

国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

上海国泰君安证券资产管理有限公司的董事会、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。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2023年3月17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。

本报告期自2022年8月16日（合同生效日）起至2022年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§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	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6 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	83
8.7 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	83
8.8 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	83
8.9 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	84

8.10	本基金投资股指期货的投资政策	84
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12	投资组合报告附注	84
§9	基金份额持有人信息	85
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
9.3	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	86
§10	开放式基金份额变动	86
§11	重大事件揭示	87
11.1	基金份额持有人大会决议	87
11.2	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	87
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4	基金投资策略的改变	87
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	87
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	87
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	88
11.8	其他重大事件	88
§12	影响投资者决策的其他重要信息	89
12.1	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	89
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	89
§13	备查文件目录	90
13.1	备查文件目录	90
13.2	存放地点	90
13.3	查阅方式	90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证1000指数增强	
基金主代码	015867	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年08月16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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	583,221,036.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证1000指数增强A	国泰君安中证1000指数增强C
下属分级基金的交易代码	015867	015868
报告期末下属分级基金的份额总额	309,802,278.63份	273,418,758.21份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证1000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	<ol style="list-style-type: none"> 1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证1000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

	<p>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。</p>
--	--

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		上海国泰君安证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	秦一楠
	联系电话	021-38676022	010-66060069
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95521	95599
传真		021-38871190	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		谢乐斌	谷澍

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼

注册登记机构	上海国泰君安证券资产管理 有限公司	上海市静安区新闻路669号博华广场 22-23层及25层
--------	----------------------	---------------------------------

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2022年08月16日（基金合同生效日） - 2022年12月31日	
	国泰君安中证1000 指数增强A	国泰君安中证1000 指数增强C
本期已实现收益	-22,804,544.93	-19,117,772.21
本期利润	-30,625,689.66	-25,064,443.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0936	-0.0927
本期加权平均净值利润率	-9.91%	-9.82%
本期基金份额净值增长率	-9.49%	-9.63%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	-29,399,701.55	-26,319,563.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0949	-0.0963
期末基金资产净值	280,402,577.08	247,099,194.86
期末基金份额净值	0.9051	0.9037
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	-9.49%	-9.63%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安中证1000指数增强A

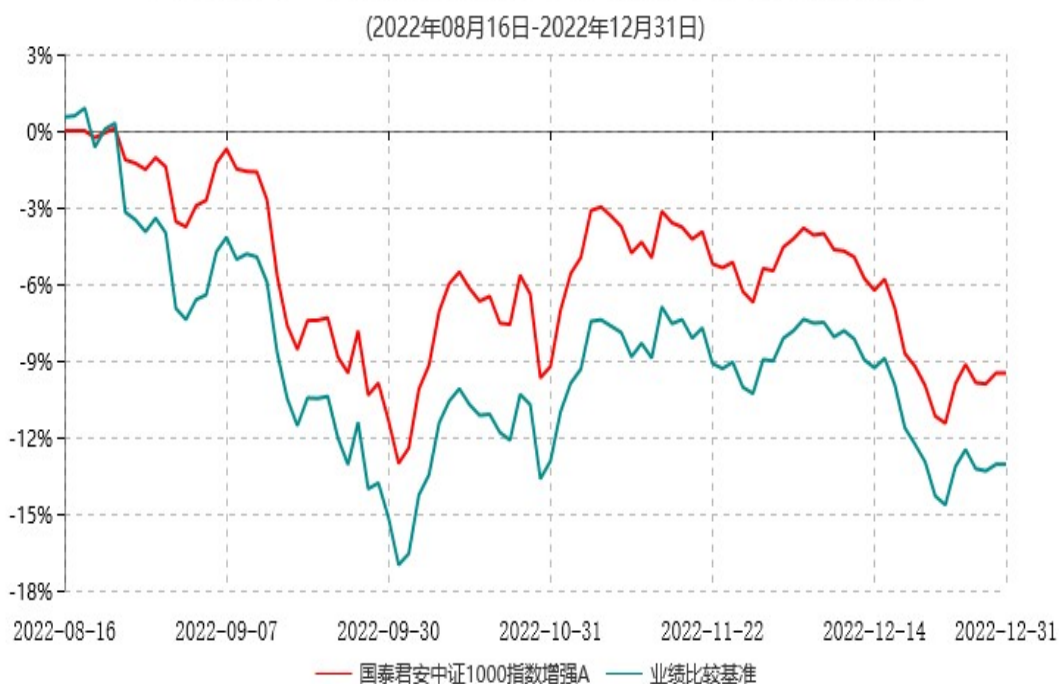
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.09%	1.14%	2.47%	1.14%	-0.38%	0.00%
过去六个月	-9.49%	1.15%	-13.06%	1.24%	3.57%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	-9.49%	1.15%	-13.06%	1.24%	3.57%	-0.09%

国泰君安中证1000指数增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.97%	1.14%	2.47%	1.14%	-0.50%	0.00%
过去六个月	-9.63%	1.15%	-13.06%	1.24%	3.43%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	-9.63%	1.15%	-13.06%	1.24%	3.43%	-0.09%

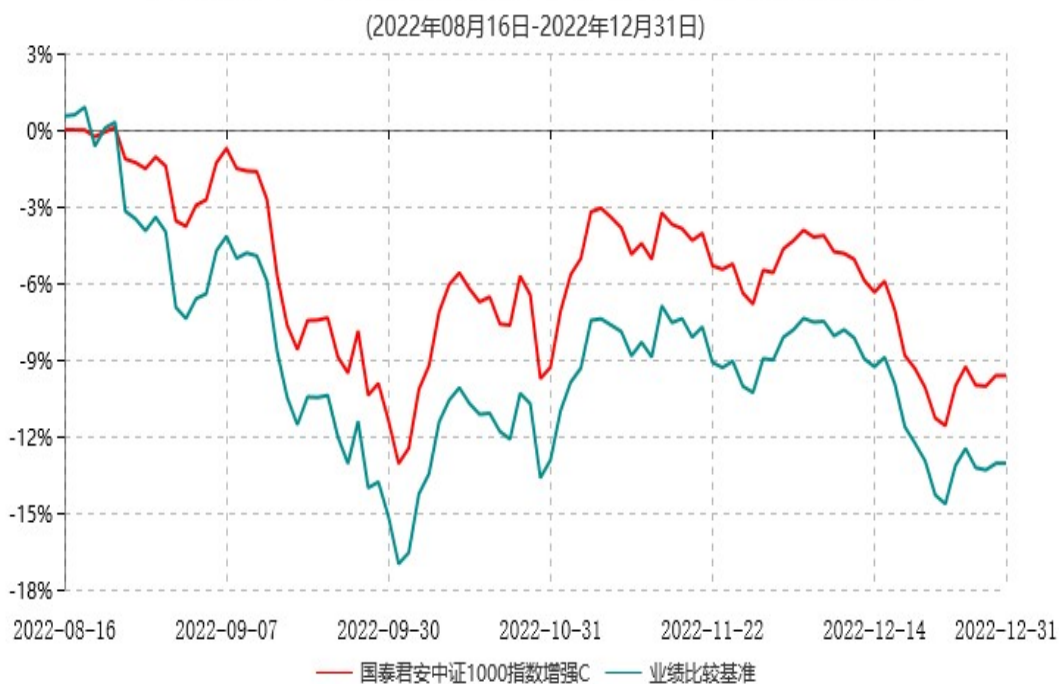
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰君安中证1000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



