

国泰海通中证全指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:江苏银行股份有限公司

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。

基金托管人江苏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	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	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	12
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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56

§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 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	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	60
§ 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	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰海通中证全指指数增强	
基金主代码	025308	
前端交易代码	025308	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 02 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	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	250,182,898.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通中证全指指数增强 A	国泰海通中证全指指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025308	025309
报告期末下属分级基金的份 额总额	72,298,995.05 份	177,883,902.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证全指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，在标的指数成份股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。 本基金的投资策略主要包括股票投资策略、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、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：中证全指指数收益率 $\times$ 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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	田作全
	联系电话	95521	025-58588321
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		95521	95319
传真		021-38871190	025-58588155
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	南京市中华路 26 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	南京市中华路 26 号
邮政编码		200011	210001
法定代表人		陶耿	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告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）	
	国泰海通中证全指指数增强 A	国泰海通中证全指指数增强 C
本期已实现收益	21,580,742.49	42,104,905.43
本期利润	24,837,476.93	50,992,283.37
加权平均基金份额本期利润	0.2300	0.2357

本期加权平均净值利润率	20.83%	21.26%
本期基金份额净值增长率	20.40%	20.16%
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	14,169,240.43	34,373,369.45
期末可供分配基金份额利润	0.1960	0.1932
期末基金资产净值	88,156,266.41	216,400,905.33
期末基金份额净值	1.2193	1.2165
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	21.93%	21.65%

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

国泰海通中证全指指数增强 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	17.23%	1.37%	11.53%	1.30%	5.70%	0.07%
过去六个月	20.40%	1.35%	10.19%	1.26%	10.21%	0.09%
自基金合同生 效起至今	21.93%	1.26%	12.58%	1.19%	9.35%	0.07%

国泰海通中证全指指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	17.12%	1.37%	11.53%	1.30%	5.59%	0.07%
过去六个月	20.16%	1.35%	10.19%	1.26%	9.97%	0.09%
自基金合同生 效起至今	21.65%	1.26%	12.58%	1.19%	9.07%	0.07%

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

国泰海通中证全指指数增强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
(2025年12月02日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰海通中证全指指数增强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
(2025年12月02日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 12 月 02 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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	2025-12-02	-	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。

	证全指指数增强基金经理，国泰海通创业板综指增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
刘晟	国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2025-12-02	-	4 年	刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。
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。	2025-12-02	-	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，中证全指（涨幅 10.69%）表现好于中证红利指数（跌幅 8.75%），但弱于中证 500 指数（涨幅 20.97%）、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。

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全指指数增强 A 基金份额净值为 1.2193 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 20.40%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%；截至报告期末国泰海通中证全指指数增强 C 基金份额净值为 1.2165 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 20.16%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为中证全指指数增强型基金，依托管理人在多基准、多策略上的长期布局，既做精做细每一个子策略，又强化整体策略配置能力。单个策略层面，持续挖掘有逻辑的 Alpha 因子、迭代底层模型并跟踪表现，坚守一贯投资体系，稳定超额收益预期。策略配置层面，追求科技成长与红利价值的动态均衡，同时适度配置全市场最大化 Alpha 策略和中小市值指增策略，实现大中小市值的持仓平衡，改善持有体验。作为指数增强产品，我们不以择时为主，通过稳定仓位充分兑现 Alpha 能力，并严格控制组合在行业和风格上相对基准的暴露，在充分控制跟踪误差的前提下，力争获得超越中证全指的收益。量化策略积少成多、以概率取胜，因此更需投资者长期耐心持有。当前市场整体估值仍处于历史相对合理区间，估值与盈利匹配角度看具备吸引力，我们将持续以科学手段强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。

4.6 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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现上海国泰海通证券资产管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通中证全指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	18,459,566.73	146,999,930.10
结算备付金		5,782,373.14	—

存出保证金		484,332.00	—
交易性金融资产	6.4.7.2	284,538,079.35	572,790,066.06
其中：股票投资		284,538,079.35	572,790,066.06
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		713,565.27	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		309,977,916.49	719,789,996.16
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		4,981,438.92	—

应付管理人报酬		217,756.20	453,384.97
应付托管费		40,829.26	85,009.69
应付销售服务费		80,311.11	158,252.58
应付投资顾问费		—	—
应交税费		7,383.88	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	93,025.38	9,873.30
负债合计		5,420,744.75	706,520.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	250,182,898.00	710,225,097.21
未分配利润	6.4.7.8	54,374,273.74	8,858,378.41
净资产合计		304,557,171.74	719,083,475.62
负债和净资产总计		309,977,916.49	719,789,996.16

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 250,182,898.00 份。其中国泰海通中证全指指数增强 A 基金份额净值 1.2193 元，基金份额总额 72,298,995.05 份；国泰海通中证全指指数增强 C 基金份额净值 1.2165 元，基金份额总额 177,883,902.95 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通中证全指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
一、营业总收入		78,109,351.33
1. 利息收入		71,642.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,118.91

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		3,523.84
2. 投资收益（损失以“-”填列）		65,836,290.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	62,981,213.46
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	1,216,866.33
股利收益	6.4.7.12	1,638,211.11
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	12,144,112.38
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	57,305.30
减：二、营业总支出		2,279,591.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,442,551.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	270,478.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	481,726.83
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		4,437.52
8. 其他费用	6.4.7.15	80,396.58

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		75,829,760.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		75,829,760.30
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		75,829,760.30

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通中证全指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	710,225,097.21	8,858,378.41	719,083,475.62
二、本期期初净资产	710,225,097.21	8,858,378.41	719,083,475.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-460,042,199.21	45,515,895.33	-414,526,303.88
（一）、综合收益总额	-	75,829,760.30	75,829,760.30
（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）	-460,042,199.21	-30,313,864.97	-490,356,064.18
其中：1. 基金申购款	212,915,944.71	26,551,385.66	239,467,330.37
2. 基金赎回款	-672,958,143.92	-56,865,250.63	-729,823,394.55
（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	250,182,898.00	54,374,273.74	304,557,171.74

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

国泰海通国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2025]1611号)批准,由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”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国泰海通国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发售,基金合同于2025年12月2日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定,首次设立募集规模为710,225,097.21份基金份额,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第2500111号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为710,225,097.21份基金份额,其中认购资金利息折合201,095.20份基金份额。本基金的基金管理人为国泰海通资管,托管人为江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)。

根据《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费,将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股(包括存托凭证、下同)、备选成份股(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、可转换债券(包括可交换债券、可分离交易债券)、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、股票期权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。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%,投资于中证全指指数成分股及其备选成分股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、股指期货、股票期权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。

本基金的业绩比较基准为:中证全指指数收益率 $\times$ 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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会

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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、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。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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号文《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号文《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》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税〔2025〕4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续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。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	7,805,185.09

等于：本金	7,803,005.22
加：应计利息	2,179.87
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	10,654,381.64
等于：本金	10,654,184.01
加：应计利息	197.63
减：坏账准备	-
合计	18,459,566.73

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		268,089,239.62	-	284,538,079.35	16,448,839.73
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		268,089,239.62	-	284,538,079.35	16,448,839.73

