

国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 08 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月26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2025年04月17日起至2025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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....6

3.1 主要会计数据和财务指标.....6

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9

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明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10

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望12

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.....13

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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	56

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	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	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安上证科创板综合价格指数增强	
基金主代码	023889	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 04 月 17 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	299,136,752.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023889	023890
报告期末下属分级基金的份额总额	159,150,414.20 份	139,986,338.33 份

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。

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，在力求对上证科创板综合价格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	上证科创板综合价格指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

	本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	张姗
	联系电话	021-38676022	400-61-95555
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95521	400-61-95555
传真		021-38871190	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200011	518040
法定代表人		陶耿	缪建民

2.4 信息披露方式

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

§ 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 04 月 17 日（基金合同生效日）-2025 年 06 月 30 日）	
	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C
本期已实现收益	9,584,178.98	8,900,172.93
本期利润	15,513,968.65	13,728,942.23
加权平均基金份额本期利润	0.0513	0.0453
本期加权平均净值利润率	5.09%	4.49%

本期基金份额净值增长率	6.97%	6.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	6,405,447.80	5,510,750.57
期末可供分配基金份额利润	0.0402	0.0394
期末基金资产净值	170,243,826.07	149,616,961.91
期末基金份额净值	1.0697	1.0688
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	6.97%	6.88%

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）。

（4）本基金于 2025 年 04 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。

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

国泰君安上证科创板综合价格指数增强 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
过去一个月	7.43%	1.12%	5.18%	0.96%	2.25%	0.16%
自基金合同生 效起至今	6.97%	0.92%	5.85%	0.93%	1.12%	-0.01%

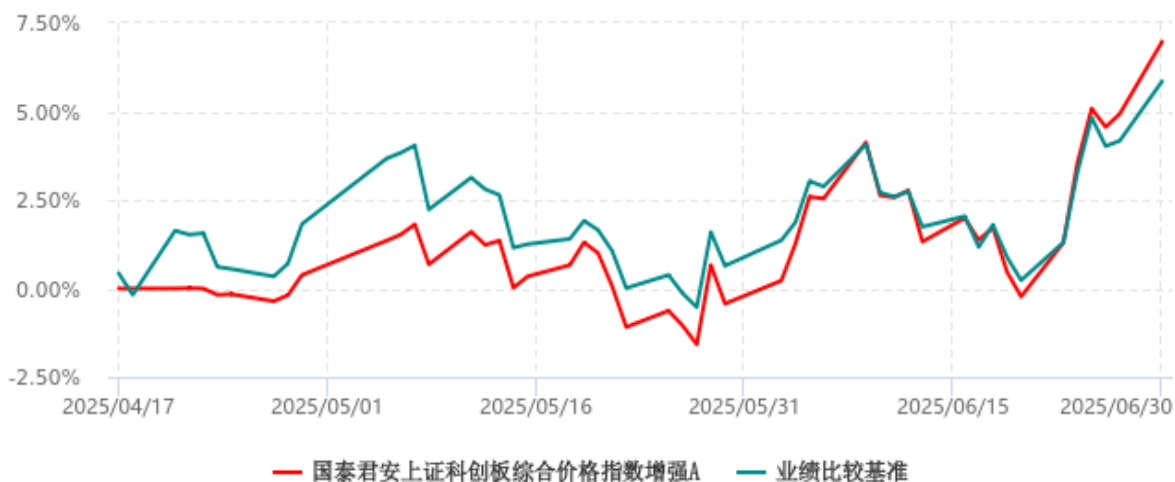
国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C 净值表现

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
过去一个月	7.40%	1.11%	5.18%	0.96%	2.22%	0.15%
自基金合同生 效起至今	6.88%	0.92%	5.85%	0.93%	1.03%	-0.01%

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

国泰君安上证科创板综合价格指数增强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04月17日-2025年06月30日)

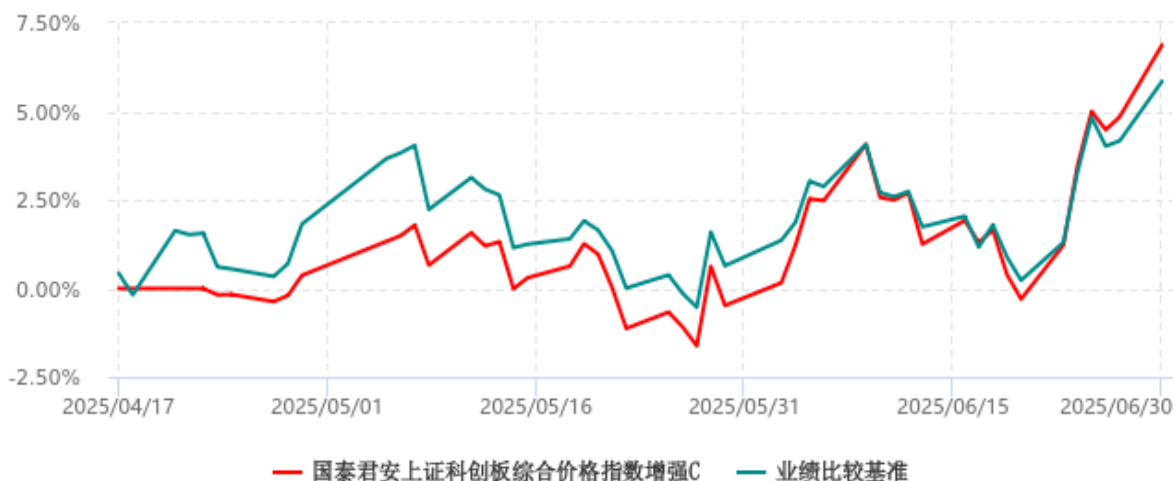


注：1、本基金于 2025 年 04 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰君安上证科创板综合价格指数增强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04月17日-2025年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 04 月 17 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，截止本报告期末基金成立未满六个月。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得利混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 61 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	国泰君安中证 500 指数增强基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强基金经理，国泰君安量化选股混合发起基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰君安稳债增利债券发起基金经理，国泰君安科创板量化选股股票发起基金经理，国泰君安红利量化选股混合基金经理，国泰君安中证 A500 指数增强基金经理，国泰君安	2025-04-17	-	14 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任本公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	上证科创板综合价格指数增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
--	--	--	--	--	--