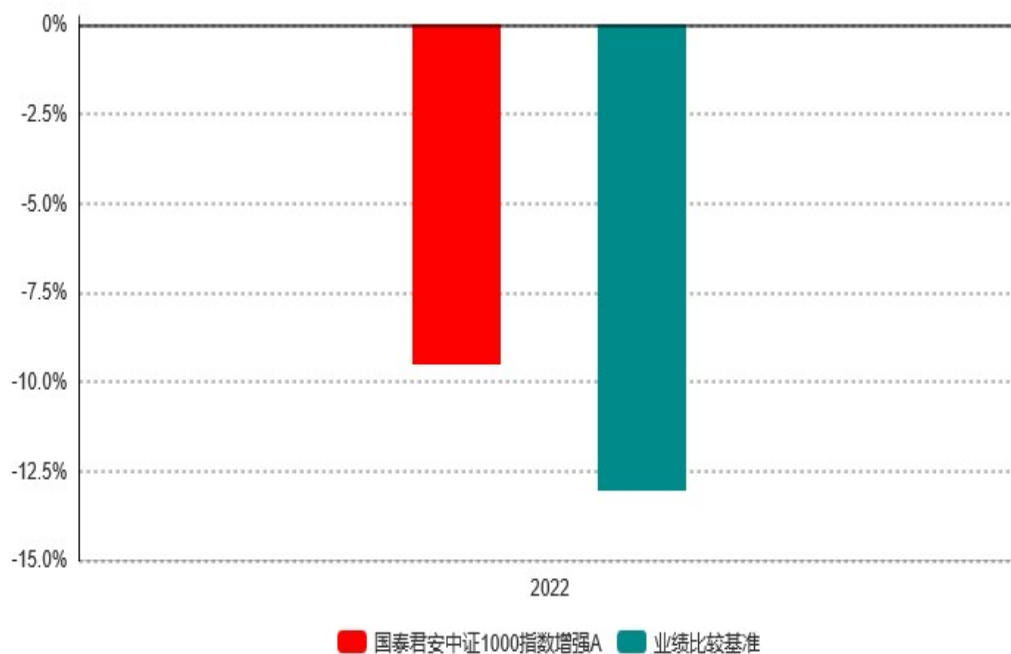
- 注：1、本基金于2022年08月16日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰君安中证1000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

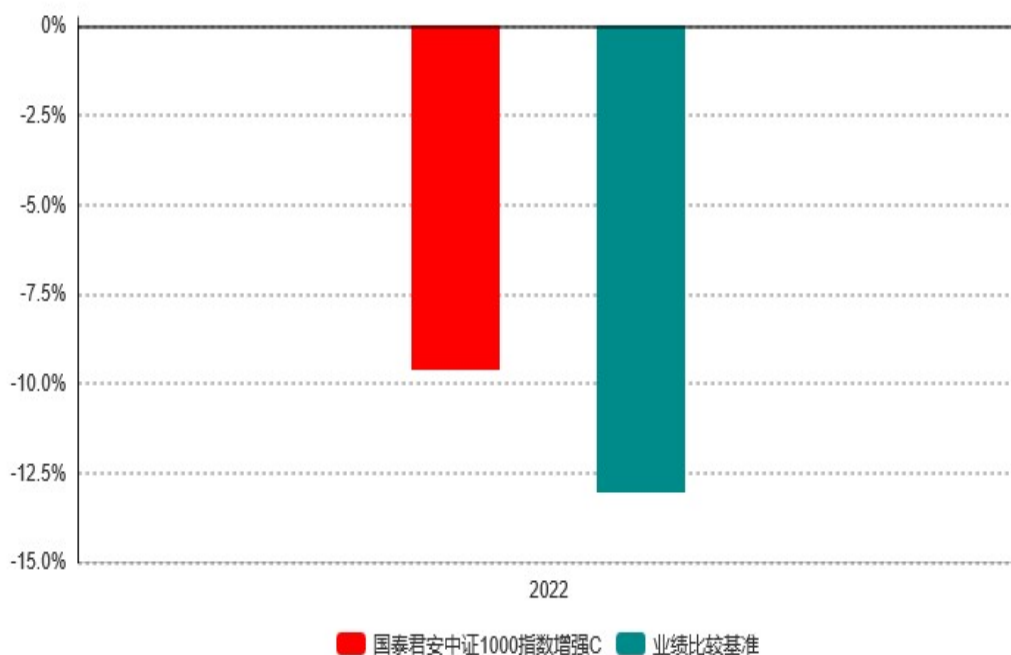


注：1、本基金于2022年08月16日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2022年按实际存续期计算。



注：2022年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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

上海国泰君安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2022年12月31日，本基金管理人共管理了30只公开募集证券投资基金：

国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安君得盛债券型证券投资基金、国泰君安中证500指数增强型证券投资基金、国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金、国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金、国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰君安君得盈债券型证券投资基金、国泰君安君得诚混合型证券投资基金、国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、

国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金、国泰君安稳债双利6个月持有期债券型发起式证券投资基金、国泰君安品质生活混合型发起式证券投资基金、国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金、国泰君安中证1000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、国泰君安临港创新智造产业园封闭式基础设施证券投资基金、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、国泰君安善元稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰君安善吾养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金、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90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金。

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	本基金基金经理，国泰君安中证500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，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，现任量化投资部（公募）部门总经理。	2022-08-16	-	11年	胡崇海，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。
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.3 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 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

在俄乌冲突、美联储加息和国内疫情等诸多因素的影响下,国内A股市场前四个月震荡下行,市场在4月底见底后在高景气度的新能源等板块的带动下,迎来一波强劲的反弹,而三季度在复杂多变的国际政治和经济形势影响下走出了逐月往下的弱势调整行情,基本回吐了二季度的反弹幅度,进入四季度之后行业和风格等又迎来较大的逆转,大盘股在北向资金的带领下率先企稳,存量资金博弈的市场环境下行业和风格轮动速度较快,投资难度较大,综合来看体现出典型的熊市特征。中证1000指数虽然估值已经处于历史低位,依然难以幸免,年内跌幅也大大超出了我们年初最悲观的预期。不过,随着疫情后经济的全面复苏,我们对国内经济的韧性和活力依然很有信心,上市公司作为中国经济实体中最有竞争力的企业代表,应当体现出更强的增长动力,我们相信市场最艰难的阶段已经过去。

分行业来看,煤炭、石油石化和有色金属等资源板块是少数连续两年都相对强势的行业,而电子元件和计算机等信创板块在行业不景气的经济周期之下进入了杀估值的阶段,不过新能源等热门赛道在政策和业绩双击的背景下也有较强的阶段性行情。另一方面,餐饮旅游、交运和房地产等行情率先开始触底回升,而非银、家电和医药等已经连续两年表现弱势,当前行业估值处于历史较低分位数,后市有望迎来反转行情。从主要宽基指数来看,除了双创相关指数跌幅特别大外,其它宽基指数跌幅相差无几,不过从两年的维度来看,中证1000指数整体表现依然居前,仅次于市值更小的国证2000指数。

从主要风险因子的走势来看,4月、9月和12月等市场跌幅较大的阶段,大盘股表现出较强的抗跌性,其余时间大部分都是中小盘股占优,基本延续了去年的风格,从更长周期规模因子的维度来看,从16年底至21年初的大盘股占优的行情至此已经回吐了一半以上。动量因子年内整体延续历史常态表现,但从最后一个季度开始显著失效,期间股票的反转效应得到进一步强化。从风险因子的表现来看,今年市场风格的季节性效应较强。另一方面,从大类因子的角度来分析,全年维度估值因子的表现强于去年,回归到历史常态表现,而成长因子和分析师情绪因子则进一步走弱,低估值始终是今年投资的主线,高成长的“赛道股”经过三季度的大幅反弹后在年底迎来较为剧烈的调整,但得益于上半年基本面因子的强势表现,全年来看基本面因子的整体表现依然符合历史规律,并无失效的趋势。相比之下,高频因子从9月份开始受制于市场交投低迷,综合信号强度明显减弱,不过其拥挤程度从12月份开始已有所缓解,依然有部分传统的高频因子失效明显,也体现出了行业的竞争态势正在加剧。我们依然延续一贯的稳中求胜的投资理