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	3,219,440.00	-	-	-
--股指期货	3,219,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,219,440.00	-	-	-

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
IC2609	IC2609	1	1,752,280.00	19,640.00
IF2607	IF2607	1	1,476,600.00	-10,200.00
合计				9,440.00
减：可抵销期货暂收款				9,440.00
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	-
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	69,442.21
预提审计费	20,827.67
其他应付	2,755.50
合计	93,025.38

6.4.7.7 实收基金

国泰海通中证全指指数增强 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	214,398,443.07	214,398,443.07
本期申购	28,828,544.00	28,828,544.00
本期赎回（以“-”号填列）	-170,927,992.02	-170,927,992.02
本期末	72,298,995.05	72,298,995.05

国泰海通中证全指指数增强 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	495,826,654.14	495,826,654.14
本期申购	184,087,400.71	184,087,400.71
本期赎回（以“-”号填列）	-502,030,151.90	-502,030,151.90
本期末	177,883,902.95	177,883,902.95

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

国泰海通中证全指指数增强 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	1,419,859.55	1,302,398.62	2,722,258.17
本期期初	1,419,859.55	1,302,398.62	2,722,258.17
本期利润	21,580,742.49	3,256,734.44	24,837,476.93
本期基金份额交易产生的变动数	-8,831,361.61	-2,871,102.13	-11,702,463.74
其中：基金申购款	3,273,427.15	-411,631.17	2,861,795.98
基金赎回款	-12,104,788.76	-2,459,470.96	-14,564,259.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,169,240.43	1,688,030.93	15,857,271.36

国泰海通中证全指指数增强 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	3,124,659.46	3,011,460.78	6,136,120.24
本期期初	3,124,659.46	3,011,460.78	6,136,120.24
本期利润	42,104,905.43	8,887,377.94	50,992,283.37
本期基金份额交易产生的变动数	-10,856,195.44	-7,755,205.79	-18,611,401.23
其中：基金申购款	22,007,564.21	1,682,025.47	23,689,589.68
基金赎回款	-32,863,759.65	-9,437,231.26	-42,300,990.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,373,369.45	4,143,632.93	38,517,002.38

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	60,361.31
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,338.02
结算备付金利息收入	3,419.58
其他	-
合计	68,118.91

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	1,576,964,624.40
减：卖出股票成本总额	1,512,636,969.53
减：交易费用	1,346,441.41

买卖股票差价收入	62,981,213.46
----------	---------------

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	1,269,620.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	36,979.23
减：交易费用	15,774.44
合计	1,216,866.33

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	1,638,211.11
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	1,638,211.11

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	12,134,980.33
——股票投资	12,134,980.33
——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	9,440.00
——权证投资	—
——期货投资	9,440.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	307.95
合计	12,144,112.38

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	57,305.15
转换费收入	0.15
合计	57,305.30

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	20,827.67
信息披露费	59,568.91
证券出借违约金	—
合计	80,396.58

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
江苏银行股份有限公司(以下简称 “江苏银行”)	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

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股票交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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
当期发生的基金应支付的管理费	1,442,551.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	666,475.48
应支付基金管理人的净管理费	776,076.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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
当期发生的基金应支付的托管费	270,478.43

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		
	国泰海通中证全指指数 增强 A	国泰海通中证全指指数 增强 C	合计
国泰海通资管	-	20,272.86	20,272.86
国泰海通证券	-	8,930.47	8,930.47
江苏银行	-	148,466.74	148,466.74
合计	-	177,670.07	177,670.07

注：本基金份额分为不同的类别，其中，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 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	7,805,185.09	60,361.31

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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
300332	天壕能源	2026-06-26	筹划发行股份购买资产	4.30	2026-07-09	4.64	62,000	285,530.06	266,600.00	-

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江苏银行股份有限公司，其他银行存款为国金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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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%。(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制)。

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。

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	18,459,566.73	-	-	-	18,459,566.73
结算备付金	5,782,373.14	-	-	-	5,782,373.14
存出保证金	-	-	-	484,332.00	484,332.00
交易性金融资产	-	-	-	284,538,079.35	284,538,079.35
应收申购款	-	-	-	713,565.27	713,565.27
资产总计	24,241,939.87	-	-	285,735,976.62	309,977,916.49

负债					
应付赎回款	-	-	-	4,981,438.92	4,981,438.92
应付管理人报酬	-	-	-	217,756.20	217,756.20
应付托管费	-	-	-	40,829.26	40,829.26
应付销售服务费	-	-	-	80,311.11	80,311.11
应交税费	-	-	-	7,383.88	7,383.88
其他负债	-	-	-	93,025.38	93,025.38
负债总计	-	-	-	5,420,744.75	5,420,744.75
利率敏感度缺口	24,241,939.87	-	-	280,315,231.87	304,557,171.74
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	146,999,930.10	-	-	-	146,999,930.10
交易性金融资产	-	-	-	572,790,066.06	572,790,066.06
资产总计	146,999,930.10	-	-	572,790,066.06	719,789,996.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	453,384.97	453,384.97
应付托管费	-	-	-	85,009.69	85,009.69
应付销售服务费	-	-	-	158,252.58	158,252.58
其他负债	-	-	-	9,873.30	9,873.30
负债总计	-	-	-	706,520.54	706,520.54
利率敏感度缺口	146,999,930.10	-	-	572,083,545.52	719,083,475.62

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	284,538,079.35	93.43	572,790,066.06	79.66
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	284,538,079.35	93.43	572,790,066.06	79.66

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	284,271,479.35	572,360,349.06
第二层次	266,600.00	429,717.00
第三层次	—	—
合计	284,538,079.35	572,790,066.06

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	284,538,079.35	91.79
	其中：股票	284,538,079.35	91.79
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	24,241,939.87	7.82
8	其他各项资产	1,197,897.27	0.39
9	合计	309,977,916.49	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	2,756,022.00	0.90
B	采矿业	13,124,135.58	4.31
C	制造业	196,150,503.98	64.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,157,237.00	1.69
E	建筑业	1,160,379.80	0.38
F	批发和零售业	7,659,971.00	2.52
G	交通运输、仓储和邮政业	7,169,888.93	2.35

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,849,305.16	5.86
J	金融业	24,833,172.21	8.15
K	房地产业	1,868,901.00	0.61
L	租赁和商务服务业	993,070.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	4,437,350.00	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	725,439.69	0.24
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	269,450.00	0.09
S	综合	383,253.00	0.13
	合计	284,538,079.35	93.43

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	7,600	9,652,000.00	3.17
2	300750	宁德时代	17,933	7,047,848.33	2.31
3	688256	寒武纪	3,383	5,397,745.65	1.77
4	300502	新易盛	6,661	4,043,227.00	1.33
5	300223	北京君正	13,300	3,310,370.00	1.09
6	300475	香农芯创	10,900	3,270,000.00	1.07
7	601398	工商银行	456,200	3,225,334.00	1.06
8	688110	东芯股份	15,400	3,136,980.00	1.03
9	688041	海光信息	7,581	2,807,244.30	0.92
10	301536	星辰科技	21,400	2,754,394.00	0.90
11	300408	三环集团	16,100	2,687,090.00	0.88
12	603259	药明康德	20,200	2,515,102.00	0.83
13	300661	圣邦股份	17,100	2,453,508.00	0.81

