
国泰君安中证500指数增强型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06月30日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:上海银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

§ 1 重要提示

上海国泰君安证券资产管理有限公司的董事会及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责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月15日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

上海国泰君安证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至2022年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安中证500指数增强
基金主代码	014155
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月15日
报告期末基金份额总额	1,341,451,216.32份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略，主要包括以下几个方面：</p> <p>1) 行业配置</p> <p>本基金在行业配置方面尽量遵循基准指数的行业市值占比，尽量控制投资组合相对于基准指数的行业</p>

暴露带来的风险损失。

2) 个股选择

本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证500指数的风险偏离度。

A、股票池的建立

考虑到Alpha选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上六成以上的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市时间较短的次新股；在过去一段时间流动性和规模综合排名市场排名相对靠后；被交易所标注ST、即将退市、业绩有连续亏损风险或者被证监会立案调查或者出具警示函等高风险的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票等。

B、选股策略

本基金通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过智能化的模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本基金通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价的中短期主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。本基金的选股策略以低中高等不同调仓频率的多因子选股策略为主，多因子策略投资的详细过程需要分成因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等几个环节。因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交易数据相关因子以及

	<p>互联网和舆情数据因子等。在多因子模型算法层面，以人工智能选股模型为核心，并基于股票市场的高噪音和时序性的特征，构建多维度阿尔法预测模型。在投资组合层面，均严格控制其相对于基准指数在市场主要风险因子的风险暴露程度，通过配套的风险模型和组合优化模型得到不同调仓频率的投资组合，并在基金中进行相对均衡的配置。</p> <p>本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略和可转换债券、可交换债券的投资策略。</p>	
业绩比较基准	<p>中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%</p>	
风险收益特征	<p>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。</p>	
基金管理人	<p>上海国泰君安证券资产管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>上海银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>国泰君安中证500指数增强A</p>	<p>国泰君安中证500指数增强C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>014155</p>	<p>014156</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>878,840,183.55份</p>	<p>462,611,032.77份</p>

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年04月01日 - 2022年06月30日)	
	国泰君安中证500指数增强A	国泰君安中证500指数增强C
1. 本期已实现收益	13,031,432.42	6,597,907.61
2. 本期利润	35,022,642.61	19,184,378.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0465	0.0434
4. 期末基金资产净值	852,283,570.47	447,662,850.31
5. 期末基金份额净值	0.9698	0.9677

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。

3.2 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

国泰君安中证500指数增强A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.58%	1.68%	1.99%	1.66%	2.59%	0.02%
过去六个月	-4.44%	1.55%	-11.65%	1.55%	7.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	-3.02%	1.48%	-11.24%	1.49%	8.22%	-0.01%

国泰君安中证500指数增强C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.48%	1.68%	1.99%	1.66%	2.49%	0.02%
过去六个月	-4.63%	1.55%	-11.65%	1.55%	7.02%	0.00%
自基金合	-3.23%	1.48%	-11.24%	1.49%	8.01%	-0.01%

同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、本基金于 2021 年 12 月 15 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。



注：1、本基金于 2021 年 12 月 15 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	本基金基金经理，现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部（公募）部门总经理。	2021-12-15	-	11年	胡崇海先生，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，11年证券从业经验，具备基金从业资格。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

				<p>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。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部（公募）部门总经理。自2021年12月15日起担任“国泰君安中证500指数增强型证券投资基金”基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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 公平交易专项说明

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，本基金与本管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

A股二季度走势波动较大，市场四月份在疫情超预期管控、人民币贬值和中概股弱势等情绪影响下延续了下挫的走势，短期市场的大幅下跌一定程度上触发了部分存量资管产品的止损盘，以及部分“雪球型”产品的敲入，进而加速了市场非理性下跌。中证500指数在4月25日和26日连续两天加权市盈率创出了该指数成立以来的历史最低值。之后，在上海复工复产的预期以及相关经济刺激政策的引导下，4月底开始A股迎来了一波深V反弹，市场情绪明显好转。整体来看，前期跌幅较大的板块反弹力度较大，以新能源相关产业链为主的股票在大力度政府扶持和高景气度的业绩支撑下涨幅居前，而一季度表现较好的行业出现了分化，煤炭等上游资源板块表现依然不错，房地产和银行等行业在二季度则迎来调整。高景气度的行业一直是公募等机构的重仓板块，也带动了机构的投资业绩在二季度得到显著改善，市场情绪的好转也使得社会增量资金入市可期。