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 1 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在市场方面，2025 年上半年 A 股市场呈现“政策驱动、情绪修复”主导的结构性行情。春节前市场情绪相对低迷，受特朗普关税政策预期及海外流动性收紧冲击，北向资金持续流出，指数超预期调整并伴随成交量萎靡。节后受 DeepSeek-v3、R1 发布影响，叠加春晚催化人形机器人主题投

资热潮，及“春季躁动”行情，科技板块领涨，推动市场情绪快速修复，并带动 H 股科技板块的资产重估，形成了 A、H 股联动上涨的格局。短期的科创过热致使 3 月后获利盘持续了结，市场再次下跌，进入缩量轮动阶段。4 月初，受美国“对等关税”政策冲击，全球资本市场动荡加剧，上证综指在 4 月 7 日单日大幅下挫 7.34%，市场风险偏好骤降。随后国内政策快速响应，人民日报发文强调增强应对关税冲击信心，中央汇金通过 ETF 市场维稳，叠加 4 月 18 日国务院常务会释放稳定股市信号，市场情绪逐步修复，指数开启估值驱动的快速反弹。进入 5 月，中美经贸高层会谈取得实质性进展，双方发布《日内瓦经贸会谈联合声明》暂停部分关税，叠加央行推出十项货币政策措施，市场风险偏好显著提升，上证综指单月上涨 2.09%。6 月 13 日，中东冲突引发全球资本市场普遍回调，投资者避险情绪提升，但随后中东协议停火，叠加制造业 PMI 回升及消费刺激政策等多重利好推动下，上证综指迎来快速修复，6 月末站上 3400 点创年内新高，上半年累计上涨 2.76%。上半年，科创 100 指数（涨幅 13.54%）和中证 1000 指数（涨幅 6.69%）表现出色，科创 50 指数（涨幅 1.46%）和创业板指（涨幅 0.53%）表现尚可，整体强于中证红利指数（跌幅 3.07%）和沪深 300 指数（涨幅 0.03%）。

从主要风险因子的走势来看，成长因子上半年表现强势。市值因子自年初以来持续走弱，但在 3 月底 4 月初出现小幅走高，随后持续走弱。从行业来看，各行业涨跌幅分化较大。有色金属是 2024 年四季度跌幅居前的行业，2025 年上半年在大宗商品、贵金属价格上涨的推动下重新走强。国防军工和银行板块上半年涨幅均超 10%；军工板块受政策、事件以及景气上行等因素影响表现强势，银行在政策呵护息差、高稳定属性的加持下取得了较好的涨幅。相较而言，受关税冲击或需求疲软影响，食品饮料板块在上半年则表现疲软；煤炭板块则因煤炭价格不断下跌，上半年跌幅达 12%。Alpha 表现方面，2025 上半年价量因子表现强势，整体上价量因子的表现优于基本面因子。过去一段时间内，受“对等关税”等政治事件影响，市场风险偏好急剧变化，维持超额收益稳定性的难度大幅提升，在短期内出现了较大波动。鉴于今年市场环境的复杂性，我们从中吸取经验，更加重视提升业绩稳定性，并根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

本基金是基于科创板综指的指数增强型基金，主要聚焦科创板的上市公司。科创板是典型的成长股代表，具有很强的业绩和股价的进攻性，代价是波动率也会适度加大，我们一方面将波动率视为 Alpha 的朋友，另一方面也建议投资者对于波动率较大的基金采取定投等方式来改善基金持有体验。在投资策略层面，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，争取以较为稳定的方式来增强科创板综合指数。从去年 924 行情以来，科创板的行情整体表现上乘，也带领着市场从过去两年多的价值行情迅速转向成长，虽然以科创板为主的科技相关指数从阶段性底部以来已经积累了较大涨幅，但是从中长期的角度依然具有较高的配置价值，原因有如下几点：1）、当前市场交投整体较为活跃，为成长股的投资奠定了

良好的资金面基础；2)、半导体设备、生物医药、新能源、高端装备等科创板主要覆盖的新兴产业，符合中国产业战略转型的方向；在“新质生产力”等产业红利和“科创板八条”等政策红利的双轮驱动下，硬科技属性持续强化，半导体设备、AI 算力、生物制造等领域的技术突破加速，为科技板块打开长期增长空间；3)、在中美科技博弈背景下，科技产业在自主可控的时代使命下发展壮大，俨然成为国内突破“卡脖子”技术的主力军，带领经济从“中国制造”到“中国创造”的产业升级；4)、以科创板为主的科技类相关公司的营收和利润增速显著高于 A 股整体表现，在半导体设备、AI 算力、创新药和智能汽车等赛道表现尤为亮眼，盈利增长动力强劲。本基金采取量化的方式开展科技创新型股票投资，其核心优势在于通过数据驱动的系统化框架，充分利用科技产业的高数据密度特性，通过系统化、纪律化的模型框架捕捉硬科技企业的成长特征，充分利用科技型股票高波动率的同时控制投资组合的整体风险，实现投资决策的标准化、实时化、纪律化和高效化，其底层投资框架采用管理人多年精心打造的量化投资体系，针对于科技类股票在子策略合成、多策略配置和投资组合管理等层面进行有针对性地改良。

