国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2025 年 08 月 28 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。

根据国泰海通证券股份有限公司发布的《关于基金托管人、基金服务机构的名称变更公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司法定名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。基于此，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定对本基金基金合同等法律文件的基金托管人信息进行修订，修订内容自 2025 年 4 月 3 日起生效。具体可查阅本基金管理人于 2025 年 4 月 4 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金基金托管人信息变更并修订基金合同等法律文件的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
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 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 12
6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16
7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40
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 40
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
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 49
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 49
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 50
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 50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50
7.11 投资组合报告附注 50
8 基金份额持有人信息 51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 期末上市基金前十名持有人 51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
8.4 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的情况 52
9 开放式基金份额变动 52
10 重大事件揭示 52
10.1 基金份额持有人大会决议 52
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 52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
10.8 其他重大事件 54
11 备查文件目录 55
11.1 备查文件目录 55
11.2 存放地点 55
11.3 查阅方式 55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 1000 增强策略 ETF
场内简称	中证 1000 增强 ETF
基金主代码	159679
交易代码	159679
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 2 月 9 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	94,489,156.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 2 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股及优化组合管理，在注重风险控制的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略 本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。在复制标的指数的基础上，综合运用超额收益模型、风险模型、成本模型选择具有较高投资价值的股票构建投资组合。本基金个股选择范围包括标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与标的指数成份股相关度高的股票等。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度上的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会，力求在有效跟踪标的指数的基础上获取超越标的指数的投资回报。 （1）超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值，定价过高的资产应当考虑回避。 其中，多因子量化系统基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、成长性因子、技术因子、流动性因子、分析师因子等多类对股票超额收益具有较强解释能力的因子进行构建。

	（2）风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括行业偏离度、风格偏离度、波动率等，力求将主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。 在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.50%。 （3）成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等预测本基金的交易成本，以减少交易对业绩造成的负影响。 本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		国泰基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昇	帅芳
	联系电话	021-31081600转	021-38031815
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	021-38917599-5
传真		021-31081800	021-38677819
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		200082	200041
法定代表人		周向勇	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	22,013,904.20
本期利润	16,777,726.30
加权平均基金份额本期利润	0.1256
本期加权平均净值利润率	12.64%
本期基金份额净值增长率	10.16%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2025 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	5,052,214.98
期末可供分配基金份额利润	0.0535
期末基金资产净值	99,541,370.98
期末基金份额净值	1.0535
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2025 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	5.35%

注：(1)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。

(2)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。

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

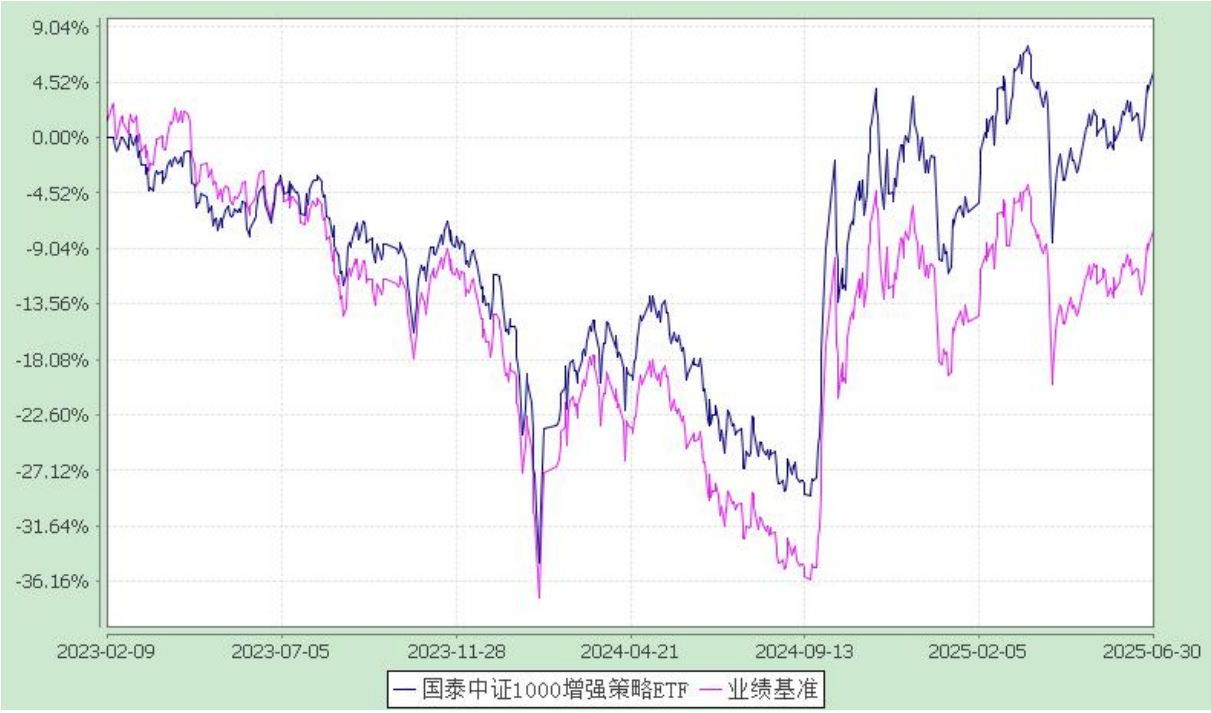
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.55%	0.91%	5.47%	0.94%	0.08%	-0.03%
过去三个月	2.72%	1.76%	2.08%	1.82%	0.64%	-0.06%
过去六个月	10.16%	1.59%	6.69%	1.64%	3.47%	-0.05%
过去一年	36.11%	1.89%	29.82%	1.97%	6.29%	-0.08%
自基金合同生效起至今	5.35%	1.60%	-7.58%	1.66%	12.93%	-0.06%