念，市场风格不适应的阶段尽量减少回撤，在这样的理念之下8月至今的累计超额在年底依然收在最高点附近。根据我们对年内投资组合的业绩因子来看，在行业配置上略有亏损，在主要市场风险因子暴露上的整体收益也十分有限，超额收益主要90%依然均来自于模型的选股能力，即纯正的Alpha部分。为了进一步强化模型的选股能力，在未来的研究方面我们将加大了另类因子的挖掘力度，在扩充有效因子库的基础上根据市场特征的演化有针对性地改进了模型，提升了模型整体的性能。

从中证1000指数当前的估值水平来看，截至12月底其加权PB整体PB分别在2.4倍和2.2倍左右，依然处于历史较为低估的水平，在历史上的分位数低于10%，而用PE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，处于历史分位数8%之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。今年市场整体表现受整体宏观环境的影响比较大，但并不影响我们之前对中证1000指数中长期周期的逻辑，未来随着疫情后经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个高成长性、盈利增长潜力巨大，行业分布均匀的中小盘宽基指数，中证1000指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证1000指数增强A基金份额净值为0.9051元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.49%，同期业绩比较基准收益率为-13.06%；截至报告期末国泰君安中证1000指数增强C基金份额净值为0.9037元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.63%，同期业绩比较基准收益率为-13.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计，未来一年市场较难回归“核心资产”为主的大盘股行情，依然会延续当前风格切换较快、市场热点较为分散的特点，相对于主观选股来说，量化投资依然有较大的可为空间和较高的性价比。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，常年来我们坚守整体一贯的投资体系和理念，也尽可能以此稳定投资者在不同市场环境下对我们超额收益率的预期。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1000指数进行增强，得益于基本面量化和高频量价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾两者的情况下追求稳健的Alpha。随着今年在大幅度扩充有效因子库和有针对性改进模型底层逻辑之后，我们坚

信模型能以更有效地方式输出稳定的超额收益。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、以概率取胜的方式增厚投资收益，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1000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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的约定进行收益分配。

4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-上海国泰君安证券资产管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,上海国泰君安证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，上海国泰君安证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第24027号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称"国泰君安中证1000指数增强")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年8月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了国泰君安中证1000指数增强2022年12月31日的财务状况以及2022年8月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行

	<p>了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰君安中证1000指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰君安中证1000指数增强的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰君安中证1000指数增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰君安中证1000指数增强、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督国泰君安中证1000指数增强的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以</p>

	<p>下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰君安中证1000指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安中证1000指数增强不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛竞	段黄霖
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2023-03-24	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	34,006,559.91
结算备付金		4,351,911.30
存出保证金		1,475,232.00
交易性金融资产	7.4.7.2	489,082,299.73
其中：股票投资		489,082,299.73
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		169,457.01
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-

资产总计		529,085,459.95
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		836,295.84
应付管理人报酬		449,025.65
应付托管费		67,353.83
应付销售服务费		79,917.68
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	7.4.7.6	151,095.01
负债合计		1,583,688.01
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	583,221,036.84
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-55,719,264.90
净资产合计		527,501,771.94
负债和净资产总计		529,085,459.95

注：1.报告截止日2022年12月31日，基金份额总额583,221,036.84份，其中A类基金份额净值0.9051元，A类基金份额309,802,278.63份；C类基金份额净值0.9037元，C类基金份额273,418,758.21份。

2.本财务报表的实际编制期间为2022年8月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年08月16日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
一、营业总收入		-52,727,131.14
1.利息收入		210,166.59
其中：存款利息收入	7.4.7.9	210,166.59
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）		-39,255,205.04
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-38,667,848.94
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-726,034.49
股利收益	7.4.7.16	138,678.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-13,767,816.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	85,723.58
减：二、营业总支出		2,963,002.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,112,096.65

2. 托管费	7.4.10.2.2	316,814.49
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	381,993.31
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	7.4.7.19	152,097.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-55,690,133.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-55,690,133.41
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-55,690,133.41

注：本基金合同于2022年08月16日生效，无上年度可比区间数据。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	609,392,211.62	-	-	609,392,211.62

值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,171,174.78	-	-55,719,264.90	-81,890,439.68
(一)、综合收益总额	-	-	-55,690,133.41	-55,690,133.41
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-26,171,174.78	-	-29,131.49	-26,200,306.27
其中：1.基金申购款	46,845,172.90	-	-3,944,917.63	42,900,255.27
2.基金赎回款	-73,016,347.68	-	3,915,786.14	-69,100,561.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	583,221,036.84	-	-55,719,264.90	527,501,771.94

注：本基金合同于2022年08月16日生效，无上年度可比区间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

谢乐斌

陶耿

茹建江

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)已获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]983号《关于准予国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金注册的批复》,由上海国泰君安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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金自2022年8月1日至2022年8月12日共募集609,312,722.10元(不含认购资金利息),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(2022)验字第0724号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》于2022年8月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额609,392,211.62份基金份额,其中认购资金利息折合79,489.52份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证1000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券(包括存托凭证、下同)、备选成份券(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、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、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、存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%,投资于中证1000指数成份券及其备选成份券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和股指期货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。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行适当程序后,以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为:中证1000指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司于2023年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年8月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的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2022年12月31日的财务状况以及2022年8月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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2022年8月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴

纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 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确认。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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《中国证监会关于

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。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。对基金从上市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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
活期存款	13,498,189.70
等于：本金	13,495,870.13
加：应计利息	2,319.57
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	20,508,370.21
等于：本金	20,505,675.72
加：应计利息	2,694.49
减：坏账准备	-
合计	34,006,559.91

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	502,702,557.59	-	489,082,299.73	-13,620,257.86
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	502,702,557.59	-	489,082,299.73	-13,620,257.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	9,982,438.41	-	-	-
--股指期货	9,982,438.41	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,982,438.41	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2306	IM2306	8.00	9,834,880.00	-147,558.41
合计				-147,558.41
减：可抵销 期货暂收 款				-147,558.41
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,095.01
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	150,000.00
合计	151,095.01

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 国泰君安中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安中证1000指数增强 A)	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	332,110,120.07	332,110,120.07
本期申购	11,264,407.67	11,264,407.67
本期赎回（以“-”号填列）	-33,572,249.11	-33,572,249.11
本期末	309,802,278.63	309,802,278.63

7.4.7.7.2 国泰君安中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安中证1000指数增强 C)	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31 日
-----------------------------	--

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	277,282,091.55	277,282,091.55
本期申购	35,580,765.23	35,580,765.23
本期赎回（以“-”号填列）	-39,444,098.57	-39,444,098.57
本期末	273,418,758.21	273,418,758.21

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2022年08月01日至2022年08月12日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币609,312,722.10元，折合为609,312,722.10份基金份额(其中A类基金份额332,068,476.55份，C类基金份额277,244,245.55份)。根据《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币79,489.52元在本基金成立后，折合为79,489.52份基金份额(其中A类基金份额41,643.52份，C类基金份额37,846.00份)，划入基金份额持有人账户。