14	600999	招商证券	111,000	2,342,100.00	0.77
15	600019	宝钢股份	409,900	2,225,757.00	0.73
16	688981	中芯国际	13,345	2,119,452.90	0.70
17	688396	华润微	21,090	2,057,329.50	0.68
18	688469	芯联集成	191,800	2,034,998.00	0.67
19	300136	信维通信	16,900	2,015,325.00	0.66
20	601899	紫金矿业	79,700	2,003,658.00	0.66
21	601658	邮储银行	402,900	1,986,297.00	0.65
22	688456	有研粉材	14,113	1,970,174.80	0.65
23	688301	奕瑞科技	15,240	1,889,760.00	0.62
24	300620	光库科技	4,900	1,853,180.00	0.61
25	601985	中国核电	202,800	1,831,284.00	0.60
26	300033	同花顺	7,520	1,812,320.00	0.60
27	601995	中金公司	50,100	1,811,115.00	0.59
28	301511	德福科技	12,400	1,783,740.00	0.59
29	601988	中国银行	310,100	1,773,772.00	0.58
30	688559	海目星	21,100	1,770,712.00	0.58
31	601816	京沪高铁	386,400	1,750,392.00	0.57
32	601328	交通银行	260,600	1,675,658.00	0.55
33	301611	珂玛科技	8,900	1,602,623.00	0.53
34	000933	神火股份	75,200	1,594,240.00	0.52
35	300260	新莱应材	15,600	1,567,176.00	0.51
36	601225	陕西煤业	76,500	1,556,775.00	0.51
37	688090	瑞松科技	14,590	1,553,105.50	0.51
38	688320	禾川科技	37,100	1,537,795.00	0.50
39	300438	鹏辉能源	18,500	1,532,725.00	0.50
40	000048	京基智农	66,900	1,477,821.00	0.49
41	603986	兆易创新	1,800	1,467,000.00	0.48
42	600018	上港集团	309,900	1,462,728.00	0.48
43	601857	中国石油	168,100	1,459,108.00	0.48
44	603083	剑桥科技	5,700	1,452,759.00	0.48
45	603516	淳中科技	10,300	1,386,483.00	0.46
46	300491	通合科技	36,200	1,382,478.00	0.45
47	600938	中国海油	50,500	1,371,075.00	0.45
48	002885	京泉华	33,500	1,368,810.00	0.45
49	688416	恒烁股份	9,774	1,368,360.00	0.45
50	600030	中信证券	47,400	1,361,802.00	0.45
51	300857	协创数据	4,000	1,359,600.00	0.45
52	300283	温州宏丰	66,100	1,358,355.00	0.45
53	001389	广合科技	5,700	1,352,325.00	0.44
54	301607	富特科技	25,860	1,351,185.00	0.44
55	300715	凯伦股份	80,200	1,320,092.00	0.43
56	301389	隆扬电子	15,100	1,310,529.00	0.43

57	301310	鑫宏业	23,200	1,281,568.00	0.42
58	300489	光智科技	4,100	1,278,995.00	0.42
59	002843	泰嘉股份	59,300	1,273,171.00	0.42
60	688266	泽璟制药	10,891	1,270,544.06	0.42
61	300672	国科微	4,300	1,268,500.00	0.42
62	600104	上汽集团	129,900	1,267,824.00	0.42
63	300607	拓斯达	30,700	1,265,761.00	0.42
64	688107	安路科技	27,499	1,253,954.40	0.41
65	002399	海普瑞	137,500	1,234,750.00	0.41
66	688012	中微公司	2,635	1,234,497.50	0.41
67	002484	江海股份	11,600	1,218,000.00	0.40
68	002338	奥普光电	21,200	1,212,640.00	0.40
69	600309	万华化学	17,700	1,210,857.00	0.40
70	600601	方正科技	86,400	1,195,776.00	0.39
71	601998	中信银行	171,500	1,188,495.00	0.39
72	300820	英杰电气	12,900	1,163,967.00	0.38
73	301297	富乐德	18,400	1,126,816.00	0.37
74	688108	赛诺医疗	60,656	1,123,955.68	0.37
75	688653	康希通信	64,600	1,122,748.00	0.37
76	688183	生益电子	8,373	1,108,585.20	0.36
77	301099	雅创电子	11,600	1,107,800.00	0.36
78	688609	九联科技	100,600	1,107,606.00	0.36
79	600176	中国巨石	14,800	1,078,624.00	0.35
80	688629	华丰科技	5,700	1,068,807.00	0.35
81	000333	美的集团	14,100	1,064,973.00	0.35
82	000519	中兵红箭	49,700	1,047,179.00	0.34
83	688220	翱捷科技	8,151	1,013,332.32	0.33
84	300121	阳谷华泰	79,800	1,005,480.00	0.33
85	300069	金利华电	31,100	989,913.00	0.33
86	601872	招商轮船	56,100	985,677.00	0.32
87	601066	中信建投	33,903	985,560.21	0.32
88	301095	广立微	8,300	979,815.00	0.32
89	688365	光云科技	60,779	958,484.83	0.31
90	600887	伊利股份	39,500	946,420.00	0.31
91	688192	迪哲医药	22,400	894,432.00	0.29
92	601699	潞安环能	62,600	893,928.00	0.29
93	300976	达瑞电子	11,200	892,080.00	0.29
94	688499	利元亨	16,402	861,925.10	0.28
95	601898	中煤能源	70,300	856,254.00	0.28
96	688115	思林杰	10,331	849,724.75	0.28
97	688719	爱科赛博	10,833	834,141.00	0.27
98	600547	山东黄金	35,562	821,126.58	0.27
99	600183	生益科技	4,500	780,300.00	0.26