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

国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2023 年 2 月 9 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为 2023 年 2 月 9 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 280 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，

本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
吴中昊	国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、国泰沪深 300 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰中证 1000 增强策略 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证煤炭 ETF、国泰创业板指数（LOF）、国泰中证香港内地国有企业 ETF（QDII）、国泰中证机器人 ETF、国泰北证 50 成份指数发起、国泰富时中国国企开放共赢	2023-02-09	-	10 年	硕士研究生。曾任职于 Arrowstreet Capital（美国）。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 2 月起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 11 月起兼任国泰北证 50 成份指数型发起式证券投资

	ETF、国泰恒生 A 股电网设备 ETF 的基金经理				基金的基金经理，2024 年 12 月起兼任国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金和国泰恒生 A 股电网设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《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，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年 A 股开年急跌后缓步窄幅震荡上涨。一季度，A 股仍然呈现结构化行情的特征。从行业产业上看，春节期间，DeepSeek 的横空出世，打破了美国在大模型的科技垄断地位，也打开了 AI 产业的想象空间。同时，宇树机器人等科技成果的涌现，也打开了科技行业的估值空间。节后，科技成长板块大幅上涨，民营企业家座谈会，互联网巨头对其资本开支的展望也增加了投资人的信心，科技板块的整体热度持续到三月上旬。从风格上看，小盘、成长占了绝对的优势。

二季度全球政治局势，经济环境复杂多变：特朗普政府在 4 月初突然宣布对几乎所有国家的商品征收 10%的基准关税。4 月底印巴冲突持续升级，5 月 7 日巴基斯坦宣布击落印度 6 架战机。6 月 13 日以色列对伊朗多地发动大规模空袭，轰炸伊朗核设施和军事目标。全球资产收益率的不确定性大幅抬升。而 A 股在四月 7 日的探底后呈现了稳健上涨，同时其波动率显著低于其他主流市场，这背后体现了国家稳定金融市场的一系列措施以及决心。

整体看，2025 年上半年，上证指数上涨 2.76%。大盘，中盘，小盘的代表性指数沪深 300，中证 500 和中证 1000 分别涨跌幅为 0.03%，3.31%，6.69%。风格上，A 股整体呈现小盘行情。行业上，有色、银行、军工涨幅较好，TMT 相关的传媒、通信，以及制造业相关的机械、汽车也表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 10.16%，同期业绩比较基准收益率为 6.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 924 以来，金融市场受到自上而下的关注越来越多，稳定市场的实质性政策措施也更加多样。如何在有托底的市场跑出相对市场的超额，这可能是未来基金管理人面临的问题。展望未来，科技类投资可能是下半年的主线，叠加国际局势的影响，军工，AI，自主可控等主题有望继续抬升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

无。

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，国泰海通证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金产品（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配.

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、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,193,633.14	2,487,718.96
结算备付金		1,304,797.19	229,189.57
存出保证金		713,426.30	156,489.33
交易性金融资产	6.4.7.2	94,679,510.55	177,795,138.61
其中：股票投资		94,679,510.55	177,795,138.61
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		8,865.79	6,051,546.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		99,900,232.97	186,720,082.99
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	7,639,921.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		83,719.04	165,386.62
应付托管费		8,371.93	16,538.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	266,771.02	182,456.58
负债合计		358,861.99	8,004,303.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	94,489,156.00	186,889,156.00

未分配利润	6.4.7.8	5,052,214.98	-8,173,376.04
净资产合计		99,541,370.98	178,715,779.96
负债和净资产总计		99,900,232.97	186,720,082.99

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0535 元，基金份额总额 94,489,156.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		17,581,002.32	-35,277,860.96
1.利息收入		12,152.14	47,401.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,152.14	24,137.55
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		-	23,263.98
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,624,924.07	-17,447,783.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,832,167.13	-20,700,500.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	4,081.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-109.75	-
股利收益	6.4.7.13	792,866.69	3,248,635.34
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-5,236,177.90	-17,916,180.70
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	180,104.01	38,702.06
减：二、营业总支出		803,276.02	1,626,181.93
1．管理人报酬		663,531.01	1,401,420.40
2．托管费		66,353.13	140,142.06
3．销售服务费		-	-
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		-	84.11

8．其他费用	6.4.7.16	73,391.88	84,535.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**16,777,726.30**	**-36,904,042.89**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**16,777,726.30**	**-36,904,042.89**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,777,726.30	-36,904,042.89

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	186,889,156.00	-8,173,376.04	178,715,779.96
二、本期期初净资产	186,889,156.00	-8,173,376.04	178,715,779.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-92,400,000.00	13,225,591.02	-79,174,408.98
（一）、综合收益总额	-	16,777,726.30	16,777,726.30
（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）	-92,400,000.00	-3,552,135.28	-95,952,135.28
其中：1.基金申购款	19,600,000.00	-638,518.34	18,961,481.66
2.基金赎回款	-112,000,000.00	-2,913,616.94	-114,913,616.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	94,489,156.00	5,052,214.98	99,541,370.98

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	366,089,156.00	-41,004,483.34	325,084,672.66
二、本期期初净资产	366,089,156.00	-41,004,483.34	325,084,672.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44,800,000.00	-31,596,291.04	-76,396,291.04
（一）、综合收益总额	-	-36,904,042.89	-36,904,042.89
（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）	-44,800,000.00	5,307,751.85	-39,492,248.15
其中：1.基金申购款	53,200,000.00	-12,722,267.06	40,477,732.94
2.基金赎回款	-98,000,000.00	18,030,018.91	-79,969,981.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	321,289,156.00	-72,600,774.38	248,688,381.62