从市场主要风险的角度来看，得益于4月份的抗跌，大盘股在二季度整体表现优于中小盘股，高Beta的股票期间享有一定的风险溢价，而一季度表现上乘的市净率因子在二季度迎来调整，成长因子在反弹行情中不断走强，反转因子则延续了一季度的良好表现。从Alpha大类因子的表现来看，二季度从市场见底以来，机构重仓股表现活跃，期间市场在年报、一季报和二季度业绩预告等密集基本面增量信息的引导下，估值因子延续了一季度的强势表现，而成长、盈利质量和分析师情绪因子则相对于一季度有显著改善，大类基本面因子在二季度没有短板的均衡水平带动了基本面量化选股模型的上乘表现。另一方面，从4月底开始高频量价因子得益于市场活跃度提升也开始复苏，到6月中旬的年内表现几乎和基本面量化模型不相上下，而两者策略表现的相关性较低，体现出较好的互补特征。

从四月底以来，中证500指数等中小盘宽基指数反弹力度较大，但是我们认为这只是对市场前期因极端悲观预期和短期流动性枯竭等因素导致错杀的快速纠正，而从中长期的角度来看，在当前时间点我们依然坚定地看好中证500指数未来的走势，主要有以下几个理由：1). 从历史相对估值（加权PE）的角度来看，中证500指数依然是几个主要宽基指数中最低估的指数之一，历史上只有约7%的时间比当前的估值更低，即便剔除煤炭、有色金属、石油石化、基础化工和钢铁等五大强周期行业的成分股之后依然比历史上约88%的时间更便宜，而20倍左右的绝对估值也比剔除银行的沪深300指数更便宜，指数的低估值提供了较好的安全垫，也为后续估值和盈利的双击创造了较好的基本面条件；2). 中证500成分股涵盖了二线蓝筹或细分行业的龙头公司，优质的基本面对机构具有较好的配置价值，相对于大盘股也具有更大的市值空间；3). 中证500指数在周期和非周期、价值和成长、新兴行业和传统行业等方面的分布均较为平衡，在各种不同是市场

环境下进可攻退可守；4). 六月中旬的成分股调整进一步优化了指数的成长性和行业分布。

在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以高频量价为主的技术面信号，通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，并通过投资组合管理模型严格控制投资组合在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，力求以较为稳定的方式对中证500指数进行增强。考虑到中证500指数在行业配置上较为均衡，公司之间业务的差异度较大，以及个股波动性和流动性适中等特点，在市场轮动较快、投资热点较为分散的市场环境中量化模型的发挥较为稳定。今年以来由于估值等大类因子较为显著的改善，使得基本面量化等低频策略相对于高频量价等高换手策略并无劣势，本基金在两者上进行了均衡配置。