3. 《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》、《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》及《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于2023年8月16日(基金合同生效日)至2023年11月15日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自2023年11月16日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 国泰君安中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (国泰君安中证1000指 数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-22,804,544.93	-7,821,144.73	-30,625,689.66
本期基金份额交易产 生的变动数	1,013,570.61	212,417.50	1,225,988.11
其中：基金申购款	-530,215.68	-162,782.40	-692,998.08
基金赎回款	1,543,786.29	375,199.90	1,918,986.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,790,974.32	-7,608,727.23	-29,399,701.55

7.4.7.8.2 国泰君安中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (国泰君安中证1000指 数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-19,117,772.21	-5,946,671.54	-25,064,443.75
本期基金份额交易产 生的变动数	-488,620.09	-766,499.51	-1,255,119.60
其中：基金申购款	-2,271,365.68	-980,553.87	-3,251,919.55
基金赎回款	1,782,745.59	214,054.36	1,996,799.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,606,392.30	-6,713,171.05	-26,319,563.35

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31 日
活期存款利息收入	87,770.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	91,660.11
结算备付金利息收入	30,736.20
其他	-
合计	210,166.59

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31 日
卖出股票成交总额	4,438,866,645.63

减：卖出股票成本总额	4,471,679,343.81
减：交易费用	5,855,150.76
买卖股票差价收入	-38,667,848.94

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

无。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
期货投资	-726,034.49

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	138,678.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	138,678.39

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-13,620,257.86
——股票投资	-13,620,257.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-147,558.41
——权证投资	-
——期货投资	-147,558.41
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	-13,767,816.27

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	85,723.58
合计	85,723.58

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日

审计费用	40,000.00
信息披露费	110,000.00
汇划手续费	1,737.82
其他费用	360.00
合计	152,097.82

7.4.7.20 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

关联方名称	与本基金的关系
国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）	基金管理人的股东、代销机构
上海国泰君安证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)	基金托管人

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
-------	--

	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	9,411,604,212.72	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31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
国泰君安证券股份 有限公司	670,908.08	100.00%	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,112,096.65

其中：支付销售机构的客户维护费	1,041,713.21
-----------------	--------------

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 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	316,814.49

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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		
	2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证1000指数增强 A	国泰君安中证1000指数增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	0.00	377,928.55	377,928.55
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	1,974.74	1,974.74
合计	0.00	379,903.29	379,903.29

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

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

7.4.10.5 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 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	13,498,189.70	87,770.28
国泰君安证券	20,508,370.21	91,660.11
合计	34,006,559.91	179,430.39

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688372	伟测科技	2022-10-19	6个月	新股锁定	61.49	81.20	2,383	146,530.67	193,499.60	-
688143	长盈通	2022-12-01	6个月	新股锁定	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08	-
301356	天振股份	2022-11-03	6个月	新股锁定	63.00	43.33	405	25,515.00	17,548.65	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6个月	新股锁定	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月	新股锁定	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月	新股锁定	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
600038	中直股份	2022-12-26	拟筹划重大资产重组	46.41	2023-01-10	51.05	18,200	847,171.46	844,662.00	-

注：本基金截至 2022 年 12 月 31 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，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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行中国农业银行股份有限公司，其他存款为国泰君安证券券商保证金，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2022年12月31日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 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2022年12月31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。

7.4.13.3.1 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%。

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7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 1 2 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,006,559.91	-	-	-	34,006,559.91
结算备付金	4,351,911.30	-	-	-	4,351,911.30
存出保证金	1,475,232.00	-	-	-	1,475,232.00
交易性金融资产	-	-	-	489,082,299.73	489,082,299.73
应收申购款	-	-	-	169,457.01	169,457.01
资产总计	39,833,703.21	-	-	489,251,756.74	529,085,459.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	836,295.84	836,295.84
应付管理人报酬	-	-	-	449,025.65	449,025.65
应付托管费	-	-	-	67,353.83	67,353.83
应付销售服务费	-	-	-	79,917.68	79,917.68
其他负债	-	-	-	151,095.01	151,095.01
负债总计	-	-	-	1,583,688.01	1,583,688.01
利率敏感度缺口	39,833,703.21	-	-	487,668,068.73	527,501,771.94

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	489,082,299.73	92.72
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	489,082,299.73	92.72

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2022年12月31日
第一层次	487,907,465.38
第二层次	844,662.00
第三层次	330,172.35
合计	489,082,299.73

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	287,723.21	287,723.21
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	42,449.14	42,449.14
其中：计入损益的利得或损失	-	42,449.14	42,449.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	330,172.35	330,172.35
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	42,449.14	42,449.14

于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投	330,172.35	平均价格亚式期权模型	预期年化波动	31.73%-19.05%	负相关

资			率		
---	--	--	---	--	--

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	489,082,299.73	92.44
	其中：股票	489,082,299.73	92.44
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	38,358,471.21	7.25
8	其他各项资产	1,644,689.01	0.31
9	合计	529,085,459.95	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	212,350.00	0.04
B	采矿业	5,556,860.00	1.05
C	制造业	225,612,155.57	42.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,477,077.40	1.80
E	建筑业	3,356,331.00	0.64
F	批发和零售业	12,582,644.34	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	5,464,198.00	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,914,103.10	4.53
J	金融业	2,666,956.20	0.51
K	房地产业	2,886,535.60	0.55
L	租赁和商务服务业	1,192,273.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	7,918,623.04	1.50
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	1,429,858.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,634,566.60	0.50
S	综合	-	-
	合计	304,904,531.85	57.80

8.2.2 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	148,608.00	0.03
B	采矿业	5,116,133.00	0.97

C	制造业	123,605,078.79	23.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,237,644.00	1.56
E	建筑业	1,566,385.00	0.30
F	批发和零售业	9,885,353.88	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	276,327.00	0.05
H	住宿和餐饮业	2,180,334.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,432,507.89	2.74
J	金融业	754,009.38	0.14
K	房地产业	4,246,831.10	0.81
L	租赁和商务服务业	2,013,102.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	4,186,943.84	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	4,295,654.00	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	758,108.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	1,077,838.00	0.20
S	综合	1,396,910.00	0.26
	合计	184,177,767.88	34.92

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 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(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	---------	---------------

1	600114	东睦股份	524,500	4,458,250.00	0.85
2	300725	药石科技	47,600	3,831,800.00	0.73
3	000543	皖能电力	825,280	3,697,254.40	0.70
4	603612	索通发展	124,900	3,249,898.00	0.62
5	603328	依顿电子	483,500	3,137,915.00	0.59
6	603876	鼎胜新材	74,200	3,045,168.00	0.58
7	002036	联创电子	233,100	2,883,447.00	0.55
8	600210	紫江企业	572,300	2,861,500.00	0.54
9	688556	高测股份	36,919	2,769,663.38	0.53
10	002746	仙坛股份	292,700	2,681,132.00	0.51
11	603305	旭升集团	81,300	2,621,112.00	0.50
12	301039	中集车辆	318,300	2,536,851.00	0.48
13	600963	岳阳林纸	462,900	2,522,805.00	0.48
14	002276	万马股份	295,500	2,437,875.00	0.46
15	000860	顺鑫农业	79,861	2,381,455.02	0.45
16	688315	诺禾致源	88,959	2,347,628.01	0.45
17	300035	中科电气	113,500	2,335,830.00	0.44
18	300352	北信源	566,800	2,312,544.00	0.44
19	600073	上海梅林	285,700	2,271,315.00	0.43
20	601567	三星医疗	168,200	2,267,336.00	0.43
21	300232	洲明科技	411,100	2,256,939.00	0.43
22	002664	信质集团	171,900	2,250,171.00	0.43
23	603906	龙蟠科技	96,700	2,238,605.00	0.42
24	600797	浙大网新	365,500	2,138,175.00	0.41
25	688778	厦钨新能	27,136	2,107,924.48	0.40
26	603920	世运电路	146,400	2,105,232.00	0.40
27	600685	中船防务	101,200	2,100,912.00	0.40
28	002004	华邦健康	411,400	2,098,140.00	0.40
29	603299	苏盐井神	210,200	2,095,694.00	0.40
30	002463	沪电股份	175,600	2,089,640.00	0.40
31	003021	兆威机电	43,400	2,086,238.00	0.40