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：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：倪蓥，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2602 号《关于准予国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开

募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,458,066,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0069 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,458,089,156.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 23,156.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)自律监管决定书深证上[2023]89 号文核准，本基金于 2023 年 2 月 22 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2025 年 8 月 28 日批准报出。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年半年度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。

6.4.5 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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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》、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》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；对国债、地方政府债利息收入以及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。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，股权的股息、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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,193,633.14
等于：本金	3,192,783.96
加：应计利息	849.18
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	3,193,633.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		86,765,064.96	-	94,679,510.55	7,914,445.59
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		86,765,064.96	-	94,679,510.55	7,914,445.59

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 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	4,629,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,629,520.00	-	-	-

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
IM2512	IM2512	4.00	4,783,840.00	154,320.00
合计	-	-	-	154,320.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	154,320.00
净额	-	-	-	-

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 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	16,045.36
其中：交易所市场	16,045.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88
应付替代款	177,333.78
合计	266,771.02

注：应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	186,889,156.00	186,889,156.00
本期申购	19,600,000.00	19,600,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-112,000,000.00	-112,000,000.00
本期末	94,489,156.00	94,489,156.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

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	-5,451,092.44	-2,722,283.60	-8,173,376.04
本期期初	-5,451,092.44	-2,722,283.60	-8,173,376.04
本期利润	22,013,904.20	-5,236,177.90	16,777,726.30
本期基金份额交易产生的变动数	-3,153,742.80	-398,392.48	-3,552,135.28
其中：基金申购款	1,337,918.30	-1,976,436.64	-638,518.34
基金赎回款	-4,491,661.10	1,578,044.16	-2,913,616.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,409,068.96	-8,356,853.98	5,052,214.98

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,124.23
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	727.49
其他	300.42
合计	12,152.14

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,170,925.43
股票投资收益——赎回差价收入	8,661,241.70
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	21,832,167.13

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	92,379,571.21
减：卖出股票成本总额	79,126,051.78
减：交易费用	82,594.00
买卖股票差价收入	13,170,925.43

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	114,913,616.94
减：现金支付赎回款总额	49,283,923.94
减：赎回股票成本总额	56,968,451.30
减：交易费用	-
赎回差价收入	8,661,241.70

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日

买卖股指期货差价收入	-109.75

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	792,866.69
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	792,866.69

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	-5,390,497.90
——股票投资	-5,390,497.90
——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	154,320.00
——权证投资	-
——股指期货	154,320.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,236,177.90

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	180,104.01
合计	180,104.01

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实

际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	73,391.88

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，根据海通证券股份有限公司与国泰君安证券股份有限公司联合发布的《关于基金托管人、基金服务机构的变更公告》，自 2025 年 3 月 14 日起，本基金托管服务将由国泰君安继续履行。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金基金托管人信息变更的公告》。

根据国泰海通证券股份有限公司发布的《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自 2025 年 4 月 3 日起，本基金基金托管人中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。根据上述变更，基金管理人及基金托管人对《基金合同》《托管协议》等法律文件进行了相应修订，修订后的法律文件自 2025 年 4 月 3 日起生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金基金托管人信息变更并修改基金合同等法律文件的公告》。

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

国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商
国泰基金管理有限公司	基金管理人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6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	139,981,456.06	100.00%	560,118,828.53	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期间及上年度可比期间均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	-	-	198,393.90	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	27,425.68	100.00%	16,045.36	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6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	335,019.32	100.00%	165,636.55	100.00%

注：1.上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费等手续费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2.2024年7月1日前，该类佣金协议的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。自2024年7月1日起，券商不再为本基金提供除交易单元租用以外服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	663,531.01	1,401,420.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	51,287.10	79,695.89
应支付基金管理人的净管理费	612,243.91	1,321,724.51

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	66,353.13	140,142.06

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均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

本基金本报告期间及上年度可比期间均未有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。

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

本基金本报告期间及上年度可比期间均未有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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末均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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6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	3,193,633.14	11,124.23	1,267,708.98	16,770.98

注：本基金的银行活期存款由基金托管人国泰海通证券保管，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

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2025年6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
688841	海博思创	2025-01-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.38	83.49	306.00	5,930.28	25,547.94	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.40	34.11	526.00	5,470.40	17,941.86	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.70	24.80	636.00	4,261.20	15,772.80	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.08	25.94	528.00	4,794.24	13,696.32	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.68	26.95	497.00	5,804.96	13,394.15	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.46	79.68	150.00	5,019.00	11,952.00	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.80	33.85	342.00	4,035.60	11,576.70	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.30	54.45	148.00	1,820.40	8,058.60	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月以上	新股锁定	27.50	56.19	141.00	3,877.50	7,922.79	-

				流通受限						
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.60	82.50	91.00	2,420.60	7,507.50	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	28.33	44.98	147.00	4,164.51	6,612.06	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.30	14.44	434.00	2,300.20	6,266.96	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月以上	新股锁定流通受限	41.90	77.87	80.00	3,352.00	6,229.60	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.27	22.39	267.00	2,742.09	5,978.13	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	7.40	20.21	295.00	2,183.00	5,961.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.92	45.22	83.00	3,313.36	3,753.26	-
688583	思看科技	2025-06-19	1-6 个月（含）	送股	-	79.68	45.00	-	3,585.60	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.05	29.10	118.00	2,011.90	3,433.80	-