展望下半年，随着中东冲突逐步缓和，及中美共振降息的流动性宽松格局延续，A 股估值修复动力增强。盈利方面，虽仍面临关税压力，但在抢出口效应下，短期 A 股基本面仍有韧性支撑；估值方面，在全球市场风险偏好回暖和美国经济软着陆的预期下，全年仍有降息预期。而在国内人民币升值背景下，宽货币空间进一步打开，流动性宽松局面有望延续，驱动 A 股估值端进一步走强。整体而言，指数短期或面临阶段性调整压力，但尚未达到盈利承压最强时候，因而每次调整都不剧烈，反而是流动性助推下，向上突破动力更强，指数持续有结构性做多机会。风险方面，仍需关注中美关税政策、地缘政治反复以及全球流动性收紧节奏，但监管层对资本市场改革的持续深化（如“国九条”落实）有望进一步稳定市场信心。

科技板块作为 A 股新质生产力的标杆，有望在 AI 模型持续突破和中美大国博弈的时间点上得到资金的青睐，我们努力追求突出科技创新属性的选股策略从中长期角度形成 Alpha 和 Beta 的双击。需要强调的是，量化投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者耐心持有，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益，而对于高波动率的板块也建议投资者可以通过定投的方式来进一步优化持有体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A 基金份额净值为 1.0697 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.97%，同期业绩比较基准收益率为 5.85%；截至报告期末国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C 基金份额净值为 1.0688 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.88%，同期业绩比较基准收益率为 5.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于科创板综指开展指数增强，科创板作为典型的成长股代表，其盈利增长与创新周期紧密相关，下半年国内宽货币环境为科技企业研发投入提供资金支持，叠加中美在部分领域的技术竞争加剧，自主可控领域的“卡脖子”技术突破将加速，推动板块盈利改善；科创板综合指数的高波动率可通过量化模型转化为 Alpha 收益，尽管短期市场情绪波动可能加大波动，但长期政策红利与技术迭代将支撑指数估值修复，本基金基于机器学习框架的多因子多策略体系追求稳定增强效果；行业方面，半导体设备板块受益于晶圆厂扩产与设备国产化率提升，AI 算力产业链（芯片、服务器、光模块）需求持续放量成为核心主线，新能源中的储能、氢能领域在政策补贴与技术降本推动下商业化进程加速，生物制造领域在合成生物学技术突破下应用场景持续拓展，高端装备中的机器人、航空航天板块受事件催化与订单增长驱动，景气度维持高位，但有也需警惕部分缺乏业绩支撑的主题炒作个股的回调风险。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	43,791,597.77
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	302,255,747.74
其中：股票投资		302,255,747.74
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		—
买入返售金融资产	6.4.7.3	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		1,391,451.83
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.4	—
资产总计		347,438,797.34
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		27,160,805.66
应付管理人报酬		264,560.54
应付托管费		49,605.09
应付销售服务费		61,561.17
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	6.4.7.5	41,476.90
负债合计		27,578,009.36
净资产：		
实收基金	6.4.7.6	299,136,752.53
未分配利润	6.4.7.7	20,724,035.45
净资产合计		319,860,787.98
负债和净资产总计		347,438,797.34

注：1、报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 299,136,752.53 份。其中国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A 基金份额净值 1.0697 元，基金份额总额 159,150,414.20 份；国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C 基金份额净值 1.0688 元，基金份额总额 139,986,338.33 份。

2、本基金于 2025 年 04 月 17 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		30,718,456.72
1. 利息收入		123,193.64
其中：存款利息收入	6.4.7.8	123,193.64
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		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,829,625.93
其中：股票投资收益	6.4.7.9	18,499,347.89

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		-
股利收益	6.4.7.10	1,330,278.04
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	10,758,558.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	7,078.18
减：二、营业总支出		1,475,545.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	997,181.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	186,971.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	249,989.85
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		-
8. 其他费用	6.4.7.13	41,402.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,242,910.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,242,910.88
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		29,242,910.88

注：本基金于 2025 年 04 月 17 日成立，无上年度同期可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	822,889,006.54	-	822,889,006.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-523,752,254.01	20,724,035.45	-503,028,218.56
（一）、综合收益总额	-	29,242,910.88	29,242,910.88
（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）	-523,752,254.01	-8,518,875.43	-532,271,129.44
其中：1. 基金申购款	30,427,879.75	548,786.32	30,976,666.07
2. 基金赎回款	-554,180,133.76	-9,067,661.75	-563,247,795.51
（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	299,136,752.53	20,724,035.45	319,860,787.98

注：本基金于 2025 年 04 月 17 日成立，无上年度同期可比数据。

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（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[2025]576 号《关于准予国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由上海国泰海通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基

金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 822,594,104.78 元，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 2500141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 4 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 822,889,006.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 294,901.76 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《国泰君安上证科创板综合价格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》和《国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于上证科创板综合价格指数成份股及其备选成份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：上证科创板综合价格指数收益率 $\times$ 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 2025 中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 04 月 17 日至 2025 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 04 月 17 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、基金投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

– 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（d）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置

日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准：

(1) 各类基金份额之间由于是否收取销售服务费的不同将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入基金份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

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 号文《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 06 月 30 日
活期存款	29,938,293.27
等于：本金	29,935,959.87
加：应计利息	2,333.40
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	13,853,304.50
等于：本金	13,853,041.16
加：应计利息	263.34
减：坏账准备	-
合计	43,791,597.77

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 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	291,497,188.77	-	302,255,747.74	10,758,558.97
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	291,497,188.77	-	302,255,747.74	10,758,558.97
----	----------------	---	----------------	---------------

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 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。

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	26,061.75
预提审计费	13,031.25
其他应付	2,383.90
合计	41,476.90

6.4.7.6 实收基金

国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	388,822,699.95	388,822,699.95
本期申购	6,425,465.95	6,425,465.95
本期赎回（以“-”号填列）	-236,097,751.70	-236,097,751.70

本期末	159,150,414.20	159,150,414.20
-----	----------------	----------------

国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	434,066,306.59	434,066,306.59
本期申购	24,002,413.80	24,002,413.80
本期赎回（以“-”号填列）	-318,082,382.06	-318,082,382.06
本期末	139,986,338.33	139,986,338.33