100	300687	赛意信息	25,000	775,000.00	0.25
101	601939	建设银行	80,200	772,326.00	0.25
102	600460	士兰微	14,000	765,240.00	0.25
103	688598	金博股份	15,400	761,530.00	0.25
104	688498	源杰科技	400	754,400.00	0.25
105	300483	首华燃气	42,900	754,182.00	0.25
106	301150	中一科技	11,940	753,533.40	0.25
107	002952	亚世光电	33,800	744,614.00	0.24
108	688309	恒誉环保	12,200	742,736.00	0.24
109	003016	欣贺股份	120,100	736,213.00	0.24
110	301218	华是科技	17,800	733,360.00	0.24
111	002016	世荣兆业	180,200	720,800.00	0.24
112	600426	华鲁恒升	29,400	703,248.00	0.23
113	688111	金山办公	3,300	703,065.00	0.23
114	301369	联动科技	2,865	701,925.00	0.23
115	605123	派克新材	7,100	688,771.00	0.23
116	600872	中炬高新	39,300	682,248.00	0.22
117	300315	掌趣科技	172,200	671,580.00	0.22
118	600810	神马股份	106,200	655,254.00	0.22
119	001212	中旗新材	13,800	653,844.00	0.21
120	000001	平安银行	64,900	652,245.00	0.21
121	688378	奥来德	10,500	651,000.00	0.21
122	300779	惠城环保	12,900	647,580.00	0.21
123	301587	中瑞股份	29,400	645,330.00	0.21
124	688275	万润新能	5,000	637,750.00	0.21
125	688172	燕东微	7,607	636,401.62	0.21
126	601138	工业富联	8,800	634,920.00	0.21
127	600893	航发动力	16,500	632,610.00	0.21
128	600989	宝丰能源	30,500	620,065.00	0.20
129	000151	中成股份	57,000	609,900.00	0.20
130	300576	容大感光	11,900	609,518.00	0.20
131	002391	长青股份	124,000	603,880.00	0.20
132	688197	首药控股	17,900	598,039.00	0.20
133	002521	齐峰新材	82,400	596,576.00	0.20
134	688382	益方生物	33,114	596,052.00	0.20
135	603876	鼎胜新材	22,800	593,028.00	0.19
136	601375	中原证券	148,400	592,116.00	0.19
137	603530	神马电力	11,500	585,350.00	0.19
138	688221	前沿生物	26,100	584,640.00	0.19
139	301487	盟固利	30,100	576,415.00	0.19
140	603799	华友钴业	11,800	569,468.00	0.19
141	601600	中国铝业	68,900	566,358.00	0.19
142	688262	国芯科技	13,100	566,313.00	0.19

143	301489	思泉新材	3,440	566,155.20	0.19
144	603006	联明股份	39,400	561,450.00	0.18
145	600619	海立股份	35,300	559,505.00	0.18
146	300726	宏达电子	6,600	558,162.00	0.18
147	601997	贵阳银行	108,700	557,631.00	0.18
148	300319	麦捷科技	18,800	557,044.00	0.18
149	300476	胜宏科技	1,600	554,288.00	0.18
150	002851	麦格米特	3,300	551,694.00	0.18
151	600011	华能国际	71,800	544,962.00	0.18
152	688690	纳微科技	12,300	542,430.00	0.18
153	688202	美迪西	6,700	540,757.00	0.18
154	600257	大湖股份	124,600	539,518.00	0.18
155	300425	中建环能	143,600	537,064.00	0.18
156	001337	四川黄金	14,400	527,904.00	0.17
157	300579	数字认证	25,500	527,850.00	0.17
158	688373	盟科药业	115,762	524,401.86	0.17
159	002245	蔚蓝锂芯	27,900	522,009.00	0.17
160	600515	海南机场	190,300	521,422.00	0.17
161	600346	恒力石化	29,300	518,903.00	0.17
162	002001	新和成	18,200	517,244.00	0.17
163	601009	南京银行	52,000	514,280.00	0.17
164	002057	中钢天源	41,300	513,359.00	0.17
165	601665	齐鲁银行	88,400	510,068.00	0.17
166	300681	英搏尔	17,742	507,776.04	0.17
167	688347	华虹宏力	1,500	504,450.00	0.17
168	000617	中油资本	76,200	502,158.00	0.16
169	600008	首创环保	182,400	496,128.00	0.16
170	003022	联泓新科	19,100	494,690.00	0.16
171	002169	智光电气	33,300	487,512.00	0.16
172	600585	海螺水泥	28,700	486,465.00	0.16
173	603068	博通集成	12,000	482,760.00	0.16
174	300400	劲拓股份	12,700	478,155.00	0.16
175	001339	智微智能	4,660	476,624.80	0.16
176	600519	贵州茅台	400	474,196.00	0.16
177	601777	千里科技	58,000	473,280.00	0.16
178	688166	博瑞医药	13,500	472,635.00	0.16
179	300031	宝通科技	16,500	471,405.00	0.15
180	002966	苏州银行	67,400	469,104.00	0.15
181	301057	汇隆新材	20,300	466,900.00	0.15
182	688323	瑞华泰	8,200	463,300.00	0.15
183	603728	鸣志电器	7,600	462,992.00	0.15
184	600808	马钢股份	184,700	461,750.00	0.15
185	601088	中国神华	11,800	460,672.00	0.15

186	300623	捷捷微电	9,900	445,401.00	0.15
187	300274	阳光电源	2,800	445,256.00	0.15
188	300570	太辰光	1,800	444,078.00	0.15
189	301116	益客食品	51,800	443,408.00	0.15
190	688343	云天励飞	5,406	441,453.96	0.14
191	300322	硕贝德	17,300	435,960.00	0.14
192	600638	新黄浦	99,500	434,815.00	0.14
193	002641	公元股份	112,600	434,636.00	0.14
194	300856	科思股份	40,600	432,796.00	0.14
195	601288	农业银行	71,100	431,577.00	0.14
196	300281	金明精机	71,200	429,336.00	0.14
197	300346	南大光电	4,600	426,190.00	0.14
198	300575	中旗股份	86,000	423,120.00	0.14
199	300153	科泰电源	18,700	422,994.00	0.14
200	688081	兴图新科	10,338	422,617.44	0.14
201	688615	合合信息	3,700	418,470.00	0.14
202	688291	金橙子	7,129	416,903.92	0.14
203	300604	长川科技	1,200	409,704.00	0.13
204	300401	花园生物	18,600	407,154.00	0.13
205	600188	兖矿能源	22,700	403,379.00	0.13
206	000090	天健集团	133,700	402,437.00	0.13
207	002398	垒知集团	107,300	402,375.00	0.13
208	301238	瑞泰新材	16,300	397,720.00	0.13
209	002064	华峰化学	41,900	397,631.00	0.13
210	600805	悦达投资	95,100	383,253.00	0.13
211	301349	信德新材	5,200	382,720.00	0.13
212	600026	中远海能	21,300	382,122.00	0.13
213	600628	新世界	67,400	379,462.00	0.12
214	300481	濮阳惠成	19,500	370,890.00	0.12
215	600395	盘江股份	81,100	369,816.00	0.12
216	600886	国投电力	27,700	368,687.00	0.12
217	688199	久日新材	10,562	364,705.86	0.12
218	001314	亿道信息	5,900	364,620.00	0.12
219	300394	天孚通信	1,200	363,216.00	0.12
220	600269	赣粤高速	91,100	362,578.00	0.12
221	300602	飞荣达	7,000	358,400.00	0.12
222	688257	新锐股份	3,500	356,650.00	0.12
223	600903	贵州燃气	53,700	356,568.00	0.12
224	600858	银座股份	80,700	355,887.00	0.12
225	601086	国芳集团	53,000	351,390.00	0.12
226	000690	宝新能源	74,300	349,210.00	0.11
227	600865	百大集团	42,600	348,894.00	0.11
228	300458	全志科技	8,840	348,826.40	0.11