301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月以上	新股锁定流通受限	16.50	27.45	119.00	1,963.50	3,266.55	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.06	47.46	63.00	2,082.78	2,989.98	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6 个月（含）	送股	-	77.87	32.00	-	2,491.84	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	24.18	33.32	63.00	1,523.34	2,099.16	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6 个月（含）	送股	-	45.22	37.00	-	1,673.14	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.08	18.12	91.00	1,099.28	1,648.92	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。此外，证券投资基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

						价				
000627	*ST 天茂	2025-05-06	重大事项停牌	2.74	2025-07-08	2.60	58,100.00	177,967.09	159,194.00	-

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在消除所公布事项的重大影响后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的风险控制目标是在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股及优化组合管理，在注重风险控制的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人国泰海通证券开立于具有基金托管资格的银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

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来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2025 年 06 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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%。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 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	3,193,633.14	-	-	-	3,193,633.14
结算备付金	1,304,797.19	-	-	-	1,304,797.19
存出保证金	713,426.30	-	-	-	713,426.30
交易性金融资产	-	-	-	94,679,510.55	94,679,510.55
应收清算款	-	-	-	8,865.79	8,865.79
资产总计	5,211,856.63	-	-	94,688,376.34	99,900,232.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	83,719.04	83,719.04
应付托管费	-	-	-	8,371.93	8,371.93

其他负债	-	-	-	266,771.02	266,771.02
负债总计	-	-	-	358,861.99	358,861.99
利率敏感度缺口	5,211,856.63	-	-	94,329,514.35	99,541,370.98
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,487,718.96	-	-	-	2,487,718.96
结算备付金	229,189.57	-	-	-	229,189.57
存出保证金	156,489.33	-	-	-	156,489.33
交易性金融资产	-	-	-	177,795,138.61	177,795,138.61
应收清算款	-	-	-	6,051,546.52	6,051,546.52
资产总计	2,873,397.86	-	-	183,846,685.13	186,720,082.99
负债					
应付清算款	-	-	-	7,639,921.16	7,639,921.16
应付管理人报酬	-	-	-	165,386.62	165,386.62
应付托管费	-	-	-	16,538.67	16,538.67
其他负债	-	-	-	182,456.58	182,456.58
负债总计	-	-	-	8,004,303.03	8,004,303.03
利率敏感度缺口	2,873,397.86	-	-	175,842,382.10	178,715,779.96

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孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	94,679,510.55	95.12	177,795,138.61	99.48
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	94,679,510.55	95.12	177,795,138.61	99.48

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 4,744,151.42	增加约 8,622,568.51

	业绩比较基准下降 5%	减少约 4,744,151.42	减少约 8,622,568.51

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	94,307,669.97	176,410,742.60
第二层次	159,194.00	1,030,263.10
第三层次	212,646.58	354,132.91
合计	94,679,510.55	177,795,138.61

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 18,961,481.66 元（于 2024 上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 40,477,732.94 元），其中包括以股票支付的申购款 10,017,510.84 元和以现金支付的申购款 8,943,970.82 元（2024 年度：其中包括以股票支付的申购款 20,518,764.00 元和以现金支付的申购款 19,958,968.94 元）。

(2) 除基金申购款外，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	94,679,510.55	94.77
	其中：股票	94,679,510.55	94.77
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	4,498,430.33	4.50
8	其他各项资产	722,292.09	0.72
9	合计	99,900,232.97	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	178,292.00	0.18
B	采矿业	1,169,781.00	1.18
C	制造业	57,035,652.50	57.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,100,824.00	1.11
E	建筑业	573,333.00	0.58
F	批发和零售业	1,578,119.00	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	1,610,166.00	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,053,251.00	13.11
J	金融业	1,954,217.00	1.96
K	房地产业	2,038,609.00	2.05
L	租赁和商务服务业	830,330.60	0.83
M	科学研究和技术服务业	1,156,328.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	524,686.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	629,220.00	0.63
R	文化、体育和娱乐业	677,634.00	0.68
S	综合	-	-
	合计	84,110,443.10	84.50

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	384,930.00	0.39

C	制造业	7,471,203.43	7.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	458,160.00	0.46
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	227,360.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	842,231.00	0.85
J	金融业	159,194.00	0.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	199,467.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	375,770.02	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	448,508.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	10,569,067.45	10.62

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300738	奥飞数据	42,500	889,525.00	0.89
2	300229	拓尔思	42,400	781,856.00	0.79
3	300083	创世纪	92,800	762,816.00	0.77
4	600100	同方股份	104,100	753,684.00	0.76
5	300779	惠城环保	4,200	749,658.00	0.75
6	300593	新雷能	53,400	715,560.00	0.72
7	000969	安泰科技	55,500	714,840.00	0.72
8	688266	泽璟制药	6,600	709,566.00	0.71
9	600490	鹏欣资源	157,500	691,425.00	0.69
10	002681	奋达科技	96,100	650,597.00	0.65
11	600602	云赛智联	31,900	643,423.00	0.65