32	002675	东诚药业	125,900	2,084,904.00	0.40
33	600391	航发科技	116,800	2,075,536.00	0.39
34	300777	中简科技	41,400	2,034,810.00	0.39
35	000933	神火股份	135,800	2,031,568.00	0.39
36	601886	江河集团	261,400	2,023,236.00	0.38
37	688559	海目星	34,785	2,011,964.40	0.38
38	600929	雪天盐业	250,600	2,007,306.00	0.38
39	300377	赢时胜	242,700	1,992,567.00	0.38
40	003040	楚天龙	113,200	1,974,208.00	0.37
41	000682	东方电子	240,300	1,932,012.00	0.37
42	603301	振德医疗	49,200	1,872,060.00	0.35
43	300502	新易盛	78,600	1,866,750.00	0.35
44	000758	中色股份	389,800	1,851,550.00	0.35
45	002984	森麒麟	59,500	1,832,005.00	0.35
46	600105	永鼎股份	536,300	1,828,783.00	0.35
47	603108	润达医疗	180,300	1,822,833.00	0.35
48	600017	日照港	646,300	1,822,566.00	0.35
49	688128	中国电研	106,158	1,813,178.64	0.34
50	300567	精测电子	36,100	1,812,220.00	0.34
51	601137	博威合金	121,800	1,803,858.00	0.34
52	600559	老白干酒	63,900	1,759,167.00	0.33
53	688516	奥特维	8,749	1,758,549.00	0.33
54	002697	红旗连锁	306,300	1,724,469.00	0.33
55	300315	掌趣科技	535,600	1,719,276.00	0.33
56	002649	博彦科技	165,600	1,704,024.00	0.32
57	601949	中国出版	328,500	1,639,215.00	0.31
58	600872	中炬高新	43,900	1,618,593.00	0.31
59	600971	恒源煤电	223,500	1,600,260.00	0.30
60	600458	时代新材	176,600	1,592,932.00	0.30
61	300130	新国都	130,779	1,578,502.53	0.30
62	605507	国邦医药	59,600	1,577,612.00	0.30

63	002206	海利得	264,100	1,576,677.00	0.30
64	688518	联赢激光	53,391	1,559,551.11	0.30
65	002324	普利特	96,800	1,548,800.00	0.29
66	002421	达实智能	446,500	1,544,890.00	0.29
67	002258	利尔化学	85,800	1,540,968.00	0.29
68	002182	云海金属	72,500	1,529,750.00	0.29
69	002312	川发龙蟒	145,100	1,526,452.00	0.29
70	003012	东鹏控股	194,200	1,526,412.00	0.29
71	600710	苏美达	258,781	1,521,632.28	0.29
72	688148	芳源股份	103,961	1,516,790.99	0.29
73	300114	中航电测	147,700	1,515,402.00	0.29
74	600312	平高电气	191,400	1,513,974.00	0.29
75	300319	麦捷科技	192,300	1,496,094.00	0.28
76	603960	克来机电	83,100	1,473,363.00	0.28
77	002085	万丰奥威	245,200	1,458,940.00	0.28
78	603529	爱玛科技	31,800	1,458,666.00	0.28
79	600037	歌华有线	179,000	1,457,060.00	0.28
80	000823	超声电子	156,401	1,452,965.29	0.28
81	603801	志邦家居	53,900	1,448,832.00	0.27
82	300887	谱尼测试	44,181	1,440,742.41	0.27
83	002946	新乳业	108,000	1,428,840.00	0.27
84	000539	粤电力A	256,800	1,425,240.00	0.27
85	300803	指南针	31,160	1,424,635.20	0.27
86	000811	冰轮环境	128,300	1,424,130.00	0.27
87	600330	天通股份	134,500	1,417,630.00	0.27
88	002662	京威股份	424,600	1,396,934.00	0.26
89	603129	春风动力	12,400	1,395,248.00	0.26
90	000517	荣安地产	466,348	1,375,726.60	0.26
91	603118	共进股份	172,700	1,372,965.00	0.26
92	002100	天康生物	164,900	1,370,319.00	0.26
93	002139	拓邦股份	130,100	1,349,137.00	0.26

94	000710	贝瑞基因	117,800	1,344,098.00	0.25
95	600916	中国黄金	104,672	1,323,054.08	0.25
96	002727	一心堂	41,798	1,317,054.98	0.25
97	688037	芯源微	8,260	1,292,690.00	0.25
98	000950	重药控股	253,000	1,285,240.00	0.24
99	002545	东方铁塔	152,400	1,263,396.00	0.24
100	300616	尚品宅配	64,232	1,261,516.48	0.24
101	000915	华特达因	27,700	1,260,350.00	0.24
102	603609	禾丰股份	105,700	1,251,488.00	0.24
103	000030	富奥股份	281,900	1,240,360.00	0.24
104	603690	至纯科技	32,425	1,226,962.00	0.23
105	002055	得润电子	142,100	1,224,902.00	0.23
106	688499	利元亨	7,646	1,203,327.48	0.23
107	002967	广电计量	71,500	1,199,770.00	0.23
108	002446	盛路通信	124,500	1,190,220.00	0.23
109	002216	三全食品	63,940	1,183,529.40	0.22
110	000767	晋控电力	348,500	1,181,415.00	0.22
111	688007	光峰科技	47,408	1,178,562.88	0.22
112	300438	鹏辉能源	15,100	1,177,649.00	0.22
113	000550	江铃汽车	86,300	1,159,009.00	0.22
114	002044	美年健康	187,300	1,148,149.00	0.22
115	301090	华润材料	114,100	1,147,846.00	0.22
116	000049	德赛电池	26,200	1,139,176.00	0.22
117	605111	新洁能	14,600	1,132,668.00	0.21
118	300151	昌红科技	58,500	1,129,635.00	0.21
119	600575	淮河能源	468,600	1,129,326.00	0.21
120	600285	羚锐制药	85,603	1,116,263.12	0.21
121	600057	厦门象屿	105,500	1,083,485.00	0.21
122	600742	一汽富维	129,100	1,079,276.00	0.20
123	002006	精功科技	43,100	1,077,500.00	0.20
124	600422	昆药集团	73,500	1,037,820.00	0.20