229	600028	中国石化	77,500	345,650.00	0.11
230	301382	蜂助手	7,400	340,400.00	0.11
231	603826	坤彩科技	13,300	339,948.00	0.11
232	688679	通源环境	8,041	338,445.69	0.11
233	301178	天亿马	6,800	338,300.00	0.11
234	002648	卫星化学	14,400	338,256.00	0.11
235	300691	联合光电	21,200	335,172.00	0.11
236	600598	北大荒	30,600	331,704.00	0.11
237	600031	三一重工	19,000	328,320.00	0.11
238	688148	芳源股份	37,991	325,962.78	0.11
239	300107	建新股份	58,000	324,800.00	0.11
240	301085	亚康股份	5,300	321,233.00	0.11
241	688231	隆达股份	8,660	318,081.80	0.10
242	002886	沃特股份	11,200	314,608.00	0.10
243	301571	国科天成	4,800	312,864.00	0.10
244	600846	同济科技	31,100	311,000.00	0.10
245	688031	星环科技	2,700	310,986.00	0.10
246	301248	杰创智能	3,700	310,541.00	0.10
247	688175	高凌信息	12,095	304,189.25	0.10
248	600150	中国船舶	9,000	304,110.00	0.10
249	688350	富淼科技	8,800	303,864.00	0.10
250	600369	西南证券	74,300	298,686.00	0.10
251	600738	丽尚国潮	82,100	295,560.00	0.10
252	688255	凯尔达	10,600	294,680.00	0.10
253	600020	中原高速	78,900	291,141.00	0.10
254	000032	深桑达 A	11,500	286,925.00	0.09
255	300617	安靠智电	5,400	286,146.00	0.09
256	002292	奥飞娱乐	43,000	282,080.00	0.09
257	688028	沃尔德	1,800	280,566.00	0.09
258	300613	富瀚微	3,500	280,280.00	0.09
259	688008	澜起科技	900	278,910.00	0.09
260	601126	四方股份	4,400	278,080.00	0.09
261	300548	长芯博创	1,000	278,000.00	0.09
262	002380	科远智慧	8,000	273,440.00	0.09
263	600801	华新建材	17,500	273,000.00	0.09
264	688388	嘉元科技	6,200	272,800.00	0.09
265	600681	百川能源	83,200	268,736.00	0.09
266	301391	卡莱特	4,700	268,370.00	0.09
267	600196	复星医药	11,900	267,393.00	0.09
268	688353	华盛锂电	2,300	266,961.00	0.09
269	300332	天壕能源	62,000	266,600.00	0.09
270	600125	铁龙物流	52,500	266,175.00	0.09
271	300814	中富电路	1,300	265,850.00	0.09

272	301396	宏景科技	800	265,280.00	0.09
273	600816	建元信托	108,600	264,984.00	0.09
274	600029	南方航空	50,900	263,662.00	0.09
275	600809	山西汾酒	2,400	262,488.00	0.09
276	301251	威尔高	4,900	261,072.00	0.09
277	001266	宏英智能	5,300	260,230.00	0.09
278	300488	恒锋工具	5,500	257,565.00	0.08
279	000762	西藏矿业	9,600	256,320.00	0.08
280	603439	三力制药	20,200	254,722.00	0.08
281	688001	华兴源创	2,960	253,672.00	0.08
282	600727	鲁北化工	37,600	252,672.00	0.08
283	002755	奥赛康	18,500	251,970.00	0.08
284	603327	福蓉科技	29,600	251,008.00	0.08
285	001359	平安电工	2,000	250,500.00	0.08
286	000026	飞亚达	11,600	249,864.00	0.08
287	600955	维远股份	16,900	248,768.00	0.08
288	000708	中信特钢	19,700	248,614.00	0.08
289	002364	中恒电气	4,600	247,480.00	0.08
290	300568	星源材质	13,100	245,232.00	0.08
291	603010	万盛股份	13,400	242,808.00	0.08
292	002162	悦心健康	71,600	242,008.00	0.08
293	001696	宗申动力	11,600	241,396.00	0.08
294	688728	格科微	11,354	238,888.16	0.08
295	300921	南凌科技	11,620	236,002.20	0.08
296	002187	广百股份	50,100	234,468.00	0.08
297	002017	东信和平	15,800	231,154.00	0.08
298	300741	华宝股份	18,400	230,368.00	0.08
299	002331	皖通科技	30,700	226,873.00	0.07
300	002443	金洲管道	23,700	225,861.00	0.07
301	000921	海信家电	8,200	224,024.00	0.07
302	600308	华泰股份	74,600	223,054.00	0.07
303	300418	昆仑万维	5,500	221,980.00	0.07
304	002792	通宇通讯	6,200	220,534.00	0.07
305	600623	华谊集团	27,300	220,311.00	0.07
306	601077	渝农商行	35,800	218,738.00	0.07
307	000568	泸州老窖	2,800	217,056.00	0.07
308	600105	永鼎股份	3,200	215,936.00	0.07
309	002460	赣锋锂业	3,300	215,820.00	0.07
310	601279	英利汽车	69,800	212,890.00	0.07
311	600900	长江电力	8,000	211,760.00	0.07
312	601069	西部黄金	9,600	211,200.00	0.07
313	688428	诺诚健华	7,404	210,791.88	0.07
314	000421	南京公用	42,000	208,320.00	0.07

315	301366	一博科技	3,300	201,861.00	0.07
316	600888	新疆众和	12,600	200,214.00	0.07
317	002365	永安药业	19,700	199,364.00	0.07
318	603686	福龙马	15,300	197,676.00	0.06
319	603980	吉华集团	29,700	197,208.00	0.06
320	600232	金鹰股份	31,300	197,190.00	0.06
321	003816	中国广核	50,200	196,282.00	0.06
322	002042	华孚时尚	56,400	192,324.00	0.06
323	300817	双飞集团	12,200	190,320.00	0.06
324	003025	思进智能	13,380	188,390.40	0.06
325	002344	海宁皮城	53,800	188,300.00	0.06
326	601677	明泰铝业	11,200	185,920.00	0.06
327	002625	光启技术	6,100	184,952.00	0.06
328	600498	烽火通信	2,500	184,000.00	0.06
329	688158	优刻得	5,000	183,800.00	0.06
330	002458	益生股份	23,300	181,041.00	0.06
331	002371	北方华创	200	176,912.00	0.06
332	600415	小商品城	17,400	176,784.00	0.06
333	301260	格力博	13,000	175,630.00	0.06
334	688522	纳睿雷达	8,755	175,275.10	0.06
335	000807	云铝股份	7,900	174,906.00	0.06
336	605118	力鼎光电	5,000	174,450.00	0.06
337	601919	中远海控	13,130	174,103.80	0.06
338	601326	秦港股份	54,600	172,536.00	0.06
339	002558	巨人网络	6,200	170,872.00	0.06
340	301021	英诺激光	1,400	170,660.00	0.06
341	000837	秦川机床	15,300	169,983.00	0.06
342	300863	卡倍亿	2,200	168,586.00	0.06
343	300511	雪榕生物	33,400	168,002.00	0.06
344	300756	金马游乐	5,040	166,572.00	0.05
345	000088	盐田港	40,600	166,054.00	0.05
346	600320	振华重工	40,100	165,613.00	0.05
347	601888	中国中免	3,000	161,130.00	0.05
348	601000	唐山港	38,700	160,605.00	0.05
349	000061	农产品	28,600	160,160.00	0.05
350	603681	永冠新材	7,000	159,950.00	0.05
351	605117	德业股份	1,500	159,270.00	0.05
352	600741	华域汽车	10,200	158,304.00	0.05
353	603158	腾龙股份	12,900	157,767.00	0.05
354	601168	西部矿业	5,800	157,412.00	0.05
355	601881	中国银河	12,500	157,125.00	0.05
356	688062	迈威生物	5,500	155,375.00	0.05
357	002918	蒙娜丽莎	15,300	153,765.00	0.05