6.4.7.7 未分配利润

国泰君安上证科创板综合价格指数增强 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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,584,178.98	5,929,789.67	15,513,968.65
本期基金份额交易产生的变动数	-3,178,731.18	-1,241,825.60	-4,420,556.78
其中：基金申购款	127,534.17	-16,683.50	110,850.67
基金赎回款	-3,306,265.35	-1,225,142.10	-4,531,407.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,405,447.80	4,687,964.07	11,093,411.87

国泰君安上证科创板综合价格指数增强 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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	8,900,172.93	4,828,769.30	13,728,942.23
本期基金份额交易产生的变动数	-3,389,422.36	-708,896.29	-4,098,318.65
其中：基金申购款	451,495.13	-13,559.48	437,935.65
基金赎回款	-3,840,917.49	-695,336.81	-4,536,254.30

本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,510,750.57	4,119,873.01	9,630,623.58

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	104,710.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	18,483.44
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	123,193.64

6.4.7.9 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 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,211,968,690.31
减：卖出股票成本总额	1,192,498,276.66
减：交易费用	971,065.76
买卖股票差价收入	18,499,347.89

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,330,278.04
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	1,330,278.04

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	10,758,558.97
——股票投资	10,758,558.97

——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	-
——权证投资	-
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	10,758,558.97

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	7,078.18
合计	7,078.18

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	13,031.25
信息披露费	26,061.75
证券出借违约金	-
证券账户开户费	1,200.00
银行汇划费	1,109.58
合计	41,402.58

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

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

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

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	2,695,964,155.74	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	192,242.35	100.00%	0.00	0.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	997,181.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	476,913.75
应支付基金管理人的净管理费	520,268.05

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 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	186,971.61

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 2025 年 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C	合计
国泰海通证券	-	108,699.18	108,699.18
国泰海通资管	-	21.48	21.48
招商银行	-	0.82	0.82
合计	-	108,721.48	108,721.48

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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，本基金本报告期内末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 04 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月
-------	---

	30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	29,938,293.27	104,710.20
国泰海通证券	13,853,304.50	18,483.44

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。
2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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（2025 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2025 年 6 月 30 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 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以 上	不计息	合计
--------------------------	--------	------------	--------------	-------	------------------	-----	----

日					上		
资产							
货币资金	43,791,597.77	-	-	-	-	-	43,791,597.77
交易性金融资产	-	-	-	-	-	302,255,747.74	302,255,747.74
应收申购款	-	-	-	-	-	1,391,451.83	1,391,451.83
资产总计	43,791,597.77	-	-	-	-	303,647,199.57	347,438,797.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,160,805.66	27,160,805.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	264,560.54	264,560.54
应付托管费	-	-	-	-	-	49,605.09	49,605.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	61,561.17	61,561.17
其他负债	-	-	-	-	-	41,476.90	41,476.90
负债总计	-	-	-	-	-	27,578,009.36	27,578,009.36
利率敏感度缺口	43,791,597.77	-	-	-	-	276,069,190.21	319,860,787.98

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 2025 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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2025 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	302,255,747.74	94.50
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	302,255,747.74	94.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 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 2025 年 06 月 30 日
第一层次	302,255,747.74
第二层次	—
第三层次	—
合计	302,255,747.74

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	302,255,747.74	87.00
	其中：股票	302,255,747.74	87.00
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	43,791,597.77	12.60
8	其他各项资产	1,391,451.83	0.40
9	合计	347,438,797.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	188,510,426.59	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,644,883.97	12.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,044,989.28	3.45
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	239,200,299.84	74.78

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,803,903.00	0.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,345,062.90	16.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	764,878.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	137,312.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,193,984.00	1.94
J	金融业	812,383.00	0.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,396,503.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	523,770.00	0.16
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	77,652.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	63,055,447.90	19.71

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	688041	海光信息	80,365	11,354,770.85	3.55
2	688981	中芯国际	119,181	10,508,188.77	3.29
3	688256	寒武纪	13,407	8,064,310.50	2.52
4	688008	澜起科技	74,093	6,075,626.00	1.90
5	688183	生益电子	89,674	4,591,308.80	1.44
6	688249	晶合集成	225,828	4,577,533.56	1.43
7	688469	芯联集成	915,309	4,366,023.93	1.36
8	688111	金山办公	15,220	4,262,361.00	1.33
9	688660	电气风电	418,700	3,634,316.00	1.14
10	688396	华润微	75,451	3,558,269.16	1.11
11	688347	华虹公司	63,860	3,506,552.60	1.10
12	688158	优刻得	151,875	3,435,412.50	1.07

13	688403	汇成股份	322,448	3,350,234.72	1.05
14	688343	云天励飞	66,696	3,296,116.32	1.03
15	688146	中船特气	112,589	3,254,947.99	1.02
16	688141	杰华特	99,701	3,248,258.58	1.02
17	688518	联赢激光	159,029	3,242,601.31	1.01
18	688277	天智航	230,352	3,201,892.80	1.00
19	688222	成都先导	198,976	3,199,534.08	1.00
20	688595	芯海科技	84,185	3,147,677.15	0.98
21	688512	慧智微	285,582	3,115,699.62	0.97
22	688584	上海合晶	173,837	3,108,205.56	0.97
23	688593	新相微	187,865	3,067,835.45	0.96
24	688505	复旦张江	353,705	3,063,085.30	0.96
25	688128	中国电研	122,950	3,012,275.00	0.94
26	688602	康鹏科技	355,867	2,982,165.46	0.93
27	688209	英集芯	159,442	2,944,893.74	0.92
28	688499	利元亨	68,952	2,869,092.72	0.90
29	688523	航天环宇	125,905	2,708,216.55	0.85
30	688661	和林微纳	66,316	2,637,387.32	0.82
31	688549	中巨芯	330,423	2,557,474.02	0.80
32	688351	微电生理	128,380	2,529,086.00	0.79
33	688108	赛诺医疗	222,774	2,499,524.28	0.78
34	688428	诺诚健华	99,781	2,437,649.83	0.76
35	688176	亚虹医药	271,927	2,411,992.49	0.75
36	688388	嘉元科技	116,707	2,343,476.56	0.73
37	688400	凌云光	80,821	2,228,234.97	0.70
38	688380	中微半导	81,408	2,206,156.80	0.69
39	688506	百利天恒	7,206	2,133,840.72	0.67
40	688055	龙腾光电	575,363	2,128,843.10	0.67
41	688220	翱捷科技	26,848	2,102,198.40	0.66
42	688685	迈信林	35,800	1,999,430.00	0.63
43	688275	万润新能	48,335	1,959,984.25	0.61
44	688180	君实生物	56,994	1,936,656.12	0.61
45	688012	中微公司	10,506	1,915,243.80	0.60
46	688717	艾罗能源	35,557	1,914,033.31	0.60
47	688181	八亿时空	58,907	1,833,185.84	0.57
48	688365	光云科技	115,475	1,757,529.50	0.55
49	688233	神工股份	55,259	1,755,578.43	0.55
50	688819	天能股份	62,309	1,729,697.84	0.54
51	688131	皓元医药	35,310	1,707,238.50	0.53
52	688418	震有科技	64,515	1,707,066.90	0.53
53	688552	航天南湖	42,752	1,706,232.32	0.53
54	688202	美迪西	47,156	1,694,315.08	0.53
55	688271	联影医疗	12,875	1,644,652.50	0.51