125	601952	苏垦农发	84,100	995,744.00	0.19
126	301078	孩子王	76,600	991,970.00	0.19
127	600750	江中药业	68,500	989,825.00	0.19
128	300395	菲利华	17,720	974,600.00	0.18
129	002390	信邦制药	207,000	972,900.00	0.18
130	601921	浙版传媒	130,024	962,177.60	0.18
131	300118	东方日升	38,300	950,606.00	0.18
132	002733	雄韬股份	54,100	927,815.00	0.18
133	603505	金石资源	23,300	923,146.00	0.18
134	300101	振芯科技	37,400	916,300.00	0.17
135	600657	信达地产	176,100	905,154.00	0.17
136	002020	京新药业	72,600	884,268.00	0.17
137	002317	众生药业	32,700	882,573.00	0.17
138	002461	珠江啤酒	109,900	880,299.00	0.17
139	300394	天孚通信	34,400	872,040.00	0.17
140	300031	宝通科技	62,800	868,524.00	0.16
141	600305	恒顺醋业	70,400	866,624.00	0.16
142	300527	中船应急	130,700	866,541.00	0.16
143	002126	银轮股份	69,600	863,736.00	0.16
144	688202	美迪西	3,958	846,576.62	0.16
145	300428	立中集团	33,900	839,025.00	0.16
146	688106	金宏气体	44,636	837,371.36	0.16
147	600481	双良节能	64,400	833,336.00	0.16
148	601126	四方股份	56,222	820,841.20	0.16
149	300602	飞荣达	56,600	814,474.00	0.15
150	600125	铁龙物流	148,500	810,810.00	0.15
151	603565	中谷物流	55,700	809,878.00	0.15
152	002777	久远银海	53,300	799,500.00	0.15
153	688139	海尔生物	12,600	797,580.00	0.15
154	601222	林洋能源	92,058	790,778.22	0.15
155	300748	金力永磁	26,600	778,316.00	0.15

156	600120	浙江东方	216,800	773,976.00	0.15
157	600129	太极集团	25,700	772,542.00	0.15
158	300007	汉威科技	45,500	768,950.00	0.15
159	002261	拓维信息	115,200	763,776.00	0.14
160	300657	弘信电子	69,200	760,508.00	0.14
161	688676	金盘科技	20,990	759,418.20	0.14
162	603636	南威软件	55,200	758,448.00	0.14
163	000028	国药一致	22,800	749,892.00	0.14
164	603583	捷昌驱动	29,218	746,812.08	0.14
165	603179	新泉股份	19,300	742,857.00	0.14
166	603018	华设集团	97,600	739,808.00	0.14
167	002597	金禾实业	22,600	734,500.00	0.14
168	000921	海信家电	55,400	729,618.00	0.14
169	600986	浙文互联	144,600	721,554.00	0.14
170	601908	京运通	109,600	720,072.00	0.14
171	603368	柳药集团	38,200	713,194.00	0.14
172	603008	喜临门	24,900	710,895.00	0.13
173	600761	安徽合力	54,000	710,100.00	0.13
174	002518	科士达	12,300	708,480.00	0.13
175	300054	鼎龙股份	33,000	702,570.00	0.13
176	600211	西藏药业	19,400	696,848.00	0.13
177	002833	弘亚数控	56,036	690,923.88	0.13
178	600508	上海能源	47,600	682,108.00	0.13
179	600602	云赛智联	77,700	676,767.00	0.13
180	002539	云图控股	60,500	672,760.00	0.13
181	002130	沃尔核材	103,861	669,903.45	0.13
182	000652	泰达股份	164,600	663,338.00	0.13
183	300439	美康生物	55,900	654,030.00	0.12
184	300856	科思股份	12,500	651,875.00	0.12
185	600446	金证股份	60,900	626,661.00	0.12
186	000795	英洛华	95,504	619,820.96	0.12

187	300183	东软载波	51,100	615,755.00	0.12
188	600933	爱柯迪	33,500	610,035.00	0.12
189	300497	富祥药业	46,200	609,840.00	0.12
190	600308	华泰股份	120,000	608,400.00	0.12
191	688383	新益昌	6,400	607,232.00	0.12
192	300735	光弘科技	67,000	594,960.00	0.11
193	600370	三房巷	194,700	589,941.00	0.11
194	300679	电连技术	15,900	588,300.00	0.11
195	002643	万润股份	40,100	587,866.00	0.11
196	600578	京能电力	178,900	581,425.00	0.11
197	002605	姚记科技	41,200	578,860.00	0.11
198	603043	广州酒家	22,000	568,040.00	0.11
199	300767	震安科技	12,100	565,675.00	0.11
200	300123	亚光科技	93,500	552,585.00	0.10
201	300382	斯莱克	29,000	547,520.00	0.10
202	002051	中工国际	69,200	544,604.00	0.10
203	603348	文灿股份	9,200	529,644.00	0.10
204	300487	蓝晓科技	7,601	528,953.59	0.10
205	603279	景津装备	17,700	521,796.00	0.10
206	600496	精工钢构	129,800	512,710.00	0.10
207	300119	瑞普生物	25,700	478,277.00	0.09
208	300219	鸿利智汇	69,200	462,256.00	0.09
209	000657	中钨高新	28,900	457,776.00	0.09
210	601311	骆驼股份	55,800	455,328.00	0.09
211	600098	广州发展	81,500	452,325.00	0.09
212	002302	西部建设	62,000	449,500.00	0.09
213	001696	宗申动力	74,900	444,906.00	0.08
214	600850	电科数字	22,100	443,768.00	0.08
215	301071	力量钻石	3,700	440,855.00	0.08
216	002484	江海股份	19,600	438,452.00	0.08
217	688050	爱博医疗	1,900	438,330.00	0.08

218	000718	苏宁环球	132,600	437,580.00	0.08
219	002913	奥士康	17,100	416,727.00	0.08
220	300687	赛意信息	14,100	415,950.00	0.08
221	300034	钢研高纳	9,000	412,560.00	0.08
222	000601	韶能股份	85,600	402,320.00	0.08
223	300109	新开源	16,600	401,720.00	0.08
224	002453	华软科技	38,100	400,050.00	0.08
225	000600	建投能源	74,800	392,700.00	0.07
226	300634	彩讯股份	25,400	387,350.00	0.07
227	688586	江航装备	23,406	381,517.80	0.07
228	600483	福能股份	35,900	379,822.00	0.07
229	600583	海油工程	62,300	377,538.00	0.07
230	000966	长源电力	80,700	373,641.00	0.07
231	000893	亚钾国际	13,400	364,212.00	0.07
232	000791	甘肃电投	64,700	341,616.00	0.06
233	600284	浦东建设	50,600	341,044.00	0.06
234	300298	三诺生物	10,000	337,300.00	0.06
235	002425	凯撒文化	70,500	334,875.00	0.06
236	002291	遥望科技	25,200	327,600.00	0.06
237	000627	天茂集团	103,000	325,480.00	0.06
238	601975	招商南油	82,600	325,444.00	0.06
239	300134	大富科技	41,300	320,488.00	0.06
240	603599	广信股份	10,900	320,460.00	0.06
241	000059	华锦股份	46,400	315,520.00	0.06
242	603881	数据港	13,300	312,949.00	0.06
243	000885	城发环境	32,100	303,987.00	0.06
244	002635	安洁科技	24,100	297,635.00	0.06
245	300079	数码视讯	61,000	292,190.00	0.06
246	002741	光华科技	16,131	291,164.55	0.06
247	600682	南京新百	31,700	289,421.00	0.05
248	002011	盾安环境	22,000	288,860.00	0.05