358	603725	天安新材	13,600	153,680.00	0.05
359	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.05
360	688235	百济神州	600	152,766.00	0.05
361	688443	智翔金泰	6,500	151,125.00	0.05
362	603198	迎驾贡酒	5,100	150,960.00	0.05
363	600006	东风股份	28,700	147,231.00	0.05
364	002067	景兴纸业	39,700	146,096.00	0.05
365	002079	苏州固锔	9,700	145,791.00	0.05
366	688700	东威科技	1,600	143,040.00	0.05
367	600626	申达股份	44,700	142,593.00	0.05
368	603486	科沃斯	2,800	142,100.00	0.05
369	300843	胜蓝股份	900	140,625.00	0.05
370	002317	众生药业	5,700	140,049.00	0.05
371	603078	江化微	2,800	138,376.00	0.05
372	300870	欧陆通	400	138,276.00	0.05
373	688716	中研股份	4,350	136,720.50	0.04
374	600824	益民集团	40,500	133,245.00	0.04
375	600335	国机汽车	28,000	131,040.00	0.04
376	688302	海创药业	3,710	130,480.70	0.04
377	301246	宏源药业	4,800	129,120.00	0.04
378	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.04
379	688018	乐鑫科技	1,000	127,920.00	0.04
380	300284	苏交科	25,100	125,500.00	0.04
381	300998	宁波方正	4,500	125,235.00	0.04
382	603132	金徽股份	8,000	124,640.00	0.04
383	688165	埃夫特	6,100	124,440.00	0.04
384	603270	金帝股份	3,700	123,987.00	0.04
385	688168	安博通	1,800	123,750.00	0.04
386	300199	翰宇药业	5,600	123,648.00	0.04
387	000514	渝开发	34,500	123,510.00	0.04
388	000301	东方盛虹	10,700	122,515.00	0.04
389	688409	富创精密	400	122,500.00	0.04
390	688678	福立旺	4,976	120,269.92	0.04
391	301206	三元生物	5,400	120,042.00	0.04
392	301213	观想科技	2,440	119,901.60	0.04
393	600546	山煤国际	10,800	118,044.00	0.04
394	600158	中体产业	17,500	117,950.00	0.04
395	002274	华昌化工	25,000	115,750.00	0.04
396	688620	安凯微	7,100	115,020.00	0.04
397	000776	广发证券	4,900	114,660.00	0.04
398	601788	光大证券	7,900	113,997.00	0.04
399	000557	西部创业	32,800	113,488.00	0.04
400	603186	华正新材	500	112,650.00	0.04

401	601858	中国科传	6,500	112,515.00	0.04
402	300127	银河磁体	4,000	111,800.00	0.04
403	301305	朗坤科技	3,900	111,228.00	0.04
404	601229	上海银行	12,800	111,104.00	0.04
405	603915	国茂股份	7,800	110,682.00	0.04
406	601668	中国建筑	25,500	110,670.00	0.04
407	300468	四方精创	5,200	109,252.00	0.04
408	688390	固德威	1,000	108,510.00	0.04
409	000796	凯撒旅业	27,800	106,474.00	0.03
410	600971	恒源煤电	15,300	105,570.00	0.03
411	600282	南钢股份	22,900	105,111.00	0.03
412	002990	盛视科技	1,300	102,700.00	0.03
413	600549	厦门钨业	1,200	102,240.00	0.03
414	002863	今飞凯达	23,500	99,640.00	0.03
415	300582	英飞特	8,100	98,658.00	0.03
416	301526	国际复材	2,100	98,007.00	0.03
417	603086	先达股份	18,800	97,572.00	0.03
418	002821	凯莱英	600	97,200.00	0.03
419	300939	秋田微	1,400	96,880.00	0.03
420	600352	浙江龙盛	8,000	96,880.00	0.03
421	300512	中亚股份	14,200	96,844.00	0.03
422	301265	华新科技	3,500	96,425.00	0.03
423	300587	天铁科技	24,900	95,865.00	0.03
424	688180	君实生物	2,800	94,696.00	0.03
425	600908	无锡银行	18,500	93,980.00	0.03
426	000792	盐湖股份	3,100	93,589.00	0.03
427	688035	德邦科技	1,000	91,800.00	0.03
428	688299	长阳科技	5,400	90,234.00	0.03
429	603496	恒为科技	3,900	89,622.00	0.03
430	688599	天合光能	6,300	88,956.00	0.03
431	002136	安纳达	6,800	88,944.00	0.03
432	301357	北方长龙	1,100	86,999.00	0.03
433	300910	瑞丰新材	3,100	86,924.00	0.03
434	000686	东北证券	10,300	86,520.00	0.03
435	000055	方大集团	25,000	84,250.00	0.03
436	301393	昊帆生物	1,300	84,201.00	0.03
437	300852	四会富仕	1,200	83,088.00	0.03
438	300191	潜能恒信	3,000	82,950.00	0.03
439	300803	指南针	900	82,503.00	0.03
440	002468	申通快递	5,600	81,536.00	0.03
441	002487	大金重工	1,400	81,158.00	0.03
442	688787	海天瑞声	600	80,670.00	0.03
443	600724	宁波富达	15,900	80,613.00	0.03