56	688588	凌志软件	110,981	1,616,993.17	0.51
57	688122	西部超导	30,757	1,595,673.16	0.50
58	688582	芯动联科	23,654	1,589,548.80	0.50
59	688636	智明达	45,732	1,545,284.28	0.48
60	688079	美迪凯	151,299	1,519,041.96	0.47
61	688387	信科移动	261,464	1,477,271.60	0.46
62	688488	艾迪药业	105,743	1,464,540.55	0.46
63	688716	中研股份	41,046	1,461,237.60	0.46
64	688334	西高院	83,698	1,437,931.64	0.45
65	688425	铁建重工	352,059	1,436,400.72	0.45
66	688262	国芯科技	53,067	1,415,296.89	0.44
67	688015	交控科技	66,986	1,395,988.24	0.44
68	688280	精进电动	187,570	1,363,633.90	0.43
69	688179	阿拉丁	106,359	1,352,886.48	0.42
70	688201	信安世纪	104,300	1,350,685.00	0.42
71	688690	纳微科技	58,459	1,334,618.97	0.42
72	688033	天宜新材	208,103	1,333,940.23	0.42
73	688221	前沿生物	131,396	1,319,215.84	0.41
74	688031	星环科技	27,079	1,262,693.77	0.39
75	688590	新致软件	60,883	1,250,536.82	0.39
76	688373	盟科药业	192,332	1,205,921.64	0.38
77	688182	灿勤科技	43,161	1,189,517.16	0.37
78	688090	瑞松科技	34,387	1,182,568.93	0.37
79	688297	中无人机	21,500	1,148,100.00	0.36
80	688579	山大地纬	102,226	1,143,908.94	0.36
81	688321	微芯生物	47,557	1,130,905.46	0.35
82	688629	华丰科技	19,557	1,118,660.40	0.35
83	688085	三友医疗	57,317	1,102,205.91	0.34
84	688381	帝奥微	48,027	1,040,264.82	0.33
85	688286	敏芯股份	14,505	1,025,358.45	0.32
86	688550	瑞联新材	22,816	981,316.16	0.31
87	688022	瀚川智能	64,198	951,414.36	0.30
88	688001	华兴源创	37,254	941,408.58	0.29
89	688036	传音控股	11,748	936,315.60	0.29
90	688030	山石网科	57,900	925,821.00	0.29
91	688248	南网科技	27,395	861,846.70	0.27
92	688668	鼎通科技	13,600	849,456.00	0.27
93	688261	东微半导	19,349	798,146.25	0.25
94	688586	江航装备	70,728	795,690.00	0.25
95	688238	和元生物	127,300	789,260.00	0.25
96	688213	思特威	7,700	787,094.00	0.25
97	688702	盛科通信	12,818	782,923.44	0.24
98	688553	汇宇制药	45,550	742,009.50	0.23

99	688102	斯瑞新材	53,336	718,969.28	0.22
100	688739	成大生物	25,200	665,280.00	0.21
101	688020	方邦股份	17,351	657,082.37	0.21
102	688665	四方光电	14,500	648,440.00	0.20
103	688711	宏微科技	35,437	623,336.83	0.19
104	688722	同益中	27,765	590,561.55	0.18
105	688270	臻镭科技	12,500	582,000.00	0.18
106	688252	天德钰	22,682	552,987.16	0.17
107	688468	科美诊断	70,000	515,200.00	0.16
108	688458	美芯晟	10,651	502,301.16	0.16
109	688597	煜邦电力	63,379	496,257.57	0.16
110	688585	上纬新材	63,303	492,497.34	0.15
111	688327	云从科技	35,427	488,538.33	0.15
112	688510	航亚科技	19,361	468,148.98	0.15
113	688018	乐鑫科技	3,148	459,922.80	0.14
114	688558	国盛智科	17,546	442,861.04	0.14
115	688667	菱电电控	7,333	390,188.93	0.12
116	688571	杭华股份	45,879	353,727.09	0.11
117	688560	明冠新材	23,123	350,775.91	0.11
118	688147	微导纳米	11,548	348,518.64	0.11
119	688443	智翔金泰	12,375	343,282.50	0.11
120	688591	泰凌微	7,161	343,011.90	0.11
121	688150	莱特光电	13,075	323,214.00	0.10
122	688362	甬矽电子	9,879	294,196.62	0.09
123	688603	天承科技	6,000	265,200.00	0.08
124	688522	纳睿雷达	5,100	261,222.00	0.08
125	688379	华光新材	6,838	237,005.08	0.07
126	688173	希荻微	15,921	217,480.86	0.07
127	688177	百奥泰	7,410	185,694.60	0.06
128	688298	东方生物	6,400	175,040.00	0.05
129	688662	富信科技	4,320	157,464.00	0.05
130	688653	康希通信	9,500	116,375.00	0.04
131	688733	壹石通	5,189	98,279.66	0.03
132	688225	亚信安全	4,000	81,560.00	0.03
133	688410	山外山	4,900	69,580.00	0.02
134	688300	联瑞新材	1,400	65,170.00	0.02
135	688508	芯朋微	907	50,628.74	0.02
136	688010	福光股份	1,560	48,422.40	0.02
137	688682	霍莱沃	1,492	46,699.60	0.01
138	688299	长阳科技	2,300	45,471.00	0.01
139	688288	鸿泉物联	1,326	38,467.26	0.01
140	688787	海天瑞声	313	33,234.34	0.01
141	688039	当虹科技	900	29,538.00	0.01