249	300143	盈康生命	27,700	281,709.00	0.05
250	000423	东阿阿胶	6,800	276,760.00	0.05
251	002895	川恒股份	10,600	276,342.00	0.05
252	300476	胜宏科技	21,300	275,622.00	0.05
253	603298	杭叉集团	16,100	270,641.00	0.05
254	600248	陕西建工	63,500	266,700.00	0.05
255	603387	基蛋生物	21,100	263,750.00	0.05
256	688366	昊海生科	2,700	263,358.00	0.05
257	688127	蓝特光学	15,059	239,889.87	0.05
258	600184	光电股份	20,102	225,142.40	0.04
259	000650	仁和药业	34,900	216,031.00	0.04
260	300761	立华股份	6,200	212,350.00	0.04
261	002768	国恩股份	7,300	211,846.00	0.04
262	600835	上海机电	18,300	205,326.00	0.04
263	688707	振华新材	4,566	205,241.70	0.04
264	600720	祁连山	20,500	203,565.00	0.04
265	300791	仙乐健康	5,400	198,558.00	0.04
266	002106	莱宝高科	25,558	196,285.44	0.04
267	603959	百利科技	17,100	180,747.00	0.03
268	600874	创业环保	29,100	177,219.00	0.03
269	000036	华联控股	41,500	168,075.00	0.03
270	002123	梦网科技	14,400	161,712.00	0.03
271	688598	金博股份	708	155,391.84	0.03
272	600590	泰豪科技	26,300	152,803.00	0.03
273	600740	山西焦化	28,100	152,021.00	0.03
274	301015	百洋医药	5,300	126,352.00	0.02
275	605123	派克新材	900	119,610.00	0.02
276	600420	国药现代	13,100	119,210.00	0.02
277	600456	宝钛股份	2,800	114,408.00	0.02
278	300075	数字政通	6,400	112,192.00	0.02
279	300910	瑞丰新材	900	110,979.00	0.02

280	688388	嘉元科技	2,400	107,640.00	0.02
281	000917	电广传媒	20,045	103,833.10	0.02
282	603128	华贸物流	9,600	103,104.00	0.02
283	002991	甘源食品	1,300	99,177.00	0.02
284	601375	中原证券	26,400	96,096.00	0.02
285	603936	博敏电子	7,600	92,872.00	0.02
286	300726	宏达电子	2,095	92,473.30	0.02
287	000968	蓝焰控股	10,600	92,114.00	0.02
288	300346	南大光电	3,000	87,150.00	0.02
289	002287	奇正藏药	3,800	86,830.00	0.02
290	603439	贵州三力	6,200	85,064.00	0.02
291	002400	省广集团	18,900	80,892.00	0.02
292	000910	大亚圣象	9,300	79,236.00	0.02
293	001213	中铁特货	18,300	79,056.00	0.01
294	300772	运达股份	5,300	78,811.00	0.01
295	600888	新疆众和	9,200	75,348.00	0.01
296	600995	南网储能	5,000	72,100.00	0.01
297	600548	深高速	7,100	63,758.00	0.01
298	601702	华峰铝业	4,200	62,790.00	0.01
299	300775	三角防务	1,500	57,000.00	0.01
300	600776	东方通信	6,100	55,876.00	0.01
301	000048	京基智农	3,016	53,835.60	0.01
302	688425	铁建重工	13,330	52,653.50	0.01
303	300127	银河磁体	3,200	48,608.00	0.01
304	300590	移为通信	4,200	41,202.00	0.01
305	603338	浙江鼎力	800	38,280.00	0.01
306	002906	华阳集团	1,100	36,542.00	0.01
307	002918	蒙娜丽莎	2,000	35,960.00	0.01
308	600990	四创电子	1,200	35,760.00	0.01
309	600158	中体产业	3,800	33,174.00	0.01
310	300894	火星人	1,300	32,864.00	0.01

311	000019	深粮控股	4,200	31,542.00	0.01
312	002891	中宠股份	1,400	31,234.00	0.01
313	002517	恺英网络	4,600	30,176.00	0.01
314	000603	盛达资源	2,400	30,144.00	0.01
315	603300	华铁应急	4,400	27,896.00	0.01
316	600151	航天机电	3,300	26,895.00	0.01
317	605009	豪悦护理	500	25,935.00	0.00
318	002839	张家港行	5,600	25,816.00	0.00
319	600612	老凤祥	600	25,680.00	0.00
320	300393	中来股份	1,700	25,194.00	0.00
321	603313	梦百合	2,300	24,380.00	0.00
322	603071	物产环能	1,400	22,652.00	0.00
323	002437	誉衡药业	8,300	21,082.00	0.00
324	603093	南华期货	2,300	20,953.00	0.00
325	300326	凯利泰	2,500	18,000.00	0.00
326	300900	广联航空	600	17,238.00	0.00
327	000507	珠海港	2,900	16,269.00	0.00
328	600993	马应龙	700	15,820.00	0.00
329	688268	华特气体	131	9,726.75	0.00
330	688711	宏微科技	50	4,640.00	0.00
331	688408	中信博	38	3,739.20	0.00
332	688608	恒玄科技	31	3,534.00	0.00
333	688198	佰仁医疗	20	2,580.00	0.00
334	688066	航天宏图	10	855.00	0.00
335	688166	博瑞医药	33	744.81	0.00
336	002837	英维克	7	233.17	0.00
337	688575	亚辉龙	10	196.50	0.00

8.3.2 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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例(%)
1	600469	风神股份	712,700	3,342,563.00	0.63
2	600501	航天晨光	292,000	3,206,160.00	0.61
3	000756	新华制药	88,900	2,675,890.00	0.51
4	300739	明阳电路	198,400	2,555,392.00	0.48
5	600732	爱旭股份	66,100	2,499,902.00	0.47
6	600731	湖南海利	330,100	2,462,546.00	0.47
7	605138	盛泰集团	225,300	2,424,228.00	0.46
8	300207	欣旺达	112,000	2,368,800.00	0.45
9	603998	方盛制药	295,100	2,363,751.00	0.45
10	300194	福安药业	635,400	2,287,440.00	0.43
11	688468	科美诊断	238,816	2,261,587.52	0.43
12	688658	悦康药业	116,192	2,244,829.44	0.43
13	300861	美畅股份	44,300	2,177,788.00	0.41
14	300043	星辉娱乐	717,600	2,131,272.00	0.40
15	603708	家家悦	157,500	1,982,925.00	0.38
16	600525	长园集团	414,520	1,939,953.60	0.37
17	603890	春秋电子	209,700	1,916,658.00	0.36
18	603136	天目湖	68,700	1,865,205.00	0.35
19	300642	透景生命	88,400	1,837,836.00	0.35
20	300448	浩云科技	369,300	1,728,324.00	0.33
21	301096	百诚医药	24,400	1,666,764.00	0.32
22	300100	双林股份	226,500	1,660,245.00	0.31
23	600526	菲达环保	288,400	1,554,476.00	0.29
24	002540	亚太科技	306,600	1,554,462.00	0.29
25	600629	华建集团	351,700	1,543,963.00	0.29
26	002956	西麦食品	102,700	1,527,149.00	0.29
27	002082	万邦德	172,500	1,521,450.00	0.29
28	300231	银信科技	208,700	1,521,423.00	0.29
29	300624	万兴科技	51,400	1,509,104.00	0.29
30	300441	鲍斯股份	274,856	1,497,965.20	0.28