444	688387	信科移动	4,057	80,490.88	0.03
445	688503	聚和材料	600	79,620.00	0.03
446	002228	合兴包装	26,800	78,792.00	0.03
447	600009	上海机场	3,400	78,540.00	0.03
448	000676	智度股份	15,300	78,183.00	0.03
449	002757	南兴股份	4,300	77,615.00	0.03
450	600189	泉阳泉	10,300	77,559.00	0.03
451	603598	引力传媒	4,500	77,175.00	0.03
452	300913	兆龙互连	1,600	76,656.00	0.03
453	000825	太钢不锈	22,100	75,361.00	0.02
454	603893	瑞芯微	400	75,344.00	0.02
455	600267	海正药业	7,400	74,814.00	0.02
456	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.02
457	300959	线上线下	500	73,905.00	0.02
458	601137	博威合金	3,300	73,689.00	0.02
459	300809	华辰装备	2,700	73,035.00	0.02
460	300768	迪普科技	5,300	72,981.00	0.02
461	301210	金杨精密	2,400	72,000.00	0.02
462	002405	四维图新	10,900	70,523.00	0.02
463	600985	淮北矿业	4,900	68,845.00	0.02
464	603928	兴业股份	4,600	68,080.00	0.02
465	603013	亚普股份	4,300	67,897.00	0.02
466	603511	爱慕股份	5,900	67,850.00	0.02
467	002846	英联股份	6,400	67,776.00	0.02
468	603032	德新科技	2,500	67,250.00	0.02
469	688680	海优新材	1,600	67,200.00	0.02
470	002811	郑中设计	5,900	66,021.00	0.02
471	600548	深高速	8,101	65,861.13	0.02
472	601518	吉林高速	23,300	65,240.00	0.02
473	601666	平煤股份	9,100	65,065.00	0.02
474	688772	珠海冠宇	3,300	64,779.00	0.02
475	688120	华海清科	200	64,436.00	0.02
476	002493	荣盛石化	5,900	63,425.00	0.02
477	600690	海尔智家	3,000	61,230.00	0.02
478	002917	金奥博	5,800	61,132.00	0.02
479	300450	先导智能	1,500	61,080.00	0.02
480	000810	创维数字	4,600	60,950.00	0.02
481	002204	大连重工	11,400	60,192.00	0.02
482	301281	科源制药	1,200	59,160.00	0.02
483	603638	艾迪精密	2,500	58,625.00	0.02
484	002772	众兴菌业	5,100	57,936.00	0.02
485	000895	双汇发展	2,500	56,000.00	0.02
486	603507	振江股份	1,700	55,913.00	0.02

487	300496	中科创达	900	55,611.00	0.02
488	688216	气派科技	1,315	55,243.15	0.02
489	000888	峨眉山 A	6,100	54,534.00	0.02
490	601500	通用股份	14,700	53,655.00	0.02
491	002078	太阳纸业	4,200	52,458.00	0.02
492	300909	汇创达	900	52,398.00	0.02
493	601766	中国中车	9,600	49,920.00	0.02
494	300752	隆利科技	3,700	49,839.00	0.02
495	000949	新乡化纤	7,800	49,452.00	0.02
496	000886	海南高速	11,900	48,552.00	0.02
497	688045	必易微	600	48,468.00	0.02
498	603345	安井食品	600	48,114.00	0.02
499	000969	安泰科技	1,900	46,626.00	0.02
500	300917	特发服务	1,900	46,322.00	0.02
501	002916	深南电路	100	45,790.00	0.02
502	300473	德尔股份	1,500	45,600.00	0.01
503	600061	国投资本	6,900	45,195.00	0.01
504	600814	杭州解百	7,400	45,140.00	0.01
505	000672	上峰材料	1,900	44,992.00	0.01
506	688222	成都先导	1,400	44,954.00	0.01
507	603618	杭电股份	900	44,892.00	0.01
508	001965	招商公路	4,800	43,968.00	0.01
509	300590	移为通信	3,000	43,050.00	0.01
510	002054	德美化工	6,400	42,560.00	0.01
511	603848	好太太	3,100	42,346.00	0.01
512	000703	恒逸石化	3,100	42,067.00	0.01
513	688261	东微半导	400	41,972.00	0.01
514	300414	中光防雷	3,800	41,876.00	0.01
515	600037	歌华有线	6,600	41,382.00	0.01
516	300592	华凯易佰	2,300	40,710.00	0.01
517	300486	东杰智能	1,900	40,565.00	0.01
518	688628	优利德	400	39,576.00	0.01
519	688135	利扬芯片	900	37,872.00	0.01
520	603819	神力股份	3,300	37,785.00	0.01
521	600717	天津港	9,700	37,733.00	0.01
522	603565	中谷物流	3,700	36,297.00	0.01
523	688088	虹软科技	1,000	35,550.00	0.01
524	688249	晶合集成	600	35,418.00	0.01
525	300381	溢多利	6,100	34,282.00	0.01
526	688321	微芯生物	1,300	34,229.00	0.01
527	300464	星徽股份	4,800	34,224.00	0.01
528	688246	嘉和美康	1,636	33,619.80	0.01
529	000990	诚志股份	4,100	33,538.00	0.01

530	002320	海峡股份	5,300	33,231.00	0.01
531	600787	中储股份	7,800	32,604.00	0.01
532	002930	宏川智慧	3,500	32,200.00	0.01
533	301128	强瑞技术	200	31,180.00	0.01
534	000987	越秀资本	3,900	30,498.00	0.01
535	300905	宝丽迪	600	30,360.00	0.01
536	603071	物产环能	2,600	28,756.00	0.01
537	002756	永兴材料	500	28,320.00	0.01
538	600348	华阳股份	3,700	28,305.00	0.01
539	600299	安迪苏	3,600	28,260.00	0.01
540	300342	天银机电	600	28,200.00	0.01
541	002479	富春环保	6,400	26,944.00	0.01
542	300953	震裕科技	200	26,740.00	0.01
543	600256	广汇能源	5,400	26,676.00	0.01
544	300236	上海新阳	200	26,300.00	0.01
545	600039	四川路桥	3,340	26,118.80	0.01
546	002562	兄弟科技	6,000	26,100.00	0.01
547	600339	中油工程	8,300	25,481.00	0.01
548	600016	民生银行	7,700	24,794.00	0.01
549	688619	罗普特	1,500	24,345.00	0.01
550	002593	日上集团	6,100	24,339.00	0.01
551	600918	中泰证券	4,500	23,940.00	0.01
552	688472	阿特斯	2,200	23,804.00	0.01
553	301316	慧博云通	600	23,628.00	0.01
554	300867	圣元环保	1,300	23,556.00	0.01
555	688682	霍莱沃	600	23,340.00	0.01
556	688209	英集芯	800	23,264.00	0.01
557	605138	盛泰集团	4,100	22,632.00	0.01
558	300327	中颖电子	700	22,435.00	0.01
559	688225	亚信安全	1,800	22,356.00	0.01
560	301510	固高科技	700	22,351.00	0.01
561	002979	雷赛智能	400	22,312.00	0.01
562	300871	回盛生物	1,000	22,060.00	0.01
563	000011	深物业 A	3,400	22,032.00	0.01
564	600088	中视传媒	2,000	21,780.00	0.01
565	300872	天阳科技	1,364	21,551.20	0.01
566	002010	传化智联	4,800	21,456.00	0.01
567	688226	威腾电气	500	21,415.00	0.01
568	301219	腾远钴业	390	21,372.00	0.01
569	600535	天士力	1,600	21,168.00	0.01
570	000828	东莞控股	2,200	20,592.00	0.01
571	605055	迎丰股份	2,000	20,400.00	0.01
572	600259	中稀有金	200	20,322.00	0.01

