,507.00	0.01
179	300031	宝通科技	9,700	277,129.00	0.01
180	688081	兴图新科	6,533	267,069.04	0.01
181	002772	众兴菌业	22,400	254,464.00	0.01
182	002017	东信和平	16,600	242,858.00	0.01
183	300579	数字认证	11,000	227,700.00	0.01
184	688443	智翔金泰	8,400	195,300.00	0.00
185	688275	万润新能	1,500	191,325.00	0.00
186	603681	永冠新材	8,200	187,370.00	0.00
187	603530	神马电力	3,600	183,240.00	0.00
188	002364	中恒电气	3,400	182,920.00	0.00
189	301055	张小泉	4,300	182,621.00	0.00
190	002034	旺能环境	11,700	177,255.00	0.00
191	688257	新锐股份	1,700	173,230.00	0.00
192	600323	瀚蓝环境	6,100	167,506.00	0.00
193	002648	卫星化学	6,700	157,383.00	0.00
194	002079	苏州固锝	9,400	141,282.00	0.00
195	600232	金鹰股份	21,900	137,970.00	0.00
196	688231	隆达股份	3,600	132,228.00	0.00
197	300151	昌红科技	5,200	129,740.00	0.00
198	603686	福龙马	10,000	129,200.00	0.00
199	002918	蒙娜丽莎	12,500	125,625.00	0.00
200	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
201	600547	山东黄金	4,800	110,832.00	0.00
202	000068	华控赛格	38,700	109,521.00	0.00
203	688112	鼎阳科技	1,460	107,251.60	0.00
204	688309	恒誉环保	1,614	98,260.32	0.00
205	601375	中原证券	24,600	98,154.00	0.00
206	688353	华盛锂电	800	92,856.00	0.00
207	688141	杰华特	600	92,100.00	0.00
208	000617	中油资本	13,900	91,601.00	0.00
209	600955	维远股份	6,200	91,264.00	0.00

210	002380	科远智慧	2,600	88,868.00	0.00
211	688028	沃尔德	544	84,793.28	0.00
212	300468	四方精创	3,500	73,535.00	0.00
213	688716	中研股份	2,300	72,289.00	0.00
214	300408	三环集团	400	66,760.00	0.00
215	300976	达瑞电子	800	63,720.00	0.00
216	600773	西藏城投	4,900	63,063.00	0.00
217	300199	翰宇药业	2,500	55,200.00	0.00
218	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
219	301571	国科天成	800	52,144.00	0.00
220	000837	秦川机床	4,600	51,106.00	0.00
221	301369	联动科技	200	49,000.00	0.00
222	002643	万润股份	2,200	46,090.00	0.00
223	002443	金洲管道	3,800	36,214.00	0.00
224	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
225	301025	读客文化	4,300	33,368.00	0.00
226	002398	垒知集团	8,700	32,625.00	0.00
227	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
228	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
229	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
230	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
231	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
232	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
233	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
234	603931	格林达	200	11,880.00	0.00
235	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
236	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
237	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
238	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
239	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
240	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
241	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
242	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	300136	信维通信	132,015,358.17	3.76

2	688347	华虹宏力	118,631,590.2 2	3.38
3	688183	生益电子	100,023,352.7 7	2.85
4	000703	恒逸石化	90,463,116.93	2.58
5	000519	中兵红箭	88,520,746.00	2.52
6	600118	中国卫星	86,683,567.35	2.47
7	002558	巨人网络	84,779,294.93	2.41
8	002335	科华数据	83,115,885.19	2.37
9	300223	北京君正	82,787,313.94	2.36
10	600884	杉杉股份	82,239,816.97	2.34
11	003022	联泓新科	80,802,955.00	2.30
12	600988	赤峰黄金	78,451,394.00	2.23
13	300475	香农芯创	77,319,159.95	2.20
14	300395	菲利华	76,150,028.94	2.17
15	600487	亨通光电	75,055,080.14	2.14
16	688469	芯联集成	69,230,849.05	1.97
17	002756	永兴材料	69,181,055.39	1.97
18	300390	天华新能	68,367,917.79	1.95
19	002281	光迅科技	68,303,941.00	1.95
20	603659	璞泰来	65,805,036.72	1.87