二季度在市场风格和行业走势出现较大的变化下，我们依然维持一贯的投资理念和投资组合管理体系，本基金在投资组合的配置和交易方面严格遵循量化模型的建议，基金经理则主要从挖掘有投资逻辑的Alpha因子、随着市场演变不断改进底层量化模型以及模型的日常跟踪和分析等层面不断增强策略的表现。从商业软件的业绩归因来分析，基金在二季度的超额收益几乎完全来自于模型的选股能力，即纯正Alpha部分，在主要市场风险因子和行业上的暴露导致的整体额外收益几乎为零，这主要基于基金管理人在投资组合端相对于基准指数进行了较严格的风险敞口控制，与基金管理人追求长期稳定超额收益的投资理念相符。本基金从建仓完成后超额收益表现较为稳定，同时跟踪误差较小，达成了对基准指数稳定增强的投资目标，基本符合该Alpha选股模型在历史上的表现规律。基准指数虽然波动较大，但随着经济的发展从中长期来看是震荡向上的，我们希望通过选择基本面和技术面共振的股票来博取较为稳定的超额收益，以此在中证500指数的基础上不断提升业绩表现，共享以部分细分行业龙头和民营经济为主体的中盘股增长红利。作为宽基指数的增强型量化产品，具有越跌越安全的特点，投资管理人始终保持高仓位运作，一般情况下不主动择时，而专注于以稳健的方式跑赢指数，通过积少成多、以概率取胜地方式增厚投资收益，这样的基金特点更需要投资者坚持长期投资的理念。我们认为中证500指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然远大于下挫的空间，我们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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证500指数增强A基金份额净值为0.9698元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.58%，同期业绩比较基准收益率为1.99%；截至报告期末国泰君安中证500指数增强C基金份额净值为0.9677元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.48%，同期业绩比较基准收益率为1.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,193,492,513.35	91.26
	其中：股票	1,193,492,513.35	91.26
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	99,171,279.14	7.58
8	其他资产	15,099,669.74	1.15
9	合计	1,307,763,462.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	3,947,324.00	0.30
B	采矿业	54,826,897.84	4.22
C	制造业	525,235,791.71	40.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,450,877.32	3.50
E	建筑业	15,822,713.00	1.22
F	批发和零售业	19,554,648.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	34,021,685.00	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	105,590,080.28	8.12

	术服务业		
J	金融业	81,354,312.85	6.26
K	房地产业	21,532,956.00	1.66
L	租赁和商务服务业	17,185,808.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	10,235,475.00	0.79
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	5,983,640.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	20,271,357.00	1.56
S	综合	3,355,967.00	0.26
	合计	964,369,533.00	74.19

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,227,286.44	0.25
C	制造业	156,600,789.72	12.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,314,405.00	1.56
E	建筑业	3,255,368.00	0.25
F	批发和零售业	6,940,292.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	9,217,693.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,412,002.30	0.65
J	金融业	5,535,298.00	0.43
K	房地产业	13,178,769.46	1.01
L	租赁和商务服务业	35,370.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,389,471.51	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	229,122,980.35	17.63

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002240	盛新锂能	308,100	18,596,916.00	1.43
2	000983	山西焦煤	1,329,100	17,796,649.00	1.37
3	000629	攀钢钒钛	4,656,100	17,693,180.00	1.36
4	300363	博腾股份	224,000	17,469,760.00	1.34
5	300182	捷成股份	3,147,000	17,308,500.00	1.33
6	600497	驰宏锌锗	3,327,700	17,270,763.00	1.33
7	603198	迎驾贡酒	257,300	16,760,522.00	1.29
8	601872	招商轮船	2,872,000	16,542,720.00	1.27
9	300009	安科生物	1,608,500	16,261,935.00	1.25
10	600392	盛和资源	715,400	16,168,040.00	1.24

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002805	丰元股份	205,150	12,698,785.00	0.98
2	603392	万泰生物	61,600	9,566,480.00	0.74
3	600649	城投控股	2,127,501	9,105,704.28	0.70
4	688518	联赢激光	267,022	9,076,077.78	0.70
5	688313	仕佳光子	769,638	8,773,873.20	0.67

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2207	IC2207	22	28,312,240.00	56,828.66	-
IC2208	IC2208	7	8,954,680.00	-1,400.00	-
公允价值变动总额合计(元)					55,428.66
股指期货投资本期收益(元)					611,770.08
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-109,731.34

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上,本基金以套期保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险,本基金将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,适度运用国债期货提高投资组合运作效率。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,217,368.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,882,300.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,099,669.74

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证500指数 增强A	国泰君安中证500指数 增强C
--	--------------------	--------------------

报告期期初基金份额总额	702,747,174.43	423,801,434.63
报告期期间基金总申购份额	261,686,750.11	145,804,094.69
减：报告期期间基金总赎回份额	85,593,740.99	106,994,496.55
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	878,840,183.55	462,611,032.77

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国泰君安中证500指数 增强A	国泰君安中证500指数 增强C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	9,999,450.00	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份 额	9,999,450.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例 (%)	1.14	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 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网站<http://www.gtjazg.com>。

9.3 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。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

2022年07月21日