573	300124	汇川技术	300	19,899.00	0.01
574	000900	现代投资	5,700	19,722.00	0.01
575	603897	长城科技	600	19,476.00	0.01
576	300390	天华新能	200	18,702.00	0.01
577	688577	浙海德曼	400	18,332.00	0.01
578	300826	测绘股份	1,300	18,200.00	0.01
579	688360	德马科技	1,000	17,900.00	0.01
580	002403	爱仕达	2,000	17,840.00	0.01
581	600153	建发股份	2,200	17,446.00	0.01
582	600496	精工钢构	5,600	17,360.00	0.01
583	002824	和胜股份	500	17,290.00	0.01
584	688182	灿勤科技	400	17,228.00	0.01
585	601949	中国出版	3,700	17,205.00	0.01
586	600386	北巴传媒	5,500	17,160.00	0.01
587	300201	海伦哲	800	16,856.00	0.01
588	600350	山东高速	1,500	16,695.00	0.01
589	001211	双枪科技	700	16,688.00	0.01
590	688717	艾罗能源	200	16,514.00	0.01
591	300840	酷特智能	800	16,504.00	0.01
592	600425	青松建化	5,000	16,350.00	0.01
593	301165	锐捷网络	200	16,090.00	0.01
594	688230	芯导科技	200	15,762.00	0.01
595	300151	昌红科技	600	14,970.00	0.00
596	002094	青岛金王	3,400	14,892.00	0.00
597	002577	雷柏科技	800	14,688.00	0.00
598	688385	复旦微电	200	14,258.00	0.00
599	601139	深圳燃气	2,400	13,584.00	0.00
600	000505	京粮控股	2,700	13,581.00	0.00
601	301160	翔楼新材	290	13,528.50	0.00
602	002923	润都股份	1,400	13,244.00	0.00
603	002177	御银股份	2,200	12,452.00	0.00
604	600025	华能水电	1,400	12,446.00	0.00
605	002134	天津普林	400	12,168.00	0.00
606	688036	传音控股	200	11,790.00	0.00
607	300509	新美星	1,400	11,732.00	0.00
608	605188	国光连锁	1,000	11,690.00	0.00
609	688345	博力威	200	11,616.00	0.00
610	300339	润和软件	300	11,553.00	0.00
611	301216	万凯新材	500	11,495.00	0.00
612	600640	国脉文化	1,100	10,637.00	0.00
613	603076	乐惠国际	500	10,360.00	0.00
614	601117	中国化学	1,400	10,290.00	0.00
615	300034	钢研高纳	600	10,284.00	0.00

616	002761	浙江建投	1,300	8,619.00	0.00
617	603130	云中马	200	8,350.00	0.00
618	600884	杉杉股份	600	8,130.00	0.00
619	688337	普源精电	100	7,493.00	0.00
620	600298	安琪酵母	200	7,240.00	0.00
621	600057	厦门象屿	1,100	5,962.00	0.00
622	601116	三江购物	600	5,922.00	0.00
623	603066	音飞储存	600	5,856.00	0.00
624	601368	绿城水务	1,400	5,726.00	0.00
625	603587	地素时尚	500	5,555.00	0.00
626	600827	百联股份	700	5,187.00	0.00
627	601918	新集能源	600	5,154.00	0.00
628	002745	木林森	400	5,020.00	0.00
629	002128	电投能源	200	4,624.00	0.00
630	002737	葵花药业	400	4,484.00	0.00
631	601068	中铝国际	1,000	4,320.00	0.00
632	002564	天沃科技	900	3,870.00	0.00
633	600859	王府井	400	3,672.00	0.00
634	301041	金百泽	100	3,375.00	0.00
635	002685	华东重机	500	3,230.00	0.00
636	600927	永安期货	200	2,490.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300750	宁德时代	9,863,118.00	1.37
2	300308	中际旭创	7,700,994.00	1.07
3	300483	首华燃气	5,996,710.00	0.83
4	688183	生益电子	5,489,806.83	0.76
5	688110	东芯股份	5,309,033.58	0.74
6	300475	香农芯创	5,288,124.00	0.74
7	300394	天孚通信	4,976,852.80	0.69
8	300476	胜宏科技	4,968,397.00	0.69
9	600887	伊利股份	4,967,388.00	0.69
10	300223	北京君正	4,685,064.00	0.65

11	601658	邮储银行	4,518,006.00	0.63
12	300814	中富电路	4,452,963.00	0.62
13	300191	潜能恒信	4,292,299.00	0.60
14	688256	寒武纪	4,260,819.57	0.59
15	601398	工商银行	4,228,558.00	0.59
16	300620	光库科技	4,214,192.00	0.59
17	300136	信维通信	4,110,915.00	0.57
18	300283	温州宏丰	4,008,797.50	0.56
19	601857	中国石油	3,959,587.00	0.55
20	300189	神农种业	3,871,712.00	0.54

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	300750	宁德时代	28,122,256.80	3.91
2	300308	中际旭创	15,211,332.00	2.12
3	300394	天孚通信	10,676,999.80	1.48
4	300502	新易盛	9,737,818.77	1.35
5	300604	长川科技	8,270,829.06	1.15
6	300274	阳光电源	8,114,044.44	1.13
7	688041	海光信息	6,797,423.29	0.95
8	300476	胜宏科技	6,738,049.00	0.94
9	688336	三生国健	6,655,517.49	0.93
10	600188	兖矿能源	6,531,121.50	0.91
11	688256	寒武纪	6,529,395.66	0.91
12	300433	蓝思科技	6,420,701.00	0.89
13	300483	首华燃气	5,748,827.70	0.80
14	688347	华虹宏力	5,742,472.35	0.80
15	300438	鹏辉能源	5,653,836.00	0.79
16	300127	银河磁体	5,591,863.00	0.78
17	688981	中芯国际	5,564,472.57	0.77
18	688183	生益电子	5,430,092.31	0.76
19	601898	中煤能源	5,128,675.00	0.71
20	301150	中一科技	4,847,640.20	0.67

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	1,212,250,002.49
卖出股票收入（成交）总额	1,576,964,624.40

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	484,332.00
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	713,565.27
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,197,897.27

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
国泰海通中证全指指数增强 A	1,152	62,759.54	165,406.37	0.23%	72,133,588.68	99.77%
国泰海通中证全指指数增强 C	2,819	63,101.77	35,434,927.99	19.92%	142,448,974.96	80.08%
合计	3,971	63,002.49	35,600,334.36	14.23%	214,582,563.64	85.77%

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	国泰海通中证全指指数增强 A	773,071.08	1.0693%
	国泰海通中证全指指数增强 C	19,130.77	0.0108%
	合计	792,201.85	0.3166%

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	国泰海通中证全指指数增强 A	50~100
	国泰海通中证全指指数增强 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通中证全指指数增强 A	50~100
	国泰海通中证全指指数增强 C	0
	合计	50~100

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

	国泰海通中证全指指数 增强 A	国泰海通中证全指指数 增强 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 02 日）基金份额总额	214,398,443.07	495,826,654.14
本报告期期初基金份额总额	214,398,443.07	495,826,654.14
本报告期基金总申购份额	28,828,544.00	184,087,400.71
减：本报告期基金总赎回份额	170,927,992.02	502,030,151.90
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	72,298,995.05	177,883,902.95

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

本报告期内无托管人相关从业人员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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			比例			
国金证券股份有限公司	2	2,789,214,626.89	100.00%	379,050.55	100.00%	-
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2026-01-05
2	国泰海通中证全指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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
8	国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
9	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
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	证监会指定网站、公司官网	2026-04-30

11	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
12	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
13	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金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海通中证全指指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通中证全指指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通中证全指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