142	688089	嘉必优	944	23,741.60	0.01
143	688536	思瑞浦	105	14,565.60	0.00
144	688319	欧林生物	800	12,528.00	0.00
145	688361	中科飞测	132	11,113.08	0.00
146	688356	键凯科技	146	10,307.60	0.00
147	688326	经纬恒润	102	9,102.48	0.00
148	688798	艾为电子	131	8,934.20	0.00
149	688192	迪哲医药	119	7,116.20	0.00
150	688502	茂莱光学	19	5,465.54	0.00
151	688187	时代电气	103	4,392.95	0.00
152	688255	凯尔达	128	4,312.32	0.00
153	688084	晶品特装	40	3,520.00	0.00
154	688612	威迈斯	131	3,502.94	0.00
155	688005	容百科技	109	2,432.88	0.00
156	688563	航材股份	41	2,321.83	0.00
157	688728	格科微	150	2,310.00	0.00
158	688800	瑞可达	46	2,263.20	0.00
159	688025	杰普特	29	2,073.50	0.00
160	688315	诺禾致源	140	1,976.80	0.00
161	688235	百济神州	8	1,869.12	0.00
162	688475	萤石网络	48	1,512.96	0.00
163	688082	盛美上海	10	1,139.40	0.00
164	688339	亿华通	48	1,024.80	0.00
165	688099	晶晨股份	14	994.14	0.00
166	688127	蓝特光学	34	874.14	0.00
167	688663	新风光	28	754.60	0.00
168	688600	皖仪科技	32	752.00	0.00
169	688358	祥生医疗	25	741.25	0.00
170	688161	威高骨科	27	723.33	0.00
171	688312	燕麦科技	30	720.90	0.00
172	688289	圣湘生物	32	655.36	0.00
173	688772	珠海冠宇	45	643.05	0.00
174	688070	纵横股份	13	627.90	0.00
175	688227	品高股份	18	565.92	0.00
176	688683	莱尔科技	21	529.62	0.00
177	688208	道通科技	16	489.60	0.00
178	688028	沃尔德	21	455.70	0.00
179	688689	银河微电	19	438.33	0.00
180	688788	科思科技	9	411.03	0.00
181	688066	航天宏图	20	391.60	0.00
182	688472	阿特斯	29	265.35	0.00
183	688393	安必平	9	258.66	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002414	高德红外	302,768	3,103,372.00	0.97
2	301260	格力博	138,000	2,721,360.00	0.85
3	301526	国际复材	635,476	2,313,132.64	0.72
4	300869	康泰医学	159,300	2,284,362.00	0.71
5	002258	利尔化学	189,200	2,088,768.00	0.65
6	300879	大叶股份	53,000	2,081,840.00	0.65
7	300558	贝达药业	29,300	1,697,935.00	0.53
8	300124	汇川技术	24,500	1,581,965.00	0.49
9	600460	士兰微	61,300	1,521,466.00	0.48
10	300043	星辉娱乐	303,300	1,467,972.00	0.46
11	300458	全志科技	35,130	1,394,309.70	0.44
12	300489	光智科技	31,400	1,386,624.00	0.43
13	600703	三安光电	104,700	1,300,374.00	0.41
14	300393	中来股份	222,100	1,279,296.00	0.40
15	300830	金现代	135,100	1,233,463.00	0.39
16	002624	完美世界	81,100	1,230,287.00	0.38
17	300750	宁德时代	4,700	1,185,434.00	0.37
18	301165	锐捷网络	18,540	1,139,468.40	0.36
19	600521	华海药业	58,000	1,080,540.00	0.34
20	300967	晓鸣股份	57,700	1,067,450.00	0.33
21	300456	赛微电子	58,000	997,020.00	0.31
22	300739	明阳电路	66,000	979,440.00	0.31
23	300185	通裕重工	312,900	894,894.00	0.28
24	300206	理邦仪器	70,800	851,016.00	0.27
25	300289	利德曼	162,000	842,400.00	0.26
26	300231	银信科技	67,700	833,387.00	0.26
27	300102	乾照光电	71,500	827,255.00	0.26
28	300562	乐心医疗	54,500	803,875.00	0.25
29	300548	博创科技	11,800	787,886.00	0.25
30	300358	楚天科技	98,300	766,740.00	0.24
31	002786	银宝山新	81,000	746,820.00	0.23
32	300825	阿尔特	62,000	670,220.00	0.21
33	300221	银禧科技	79,900	663,170.00	0.21
34	301558	三态股份	72,900	656,829.00	0.21
35	301281	科源制药	19,700	637,886.00	0.20
36	300473	德尔股份	19,500	634,725.00	0.20
37	601628	中国人寿	15,400	634,326.00	0.20