12	603005	晶方科技	22,100	627,419.00	0.63
13	002020	京新药业	47,900	625,095.00	0.63
14	300687	赛意信息	22,500	625,050.00	0.63
15	688019	安集科技	4,090	620,862.00	0.62
16	002139	拓邦股份	44,700	617,307.00	0.62
17	688779	五矿新能	113,119	615,367.36	0.62
18	603267	鸿远电子	12,100	608,267.00	0.61
19	002249	大洋电机	91,300	600,754.00	0.60
20	002063	远光软件	100,620	598,689.00	0.60
21	688306	均普智能	60,800	598,272.00	0.60
22	002456	欧菲光	50,300	596,055.00	0.60
23	300770	新媒股份	14,900	595,851.00	0.60
24	002174	游族网络	49,000	594,370.00	0.60
25	300451	创业慧康	101,900	575,735.00	0.58
26	002421	达实智能	171,000	574,560.00	0.58
27	300253	卫宁健康	53,600	568,160.00	0.57
28	600330	天通股份	78,000	559,260.00	0.56
29	600645	中源协和	24,000	556,800.00	0.56
30	301291	明阳电气	13,500	555,525.00	0.56
31	300568	星源材质	43,200	547,776.00	0.55
32	688116	天奈科技	11,900	544,663.00	0.55
33	603766	隆鑫通用	41,400	528,264.00	0.53
34	000915	华特达因	14,901	526,750.35	0.53
35	000813	德展健康	162,600	523,572.00	0.53
36	002222	福晶科技	14,880	508,896.00	0.51
37	300416	苏试试验	35,400	507,282.00	0.51
38	002171	楚江新材	50,700	493,311.00	0.50
39	300185	通裕重工	170,100	486,486.00	0.49
40	300088	长信科技	81,300	484,548.00	0.49
41	601777	千里科技	56,700	481,383.00	0.48
42	000902	新洋丰	34,800	481,284.00	0.48
43	603328	依顿电子	48,900	479,709.00	0.48
44	300182	捷成股份	87,000	479,370.00	0.48
45	600266	城建发展	104,500	474,430.00	0.48
46	600882	妙可蓝多	14,900	454,897.00	0.46
47	603583	捷昌驱动	12,100	441,892.00	0.44
48	002815	崇达技术	39,000	441,870.00	0.44
49	002745	木林森	54,700	431,036.00	0.43
50	600718	东软集团	44,200	430,950.00	0.43
51	688536	思瑞浦	3,100	430,032.00	0.43
52	002219	新里程	193,900	426,580.00	0.43
53	600531	豫光金铅	54,500	421,830.00	0.42
54	001339	智微智能	8,700	420,471.00	0.42
55	300725	药石科技	10,700	414,090.00	0.42

56	000029	深深房 A	22,000	414,040.00	0.42
57	002947	恒铭达	12,200	404,918.00	0.41
58	002434	万里扬	54,700	400,951.00	0.40
59	600216	浙江医药	26,600	393,414.00	0.40
60	603678	火炬电子	10,300	391,709.00	0.39
61	300393	中来股份	67,900	391,104.00	0.39
62	002183	怡 亚 通	84,700	390,467.00	0.39
63	300432	富临精工	29,860	390,270.20	0.39
64	300303	聚飞光电	61,400	389,276.00	0.39
65	301061	匠心家居	5,000	387,700.00	0.39
66	688696	极米科技	3,349	382,991.64	0.38
67	600163	中闽能源	74,700	382,464.00	0.38
68	600997	开滦股份	64,700	381,083.00	0.38
69	301050	雷电微力	7,100	378,430.00	0.38
70	300455	航天智装	26,100	375,840.00	0.38
71	600020	中原高速	76,500	365,670.00	0.37
72	002243	力合科创	44,700	364,752.00	0.37
73	002705	新宝股份	24,800	364,560.00	0.37
74	002245	蔚蓝锂芯	27,400	351,542.00	0.35
75	300463	迈克生物	29,500	351,050.00	0.35
76	002516	旷达科技	67,958	349,983.70	0.35
77	600338	西藏珠峰	31,500	349,335.00	0.35
78	603308	应流股份	14,900	343,892.00	0.35
79	002913	奥士康	11,600	341,156.00	0.34
80	688185	康希诺	5,700	339,891.00	0.34
81	300181	佐力药业	19,600	339,668.00	0.34
82	002847	盐津铺子	4,200	337,680.00	0.34
83	300762	上海瀚讯	14,900	337,187.00	0.34
84	688018	乐鑫科技	2,300	336,030.00	0.34
85	002399	海普瑞	28,100	334,671.00	0.34
86	300618	寒锐钴业	9,300	332,196.00	0.33
87	601375	中原证券	79,700	331,552.00	0.33
88	600750	江中药业	14,900	325,267.00	0.33
89	002145	中核钛白	78,000	323,700.00	0.33
90	002498	汉缆股份	95,000	321,100.00	0.32
91	603197	保隆科技	8,200	320,374.00	0.32
92	688128	中国电研	13,000	318,500.00	0.32
93	000620	盈新发展	195,900	317,358.00	0.32
94	002777	久远银海	17,100	312,246.00	0.31
95	600320	振华重工	71,400	312,018.00	0.31
96	688515	裕太微	3,400	311,440.00	0.31
97	002675	东诚药业	21,500	309,385.00	0.31
98	600596	新安股份	38,000	307,800.00	0.31
99	603368	柳药集团	18,200	307,762.00	0.31

