
国泰君安中证500指数增强型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09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10月26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10月21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7月1日起至2022年9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	1,219,766,371.55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>759,307,638.45份</p>	<p>460,458,733.10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07月01日 - 2022年09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	-19,399,501.76	-13,131,135.95
2. 本期利润	-71,603,606.54	-43,815,162.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0903	-0.0958
4. 期末基金资产净值	664,073,712.42	401,432,933.17
5. 期末基金份额净值	0.8746	0.8718

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。

3.2 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	-9.82%	1.14%	-10.90%	1.10%	1.08%	0.04%
过去六个月	-5.68%	1.42%	-9.13%	1.39%	3.45%	0.03%
自基金合同生效起至今	-12.54%	1.37%	-20.92%	1.37%	8.38%	0.00%

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	-9.91%	1.14%	-10.90%	1.10%	0.99%	0.04%
过去六个月	-5.87%	1.42%	-9.13%	1.39%	3.26%	0.03%
自基金合同生效起至今	-12.82%	1.37%	-20.92%	1.37%	8.10%	0.00%

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，国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。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，自2022年8月16日起担任“国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金”基金经理，自2022年8月18日起担任“国泰君安量化选股混

					合型发起式证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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 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

三季度A股在复杂多变的国际政治和经济形势下走出了逐月往下的弱势调整行情，基本上回吐了上个季度的反弹幅度，市场成交量低迷，赚钱效应较差。期间创业板和科创板等受新能源、半导体和医药生物等行业的大幅回调，整体跌幅居前，而中证500指数由于相对均衡的板块和风格配置，在所有主要市场指数当中相对抗跌，整体来看小盘股相对于大盘股表现更好，价值股优于成长股，基金重仓股表现则相对较差。从行业走势来看，煤炭、电力和石油石化等“旧能源”表现居前，而新能源相关产品链和医药生物、电子元器件等新兴产业的调整力度较大，从行业和个股的角度相对于上个季度整体均呈现一定的反转效应，而从年内来看依然是强者恒强的格局。

从中证500指数当前的估值水平来看，截至9月底其加权PE和整体PE均已跌破20倍，均处于历史极端低估的水平，在历史上的分位数低于5%，而用PB估值的话，则历史分位数更低，在市场主要宽基指数当中是历史相对估值最低的指数之一，当前大致回到了五月反弹初期的水平。另外一方面，即便剔除中证500指数中煤炭、有色、石油石化、钢铁和基础化工等五大强周期行业的成分股，从历史纵向来分析，其估值历史分位数也仅在10%附近，从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间十分有限。虽然短期指数调整的幅度超出预期，但并不影响我们之前对中证500指数中长期周期的逻辑，未来随着市场情绪的好转，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个价值股和成长股、周期股和非周期股、新兴行业 and 传统行业均相对均衡的中盘宽基指数，中证500指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

从Alpha模型的表现来看，三季度基本面量化模型的表现要优于高频量价模型的表现，后者受制于市场风险偏好下行、成交量萎缩等不利因素的影响，而今年以来以估值为代表的财务相关因子表现优于历史常态表现，带动了基本面量化模型的持续回暖。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，得益于基本面量化和高频量价在信号层面极低的相关性，使得我们有信心在兼顾两者的情况下追求稳健的Alpha。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，不过也要认识到三季度我们的Alpha水平是低于模型历史常态表现的，但随着市场的不断演变，期间我们的因子和模型层面也均得到了不同程度的改良。

三季度指数出现了较大程度的调整，但作为一只指数增强型基金在择时和仓位控制层面的操作空间是十分有限的，我们依然维持一贯的投资理念和投资组合管理体系，保持高仓位运行，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，基金在三季度的超额收益依然主要来自于模型的选股能力，严格控制在主要市场风险因子和行业上的暴露，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0.8746元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.82%，同期业绩比较基准收益率为-10.90%；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0.8718元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.91%，同期业绩比较基准收益率为-10.90%。

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	981,880,274.54	91.99
	其中：股票	981,880,274.54	91.99
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	81,821,015.26	7.67
8	其他资产	3,673,893.61	0.34
9	合计	1,067,375,183.41	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	7,939,806.00	0.75
B	采矿业	68,100,800.06	6.39
C	制造业	440,496,655.57	41.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,799,649.00	3.74
E	建筑业	9,313,429.90	0.87
F	批发和零售业	13,562,015.00	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	37,596,989.00	3.53
H	住宿和餐饮业	297,321.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,664,762.05	5.22
J	金融业	85,789,031.19	8.05
K	房地产业	21,627,133.62	2.03
L	租赁和商务服务业	149,178.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	13,522,843.00	1.27
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	6,384,661.18	0.60
R	文化、体育和娱乐业	364,064.00	0.03
S	综合	3,201,066.00	0.30
	合计	803,809,404.57	75.44

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	1,553,886.68	0.15
C	制造业	113,973,683.25	10.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,382,071.00	0.79
E	建筑业	6,367,567.00	0.60

F	批发和零售业	8,965,724.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	672,628.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,932,265.99	1.21
J	金融业	160,632.00	0.02
K	房地产业	15,236,283.00	1.43
L	租赁和商务服务业	1,113.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	9,819,549.05	0.92
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	5,467.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	178,070,869.97	16.71

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	002507	涪陵榨菜	521,000	14,160,780.00	1.33
2	601058	赛轮轮胎	1,352,900	13,691,348.00	1.28
3	000060	中金岭南	3,289,400	13,552,328.00	1.27
4	603127	昭衍新药	239,300	13,522,843.00	1.27
5	000937	冀中能源	1,818,800	13,186,300.00	1.24
6	002683	广东宏大	493,700	12,969,499.00	1.22
7	600959	江苏有线	4,450,300	12,772,361.00	1.20
8	605117	德业股份	29,900	12,564,279.00	1.18
9	600582	天地科技	2,631,000	12,549,870.00	1.18
10	603228	景旺电子	624,000	12,055,680.00	1.13

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	000541	佛山照明	1,587,200	9,126,400.00	0.86
2	600067	冠城大通	2,738,500	9,037,050.00	0.85
3	688686	奥普特	48,140	7,572,903.40	0.71
4	603259	药明康德	102,200	7,326,718.00	0.69
5	002132	恒星科技	1,349,100	6,758,991.00	0.63

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
IC2210	IC2210	2	2,290, 640.00	5,120.00	-
IC2211	IC2211	7	7,981, 120.00	-156,890. 00	-
IC2212	IC2212	1	1,137,	-119,400.	-

			080.00	00	
IC2303	IC2303	9	10,092,960.00	-144,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-415,810.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,644,925.68
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-471,238.66

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	3,010,252.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	663,641.61
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	3,673,893.61
---	----	--------------

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	878,840,183.55	462,611,032.77
报告期期间基金总申购份额	69,594,499.43	114,965,205.81
减：报告期期间基金总赎回份额	189,127,044.53	117,117,505.48
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	759,307,638.45	460,458,733.10

§ 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 (%)	1.32	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

§ 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10月26日