38	300241	瑞丰光电	110,200	628,140.00	0.20
39	002107	沃华医药	109,100	624,052.00	0.20
40	300420	五洋自控	181,200	623,328.00	0.19
41	300746	汉嘉设计	39,100	612,697.00	0.19
42	002151	北斗星通	20,700	593,883.00	0.19
43	301282	金禄电子	22,500	557,775.00	0.17
44	300187	永清环保	102,700	523,770.00	0.16
45	300026	红日药业	135,300	499,257.00	0.16
46	300549	优德精密	25,900	473,711.00	0.15
47	301248	杰创智能	17,600	437,888.00	0.14
48	300631	久吾高科	17,600	432,256.00	0.14
49	300039	上海凯宝	68,700	416,322.00	0.13
50	600354	敦煌种业	67,100	415,349.00	0.13
51	300510	金冠股份	83,400	381,972.00	0.12
52	300496	中科创达	6,300	360,486.00	0.11
53	300320	海达股份	35,500	352,870.00	0.11
54	301055	张小泉	15,800	333,064.00	0.10
55	300602	飞荣达	15,600	330,876.00	0.10
56	002491	通鼎互联	57,200	324,896.00	0.10
57	300498	温氏股份	18,800	321,104.00	0.10
58	300224	正海磁材	21,500	304,225.00	0.10
59	300400	劲拓股份	17,500	294,700.00	0.09
60	301509	金凯生科	7,300	275,867.00	0.09
61	300579	数字认证	7,700	265,727.00	0.08
62	300014	亿纬锂能	5,600	256,536.00	0.08
63	300018	中元股份	31,600	251,220.00	0.08
64	600268	国电南自	29,800	233,036.00	0.07
65	301536	星宸科技	3,800	229,140.00	0.07
66	301087	可孚医疗	6,400	212,480.00	0.07
67	300160	秀强股份	34,400	193,328.00	0.06
68	300054	鼎龙股份	6,700	192,156.00	0.06
69	300512	中亚股份	21,400	183,612.00	0.06
70	002249	大洋电机	27,000	177,660.00	0.06
71	300768	迪普科技	9,900	169,785.00	0.05
72	300222	科大智能	15,800	161,002.00	0.05
73	301205	联特科技	1,600	153,376.00	0.05
74	001389	广合科技	2,600	152,802.00	0.05
75	002228	合兴包装	39,900	140,847.00	0.04
76	600106	重庆路桥	22,400	137,312.00	0.04
77	300570	太辰光	1,400	134,932.00	0.04
78	300476	胜宏科技	1,000	134,380.00	0.04
79	301119	正强股份	3,300	116,688.00	0.04
80	301230	泓博医药	3,300	113,586.00	0.04

81	300059	东方财富	4,900	113,337.00	0.04
82	300666	江丰电子	1,500	111,150.00	0.03
83	600685	中船防务	4,000	108,760.00	0.03
84	301183	东田微	2,000	102,460.00	0.03
85	300299	富春股份	12,600	96,768.00	0.03
86	300538	同益股份	6,100	96,502.00	0.03
87	300760	迈瑞医疗	400	89,900.00	0.03
88	300308	中际旭创	600	87,516.00	0.03
89	300702	天宇股份	3,500	81,410.00	0.03
90	002825	纳尔股份	7,900	78,842.00	0.02
91	301216	万凯新材	5,900	73,573.00	0.02
92	300871	回盛生物	3,400	71,060.00	0.02
93	300479	神思电子	3,100	68,417.00	0.02
94	300900	广联航空	2,800	67,956.00	0.02
95	300232	洲明科技	9,300	67,332.00	0.02
96	300041	回天新材	6,900	64,998.00	0.02
97	300433	蓝思科技	2,800	62,440.00	0.02
98	300709	精研科技	1,500	58,575.00	0.02
99	301318	维海德	1,700	57,528.00	0.02
100	300238	冠昊生物	3,400	55,182.00	0.02
101	301069	凯盛新材	3,400	54,774.00	0.02
102	300066	三川智慧	12,200	53,924.00	0.02
103	300424	航新科技	3,059	52,981.88	0.02
104	300148	天舟文化	10,300	52,118.00	0.02
105	300696	爱乐达	2,300	51,934.00	0.02
106	300009	安科生物	6,200	51,894.00	0.02
107	300425	中建环能	9,400	49,256.00	0.02
108	300434	金石亚药	5,100	49,062.00	0.02
109	300803	指南针	600	48,396.00	0.02
110	300274	阳光电源	700	47,439.00	0.01
111	300365	恒华科技	6,700	44,153.00	0.01
112	300534	陇神戎发	4,400	42,504.00	0.01
113	300539	横河精密	2,800	38,332.00	0.01
114	603500	祥和实业	4,000	36,640.00	0.01
115	300048	合康新能	5,700	33,459.00	0.01
116	600819	耀皮玻璃	5,700	33,174.00	0.01
117	300733	西菱动力	1,800	31,914.00	0.01
118	300699	光威复材	1,000	31,670.00	0.01
119	300582	英飞特	2,300	29,486.00	0.01
120	300088	长信科技	4,900	29,204.00	0.01
121	301251	威尔高	700	27,447.00	0.01
122	300133	华策影视	3,400	25,534.00	0.01
123	300079	数码视讯	4,300	25,155.00	0.01