100	002807	江阴银行	64,720	307,420.00	0.31
101	601369	陕鼓动力	34,700	304,319.00	0.31
102	300319	麦捷科技	28,100	301,794.00	0.30
103	600388	龙净环保	24,800	297,600.00	0.30
104	300850	新强联	8,300	297,306.00	0.30
105	300953	震裕科技	2,900	293,915.00	0.30
106	300598	诚迈科技	6,900	293,595.00	0.29
107	601827	三峰环境	34,800	292,320.00	0.29
108	300232	洲明科技	40,200	291,048.00	0.29
109	002497	雅化集团	25,400	289,560.00	0.29
110	300666	江丰电子	3,900	288,990.00	0.29
111	002948	青岛银行	58,000	288,840.00	0.29
112	300075	数字政通	16,100	286,902.00	0.29
113	688088	虹软科技	5,900	284,675.00	0.29
114	002215	诺 普 信	27,000	278,910.00	0.28
115	600285	羚锐制药	12,300	278,841.00	0.28
116	000875	吉电股份	55,000	278,300.00	0.28
117	688596	正帆科技	8,200	278,144.00	0.28
118	688048	长光华芯	4,800	277,152.00	0.28
119	002697	红旗连锁	51,500	275,525.00	0.28
120	600866	星湖科技	39,300	271,563.00	0.27
121	688523	航天环宇	12,600	271,026.00	0.27
122	002324	普利特	25,400	270,002.00	0.27
123	002906	华阳集团	8,200	266,582.00	0.27
124	688166	博瑞医药	4,900	263,179.00	0.26
125	601890	亚星锚链	25,600	260,864.00	0.26
126	300525	博思软件	17,700	257,712.00	0.26
127	601126	四方股份	15,500	252,185.00	0.25
128	603027	千禾味业	21,500	249,615.00	0.25
129	601107	四川成渝	41,400	249,228.00	0.25
130	002985	北摩高科	8,200	248,050.00	0.25
131	600835	上海机电	11,600	246,500.00	0.25
132	002701	奥瑞金	41,400	246,330.00	0.25
133	300166	东方国信	22,500	245,250.00	0.25
134	603297	永新光学	2,800	244,580.00	0.25
135	300170	汉得信息	14,200	244,382.00	0.25
136	300726	宏达电子	6,800	243,100.00	0.24
137	002276	万马股份	16,800	242,592.00	0.24
138	002212	天融信	31,500	242,550.00	0.24
139	002832	比音勒芬	14,856	238,438.80	0.24
140	603997	继峰股份	18,200	237,328.00	0.24
141	688789	宏华数科	3,236	236,357.44	0.24
142	600057	厦门象屿	33,600	236,208.00	0.24
143	688372	伟测科技	3,890	234,956.00	0.24

144	002747	埃斯顿	11,600	234,784.00	0.24
145	000503	国新健康	22,200	234,654.00	0.24
146	600073	光明肉业	31,500	232,470.00	0.23
147	600475	华光环能	22,300	232,366.00	0.23
148	301511	德福科技	11,200	231,840.00	0.23
149	002405	四维图新	27,100	231,434.00	0.23
150	603305	旭升集团	17,700	230,985.00	0.23
151	603306	华懋科技	5,300	230,550.00	0.23
152	600556	天下秀	45,000	229,500.00	0.23
153	688556	高测股份	31,894	228,998.92	0.23
154	600123	兰花科创	35,000	228,200.00	0.23
155	000737	北方铜业	21,000	228,060.00	0.23
156	002326	永太科技	17,700	227,799.00	0.23
157	603612	索通发展	12,300	226,074.00	0.23
158	001311	多利科技	10,917	225,654.39	0.23
159	000059	华锦股份	41,800	225,302.00	0.23
160	300113	顺网科技	11,400	225,264.00	0.23
161	000767	晋控电力	78,500	224,510.00	0.23
162	301238	瑞泰新材	11,600	222,952.00	0.22
163	002378	章源钨业	28,100	222,271.00	0.22
164	002979	雷赛智能	5,000	221,400.00	0.22
165	000837	秦川机床	18,300	219,966.00	0.22
166	300036	超图软件	14,400	219,744.00	0.22
167	600063	皖维高新	47,700	218,466.00	0.22
168	600864	哈投股份	36,500	217,905.00	0.22
169	002396	星网锐捷	9,700	217,765.00	0.22
170	000049	德赛电池	9,550	217,358.00	0.22
171	300655	晶瑞电材	21,700	217,217.00	0.22
172	002716	湖南白银	55,600	216,840.00	0.22
173	603915	国茂股份	14,900	216,646.00	0.22
174	300257	开山股份	21,500	216,505.00	0.22
175	000966	长源电力	47,900	215,550.00	0.22
176	600064	南京高科	27,800	214,338.00	0.22
177	002126	银轮股份	8,800	213,664.00	0.21
178	002004	华邦健康	51,200	213,504.00	0.21
179	688690	纳微科技	9,300	212,319.00	0.21
180	601860	紫金银行	70,600	211,800.00	0.21
181	300401	花园生物	13,900	211,419.00	0.21
182	000828	东莞控股	19,700	210,593.00	0.21
183	601515	东峰集团	55,000	210,100.00	0.21
184	300080	易成新能	50,200	209,836.00	0.21
185	600572	康恩贝	47,900	209,802.00	0.21
186	688639	华恒生物	6,600	209,220.00	0.21
187	002484	江海股份	10,200	208,998.00	0.21