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	688347	华虹宏力	128,654,887.4 9	3.66
2	600549	厦门钨业	120,915,468.5 2	3.44
3	600487	亨通光电	115,618,197.0 5	3.29
4	688183	生益电子	114,776,317.0 0	3.27
5	300604	长川科技	109,817,619.6 8	3.13
6	002008	大族激光	104,280,396.6 5	2.97
7	301308	江波龙	102,882,142.3 8	2.93
8	600884	杉杉股份	99,026,805.00	2.82

9	300017	网宿科技	99,007,788.58	2.82
10	600118	中国卫星	93,437,360.14	2.66
11	300136	信维通信	92,595,659.58	2.64
12	300390	天华新能	91,888,044.70	2.62
13	002281	光迅科技	91,149,178.00	2.60
14	300395	菲利华	90,613,137.72	2.58
15	688336	三生国健	90,160,188.04	2.57
16	002558	巨人网络	90,106,077.00	2.57
17	002335	科华数据	88,779,386.28	2.53
18	002436	兴森科技	82,677,328.47	2.35
19	003031	中瓷电子	80,287,464.83	2.29
20	000060	中金岭南	76,987,059.15	2.19
21	600673	东阳光	74,041,072.00	2.11
22	688387	信科移动	72,182,476.76	2.06
23	600598	北大荒	71,839,642.50	2.05
24	603659	璞泰来	71,827,417.78	2.05
25	605358	立昂微	71,741,365.86	2.04
26	600988	赤峰黄金	71,246,576.38	2.03
27	000933	神火股份	70,900,413.00	2.02
28	001389	广合科技	70,859,622.00	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	14,168,635,106.27
卖出股票收入（成交）总额	14,276,556,527.31

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同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	12,819,964.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	17,550,783.06
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	30,370,747.86

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
国泰海通中证 500 指数增强 A	564,427	2,733.54	643,354,097.08	41.70%	899,529,301.06	58.30%
国泰海	449,757	2,659.8	526,714,521.42	44.03%	669,586,741.49	55.97%

通中证 500 指 数增强 C		8				
国泰海 通中证 500 指 数增强 Y	421	6,131.9 4	0.00	0.00%	2,581,544.75	100.00%
合计	1,014,60 5	2,702.3 0	1,170,068,618.5 0	42.68%	1,571,697,587.3 0	57.32%

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	国泰海通中证 500 指数增强 A	2,346,660.94	0.1521%
	国泰海通中证 500 指数增强 C	368,392.79	0.0308%
	国泰海通中证 500 指数增强 Y	51,491.46	1.9946%
	合计	2,766,545.19	0.1009%

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	国泰海通中证 500 指数增强 A	>100
	国泰海通中证 500 指数增强 C	0~10
	国泰海通中证 500 指数增强 Y	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 500 指数增强 A	>100
	国泰海通中证 500 指数增强 C	0~10
	国泰海通中证 500 指数增强 Y	0~10

	合计	>100
--	----	------

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通中证 500 指数增强 A	国泰海通中证 500 指数增强 C	国泰海通中 证 500 指数 增强 Y
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日） 基金份额总额	720,641,928.72	440,062,218.02	—
本报告期期初基金份额总额	1,691,449,234.85	1,020,482,300.50	762,988.81
本报告期基金总申购份额	812,320,517.50	1,435,997,059.99	2,503,361.72
减：本报告期基金总赎回份额	960,886,354.21	1,260,178,097.58	684,805.78
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,542,883,398.14	1,196,301,262.91	2,581,544.75

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门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

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理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	26,256,034,475.18	92.31%	1,872,187.96	89.09%	—
华宝证券股份有限公司	2	1,133,580,811.99	3.99%	154,053.52	7.33%	—
广发证券股份有限公司	2	1,054,173,386.10	3.71%	75,162.63	3.58%	—

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	国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金 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 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金 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 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
8	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
9	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

10	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
11	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
12	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、中国证监会准予国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

上海国泰海通证券资产管理有限公司

二〇二六年八月三十一日