124	300850	新强联	700	25,074.00	0.01
125	300684	中石科技	1,000	23,880.00	0.01
126	300484	蓝海华腾	1,000	22,370.00	0.01
127	300824	北鼎股份	1,700	20,281.00	0.01
128	300655	晶瑞电材	1,900	19,019.00	0.01
129	300247	融捷健康	4,500	17,550.00	0.01
130	300279	和晶科技	2,500	17,325.00	0.01
131	300984	金沃股份	300	17,175.00	0.01
132	600909	华安证券	2,800	16,324.00	0.01
133	301221	光庭信息	300	15,591.00	0.00
134	300502	新易盛	120	15,242.40	0.00
135	300380	安硕信息	300	14,952.00	0.00
136	300550	和仁科技	1,100	14,949.00	0.00
137	301188	力诺药包	600	12,978.00	0.00
138	301489	思泉新材	220	12,647.80	0.00
139	301017	漱玉平民	900	11,547.00	0.00
140	300314	戴维医疗	900	11,430.00	0.00
141	300703	创源股份	500	10,580.00	0.00
142	002523	天桥起重	2,800	10,220.00	0.00
143	300395	菲利华	200	10,220.00	0.00
144	300994	久祺股份	600	9,384.00	0.00
145	300796	贝斯美	900	9,279.00	0.00
146	301199	迈赫股份	360	9,187.20	0.00
147	002340	格林美	1,400	8,890.00	0.00
148	300821	东岳硅材	1,100	8,646.00	0.00
149	300017	网宿科技	800	8,576.00	0.00
150	300196	长海股份	600	7,320.00	0.00
151	002916	深南电路	20	2,156.20	0.00
152	301330	熵基科技	40	1,081.20	0.00
153	300913	兆龙互连	20	936.40	0.00
154	301077	星华新材	42	850.08	0.00
155	300932	三友联众	20	229.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	33,681,915.69	10.53
2	688256	寒武纪	23,564,078.2	7.37

			5	
3	300750	宁德时代	22,363,667.00	6.99
4	688981	中芯国际	20,908,633.19	6.54
5	688280	精进电动	16,881,262.98	5.28
6	688008	澜起科技	16,120,214.07	5.04
7	688111	金山办公	12,829,283.91	4.01
8	688012	中微公司	11,989,954.85	3.75
9	688158	优刻得	10,121,361.96	3.16
10	688249	晶合集成	9,425,660.14	2.95
11	688396	华润微	9,016,294.54	2.82
12	688469	芯联集成	8,825,572.87	2.76
13	688222	成都先导	8,377,012.04	2.62
14	688183	生益电子	8,355,826.03	2.61
15	688428	诺诚健华	8,104,160.13	2.53
16	688343	云天励飞	8,010,864.39	2.50
17	002414	高德红外	7,988,632.08	2.50
18	688202	美迪西	7,762,786.84	2.43
19	688717	艾罗能源	7,660,118.56	2.39
20	688277	天智航	7,637,196.98	2.39
21	688365	光云科技	7,556,028.49	2.36
22	688661	和林微纳	7,536,078.66	2.36
23	688512	慧智微	7,504,458.31	2.35
24	688425	铁建重工	7,309,990.68	2.29
25	688146	中船特气	7,248,893.75	2.27
26	688209	英集芯	7,165,535.87	2.24
27	688499	利元亨	7,109,120.23	2.22
28	688141	杰华特	6,925,934.28	2.17
29	688475	萤石网络	6,882,683.28	2.15
30	688602	康鹏科技	6,871,259.56	2.15
31	300489	光智科技	6,842,176.00	2.14
32	688180	君实生物	6,835,395.48	2.14
33	688297	中无人机	6,742,435.23	2.11
34	688235	百济神州	6,672,795.38	2.09
35	301260	格力博	6,595,802.00	2.06
36	688443	智翔金泰	6,586,614.15	2.06
37	688403	汇成股份	6,482,754.23	2.03

38	688508	芯朋微	6,446,072.46	2.02
39	688458	美芯晟	6,402,334.52	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	22,071,522.40	6.90
2	688041	海光信息	20,981,921.95	6.56
3	688280	精进电动	14,867,563.89	4.65
4	688256	寒武纪	13,286,633.19	4.15
5	688008	澜起科技	10,868,154.83	3.40
6	688981	中芯国际	10,051,675.49	3.14
7	688012	中微公司	9,682,908.46	3.03
8	688111	金山办公	7,904,305.92	2.47
9	688158	优刻得	7,188,720.60	2.25
10	688428	诺诚健华	6,855,584.13	2.14
11	688202	美迪西	6,742,352.42	2.11
12	688297	中无人机	6,694,554.82	2.09
13	688235	百济神州	6,624,412.69	2.07
14	688183	生益电子	6,537,845.17	2.04
15	301408	华人健康	6,517,246.00	2.04
16	688475	萤石网络	6,470,790.85	2.02
17	688458	美芯晟	6,405,242.65	2.00
18	688443	智翔金泰	6,291,217.84	1.97
19	688365	光云科技	6,236,052.49	1.95
20	688508	芯朋微	6,219,188.63	1.94

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	1,483,995,465.43
卖出股票收入（成交）总额	1,211,968,690.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,391,451.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,391,451.83

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
国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	4,945	32,184.11	27,756,175.15	17.44%	131,394,239.05	82.56%
国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C	4,562	30,685.30	4,041,544.17	2.89%	135,944,794.16	97.11%
合计	9,507	31,464.89	31,797,719.32	10.63%	267,339,033.21	89.37%

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	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	654,622.20	0.4113%
	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C	129,305.46	0.0924%
	合计	783,927.66	0.2621%

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	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	10~50
	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	10~50
	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C	0
	合计	10~50

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 A	国泰君安上证科创板综合价格指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 04 月 17 日）基金份额总额	388,822,699.95	434,066,306.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,425,465.95	24,002,413.80
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	236,097,751.70	318,082,382.06
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	159,150,414.20	139,986,338.33

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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：

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级

管理人员变更公告》，陶耿同志担任公司董事长，谢乐斌同志不再担任公司董事长，生效日期为 2025 年 4 月 25 日。

2、本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
国泰海通证券股份有限公司	2	2,695,964,155.74	100.00%	192,242.35	100.00%	-
光大证券股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
江海证券有限公司	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	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
2	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
3	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
4	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
5	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
6	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报	2025-03-29
7	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
9	国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-04-18
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-04-26
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指	2025-04-30

	告	定网站、公司官网、上交所	
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁财富开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2025-04-30
13	国泰君安上证科创板综合价格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	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-05-16
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2025-06-11
15	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2025 年 7 月 25 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告》，其中公司中文名称由“上海国泰君安证券资产管理有限公司”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司”，公司住所由“上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室”变更为“上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层”，生效日期为 2025 年 7 月 25 日。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安上证科创板综合价格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
二〇二五年八月二十九日