188	601326	秦港股份	64,700	208,981.00	0.21
189	000811	冰轮环境	21,300	208,740.00	0.21
190	600869	远东股份	40,900	207,772.00	0.21
191	688549	中巨芯	26,800	207,432.00	0.21
192	300409	道氏技术	12,232	207,210.08	0.21
193	301031	中熔电气	2,600	207,090.00	0.21
194	600641	万业企业	14,900	206,812.00	0.21
195	300475	香农芯创	5,800	206,654.00	0.21
196	600649	城投控股	48,100	206,349.00	0.21
197	600761	安徽合力	11,600	205,784.00	0.21
198	000718	苏宁环球	94,600	205,282.00	0.21
199	601311	骆驼股份	22,700	204,981.00	0.21
200	000030	富奥股份	34,800	204,972.00	0.21
201	600151	航天机电	28,100	204,849.00	0.21
202	000712	锦龙股份	15,600	204,828.00	0.21
203	603636	南威软件	16,200	204,768.00	0.21
204	600961	株冶集团	18,300	204,594.00	0.21
205	603008	喜临门	11,700	204,516.00	0.21
206	002959	小熊电器	4,400	204,336.00	0.21
207	605168	三人行	6,920	203,655.60	0.20
208	002036	联创电子	18,800	203,228.00	0.20
209	000758	中色股份	40,400	203,212.00	0.20
210	000420	吉林化纤	52,100	203,190.00	0.20
211	002428	云南锗业	10,200	202,980.00	0.20
212	300244	迪安诊断	13,600	202,640.00	0.20
213	600058	五矿发展	26,200	202,526.00	0.20
214	600664	哈药股份	54,800	201,664.00	0.20
215	603013	亚普股份	11,600	200,448.00	0.20
216	300045	华力创通	10,500	200,445.00	0.20
217	300613	富瀚微	4,100	200,408.00	0.20
218	688327	云从科技	14,500	199,955.00	0.20
219	300134	大富科技	16,300	199,349.00	0.20
220	002544	普天科技	8,500	199,325.00	0.20
221	000829	天音控股	19,500	199,095.00	0.20
222	002978	安宁股份	6,300	198,954.00	0.20
223	600717	天津港	43,600	198,816.00	0.20
224	688141	杰华特	6,100	198,738.00	0.20
225	600667	太极实业	30,200	198,716.00	0.20
226	300133	华策影视	26,400	198,264.00	0.20
226	300972	万辰集团	1,100	198,264.00	0.20
228	603667	五洲新春	5,900	197,709.00	0.20
229	688343	云天励飞	4,000	197,680.00	0.20
230	300768	迪普科技	11,500	197,225.00	0.20
231	300776	帝尔激光	3,700	196,877.00	0.20

232	000567	海德股份	33,200	196,544.00	0.20
233	002354	天娱数科	30,900	196,215.00	0.20
234	688408	中信博	4,200	196,056.00	0.20
235	300151	昌红科技	15,900	195,729.00	0.20
236	000650	仁和药业	36,100	195,662.00	0.20
237	002292	奥飞娱乐	20,100	195,372.00	0.20
238	000681	视觉中国	9,700	195,358.00	0.20
239	000686	东北证券	25,600	195,328.00	0.20
240	002635	安洁科技	14,400	194,976.00	0.20
241	301090	华润材料	25,800	194,274.00	0.20
242	688333	铂力特	3,260	194,165.60	0.20
243	600420	国药现代	18,200	193,830.00	0.19
244	002351	漫步者	14,700	192,864.00	0.19
245	688409	富创精密	3,500	192,535.00	0.19
246	688347	华虹公司	3,500	192,185.00	0.19
247	605333	沪光股份	7,000	192,150.00	0.19
248	603919	金徽酒	10,600	191,860.00	0.19
249	603662	柯力传感	3,000	191,790.00	0.19
250	002176	江特电机	26,400	191,664.00	0.19
251	600618	氯碱化工	19,900	191,637.00	0.19
252	300415	伊之密	9,500	191,425.00	0.19
253	600169	太原重工	79,000	191,180.00	0.19
254	002668	TCL 智家	19,500	190,515.00	0.19
255	600179	安通控股	68,900	190,164.00	0.19
256	600971	恒源煤电	28,800	190,080.00	0.19
257	688139	海尔生物	6,100	188,429.00	0.19
258	002091	江苏国泰	25,900	188,293.00	0.19
259	600587	新华医疗	12,420	188,038.80	0.19
260	600248	陕建股份	49,300	187,833.00	0.19
261	600966	博汇纸业	42,400	187,408.00	0.19
262	002895	川恒股份	8,300	187,248.00	0.19
263	600133	东湖高新	20,800	186,784.00	0.19
264	600269	赣粤高速	36,900	186,714.00	0.19
265	603279	景津装备	12,500	186,625.00	0.19
266	301039	中集车辆	22,800	185,364.00	0.19
267	605296	神农集团	5,800	178,292.00	0.18
268	301458	钧崴电子	526	17,941.86	0.02
269	301602	超研股份	636	15,772.80	0.02
270	603072	天和磁材	148	8,058.60	0.01
271	001356	富岭股份	434	6,266.96	0.01

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	300627	华测导航	24,060	842,100.00	0.85
2	688608	恒玄科技	1,600	556,768.00	0.56
3	300369	绿盟科技	71,100	552,447.00	0.55
4	688235	百济神州	2,364	552,324.96	0.55
5	300737	科顺股份	113,700	548,034.00	0.55
6	002318	久立特材	23,200	542,648.00	0.55
7	300458	全志科技	13,600	539,784.00	0.54
8	600491	龙元建设	124,500	458,160.00	0.46
9	002446	盛路通信	59,000	435,420.00	0.44
10	300679	电连技术	8,700	394,806.00	0.40
11	002773	康弘药业	13,300	385,301.00	0.39
12	601001	晋控煤业	31,500	384,930.00	0.39
13	301080	百普赛斯	4,900	350,497.00	0.35
14	688707	振华新材	25,211	341,609.05	0.34
15	688066	航天宏图	14,800	289,784.00	0.29
16	688167	炬光科技	3,400	274,550.00	0.28
17	688598	金博股份	10,664	271,078.88	0.27
18	300346	南大光电	8,180	258,815.20	0.26
19	300623	捷捷微电	8,600	256,280.00	0.26
20	603466	风语筑	24,800	250,232.00	0.25
21	300973	立高食品	4,900	238,973.00	0.24
22	688582	芯动联科	3,400	228,480.00	0.23
23	605589	圣泉集团	8,200	227,550.00	0.23
24	001213	中铁特货	56,000	227,360.00	0.23
25	002461	珠江啤酒	20,000	225,800.00	0.23
26	002191	劲嘉股份	52,400	213,792.00	0.21
27	000415	渤海租赁	59,900	199,467.00	0.20
28	601921	浙版传媒	24,600	198,276.00	0.20
29	000627	天茂集团	58,100	159,194.00	0.16
30	688411	海博思创	306	25,547.94	0.03
31	688583	思看科技	195	15,537.60	0.02
32	688757	胜科纳米	528	13,696.32	0.01
33	688545	兴福电子	497	13,394.15	0.01
34	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
35	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
36	301479	弘景光电	112	8,721.44	0.01
37	301275	汉朔科技	141	7,922.79	0.01
38	301662	宏工科技	91	7,507.50	0.01
39	301173	毓恬冠佳	147	6,612.06	0.01
40	301665	泰禾股份	267	5,978.13	0.01
41	001382	新亚电缆	295	5,961.95	0.01

42	301501	恒鑫生活	120	5,426.40	0.01
43	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
44	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
45	301595	太力科技	118	3,433.80	0.00
46	301560	众捷汽车	119	3,266.55	0.00
47	301636	泽润新能	63	2,989.98	0.00
48	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
49	603409	汇通控股	63	2,099.16	0.00
50	001390	古麒绒材	91	1,648.92	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	300738	奥飞数据	839,309.00	0.47
2	300229	拓尔思	815,341.00	0.46
3	300083	创世纪	796,459.00	0.45
4	688608	恒玄科技	713,583.14	0.40
5	300779	惠城环保	710,559.00	0.40
6	600490	鹏欣资源	701,289.00	0.39
7	002681	奋达科技	657,431.00	0.37
8	600602	云赛智联	633,989.00	0.35
9	002174	游族网络	614,779.00	0.34
10	300687	赛意信息	593,519.00	0.33
11	603267	鸿远电子	584,202.00	0.33
12	688306	均普智能	580,896.27	0.33
13	688185	康希诺	552,215.99	0.31
14	301291	明阳电气	546,104.00	0.31
15	300182	捷成股份	540,147.00	0.30
16	000813	德展健康	537,265.00	0.30
17	300725	药石科技	534,198.00	0.30
18	300416	苏试试验	500,918.00	0.28
19	688116	天奈科技	496,885.98	0.28
20	300593	新雷能	478,731.00	0.27

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	600478	科力远	1,646,748.00	0.92
2	600562	国睿科技	1,523,479.00	0.85
3	603169	兰石重装	1,431,225.00	0.80
4	688206	概伦电子	1,355,656.79	0.76
5	600559	老白干酒	1,346,785.00	0.75
6	688235	百济神州	1,301,736.79	0.73
7	600688	上海石化	1,197,434.00	0.67
8	600623	华谊集团	1,075,381.00	0.60
9	600100	同方股份	1,067,720.00	0.60
10	600718	东软集团	1,064,111.00	0.60
11	300674	宇信科技	994,794.00	0.56
12	688190	云路股份	948,144.66	0.53
13	601777	千里科技	928,075.00	0.52
14	688048	长光华芯	917,716.04	0.51
15	603005	晶方科技	905,982.00	0.51
16	300451	创业慧康	843,706.00	0.47
17	300203	聚光科技	771,427.00	0.43
18	300398	飞凯材料	767,603.00	0.43
19	600557	康缘药业	742,788.00	0.42
20	300476	胜宏科技	739,801.00	0.41

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	48,351,862.08
卖出股票的收入（成交）总额	92,379,571.21

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广东创世纪智能装备集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.11.3 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	713,426.30
2	应收清算款	8,865.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	722,292.09

7.11.4 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可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 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。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

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
1,882	50,206.78	14,817,901.00	15.68%	79,671,255.00	84.32%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吕凡	2,550,058.00	2.70%
2	BARCLAYS BANK PLC	2,481,344.00	2.63%
3	中英人寿保险有限公司－传统保险产品	2,297,800.00	2.43%
4	北京柏基置业有限公司	2,000,058.00	2.12%
5	简街香港有限公司－JSQB 有限公司（R）	1,967,078.00	2.08%
6	南京彤天基金管理有限公司－彤天同盈 2 号私募证券投资基金	1,362,238.00	1.44%

7	中国国际金融股份有限公司	1,212,872.00	1.28%
8	邓军	1,190,000.00	1.26%
9	姚惠君	1,172,300.00	1.24%
10	涂玲	1,005,019.00	1.06%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

8.4 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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 2 月 9 日）基金份额总额	1,458,089,156.00
本报告期期初基金份额总额	186,889,156.00
本报告期基金总申购份额	19,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	112,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	94,489,156.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2025年5月30日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第三十六次会议审议通过，刘国华女士离任公司督察长，公司总经理李昇代任督察长。

报告期内，本基金托管人的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，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-05-09
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别机制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	4	139,981,456.06	100.00%	27,425.68	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：

（1）实力雄厚、信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；

（3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；

（4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金基金托管人信息变更的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2025-03-18
2	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金基金托管人信息变更并修改基金合同等法律文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2025-04-04
3	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2025-05-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、关于准予国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复

2、国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

11.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日