31	600626	申达股份	415,800	1,496,880.00	0.28
32	000589	贵州轮胎	311,300	1,491,127.00	0.28
33	605599	菜百股份	143,200	1,457,776.00	0.28
34	688599	天合光能	22,480	1,433,324.80	0.27
35	000551	创元科技	163,000	1,396,910.00	0.26
36	603939	益丰药房	21,500	1,372,560.00	0.26
37	300115	长盈精密	132,000	1,363,560.00	0.26
38	002444	巨星科技	71,600	1,358,968.00	0.26
39	000026	飞亚达	129,700	1,354,068.00	0.26
40	600415	小商品城	253,500	1,328,340.00	0.25
41	600133	东湖高新	239,300	1,316,150.00	0.25
42	600754	锦江酒店	22,500	1,312,875.00	0.25
43	688819	天能股份	35,674	1,310,662.76	0.25
44	002074	国轩高科	45,300	1,305,999.00	0.25
45	300787	海能实业	47,300	1,285,141.00	0.24
46	600479	千金药业	132,900	1,275,840.00	0.24
47	002632	道明光学	197,200	1,258,136.00	0.24
48	600236	桂冠电力	213,400	1,229,184.00	0.23
49	600207	安彩高科	196,400	1,227,500.00	0.23
50	002938	鹏鼎控股	44,200	1,212,848.00	0.23
51	600807	济南高新	353,800	1,202,920.00	0.23
52	600690	海尔智家	49,100	1,200,986.00	0.23
53	605196	华通线缆	172,000	1,200,560.00	0.23
54	000729	燕京啤酒	112,400	1,193,688.00	0.23
55	002788	鹭燕医药	142,900	1,190,357.00	0.23
56	002705	新宝股份	69,600	1,158,840.00	0.22
57	300381	溢多利	151,900	1,157,478.00	0.22
58	300002	神州泰岳	263,300	1,142,722.00	0.22
59	300943	春晖智控	93,056	1,123,185.92	0.21
60	600795	国电电力	256,500	1,095,255.00	0.21
61	000975	银泰黄金	99,000	1,092,960.00	0.21

62	600699	均胜电子	77,100	1,083,255.00	0.21
63	603199	九华旅游	38,100	1,083,183.00	0.21
64	601899	紫金矿业	107,700	1,077,000.00	0.20
65	300547	川环科技	73,700	1,064,228.00	0.20
66	000922	佳电股份	117,000	1,049,490.00	0.20
67	002338	奥普光电	47,000	1,047,630.00	0.20
68	300314	戴维医疗	80,300	1,042,294.00	0.20
69	603178	圣龙股份	106,800	1,029,552.00	0.20
70	600969	郴电国际	137,400	1,019,508.00	0.19
71	300316	晶盛机电	15,800	1,004,248.00	0.19
72	300009	安科生物	101,100	946,296.00	0.18
73	600638	新黄浦	167,300	945,245.00	0.18
74	002783	凯龙股份	111,200	944,088.00	0.18
75	603331	百达精工	79,000	919,560.00	0.17
76	300866	安克创新	15,500	918,685.00	0.17
77	002734	利民股份	97,600	913,536.00	0.17
78	603818	曲美家居	144,900	912,870.00	0.17
79	600702	舍得酒业	5,700	907,326.00	0.17
80	600343	航天动力	103,600	906,500.00	0.17
81	688505	复旦张江	107,338	896,272.30	0.17
82	605108	同庆楼	23,300	867,459.00	0.16
83	600397	安源煤业	285,200	864,156.00	0.16
84	002600	领益智造	189,100	858,514.00	0.16
85	002270	华明装备	111,000	854,700.00	0.16
86	000400	许继电气	42,300	844,731.00	0.16
87	600038	中直股份	18,200	844,662.00	0.16
88	688588	凌志软件	82,200	834,330.00	0.16
89	002562	兄弟科技	173,800	816,860.00	0.15
90	600549	厦门钨业	39,400	770,270.00	0.15
91	000931	中关村	124,300	764,445.00	0.14
92	605266	健之佳	9,500	760,665.00	0.14

93	300107	建新股份	147,500	758,150.00	0.14
94	300015	爱尔眼科	24,400	758,108.00	0.14
95	601168	西部矿业	74,300	757,860.00	0.14
96	600886	国投电力	69,900	757,017.00	0.14
97	600054	黄山旅游	58,700	747,838.00	0.14
98	300306	远方信息	79,800	740,544.00	0.14
99	603663	三祥新材	57,518	731,053.78	0.14
100	605218	伟时电子	52,600	725,880.00	0.14
101	600219	南山铝业	218,000	712,860.00	0.14
102	601319	中国人保	135,100	705,222.00	0.13
103	601666	平煤股份	64,900	701,569.00	0.13
104	601689	拓普集团	11,700	685,386.00	0.13
105	600178	东安动力	112,300	678,292.00	0.13
106	688068	热景生物	11,063	673,736.70	0.13
107	300645	正元智慧	26,700	672,306.00	0.13
108	601985	中国核电	110,900	665,400.00	0.13
109	300543	朗科智能	78,000	650,520.00	0.12
110	002169	智光电气	82,054	627,713.10	0.12
111	300248	新开普	69,900	615,120.00	0.12
112	300277	海联讯	91,800	607,716.00	0.12
113	000055	方大集团	127,700	604,021.00	0.11

11 4	603355	莱克电气	21,200	594,448.00	0.11
11 5	002133	广宇集团	168,100	590,031.00	0.11
11 6	002608	江苏国信	97,700	582,292.00	0.11
11 7	600831	广电网络	95,500	561,540.00	0.11
11 8	603011	合锻智能	67,100	548,207.00	0.10
11 9	300274	阳光电源	4,900	547,820.00	0.10
12 0	601218	吉鑫科技	136,900	543,493.00	0.10
12 1	300450	先导智能	13,400	539,350.00	0.10
12 2	000963	华东医药	11,400	533,520.00	0.10
12 3	000936	华西股份	105,160	533,161.20	0.10
12 4	300447	全信股份	34,500	531,300.00	0.10
12 5	600665	天地源	142,000	523,980.00	0.10
12 6	603076	乐惠国际	14,200	522,560.00	0.10
12 7	300311	任子行	83,900	510,112.00	0.10
12 8	603528	多伦科技	77,600	500,520.00	0.09
12 9	601933	永辉超市	136,300	497,495.00	0.09
13 0	600580	卧龙电驱	39,889	497,016.94	0.09
13 1	000967	盈峰环境	109,300	496,222.00	0.09

13 2	601595	上海电影	45,200	495,844.00	0.09
13 3	601968	宝钢包装	74,900	492,842.00	0.09
13 4	300484	蓝海华腾	46,100	484,050.00	0.09
13 5	600383	金地集团	46,600	476,718.00	0.09
13 6	600160	巨化股份	30,600	474,606.00	0.09
13 7	300496	中科创达	4,600	461,380.00	0.09
13 8	000739	普洛药业	20,700	445,878.00	0.08
13 9	300805	电声股份	64,400	439,208.00	0.08
14 0	300073	当升科技	7,700	434,280.00	0.08
14 1	601139	深圳燃气	64,500	421,830.00	0.08
14 2	002322	理工能科	46,900	418,817.00	0.08
14 3	601616	广电电气	118,500	401,715.00	0.08
14 4	300951	博硕科技	8,200	390,320.00	0.07
14 5	300435	中泰股份	28,900	385,526.00	0.07
14 6	603317	天味食品	14,000	384,720.00	0.07
14 7	688187	时代电气	7,031	383,681.67	0.07
14 8	603369	今世缘	7,500	381,750.00	0.07
14 9	300541	先进数通	33,600	381,360.00	0.07

15 0	603633	徕木股份	25,500	371,535.00	0.07
15 1	600683	京投发展	76,900	354,509.00	0.07
15 2	000807	云铝股份	31,500	350,280.00	0.07
15 3	300466	赛摩智能	76,300	345,639.00	0.07
15 4	002224	三力士	79,300	343,369.00	0.07
15 5	300230	永利股份	89,400	337,932.00	0.06
15 6	688579	山大地纬	34,341	336,198.39	0.06
15 7	600060	海信视像	24,700	334,438.00	0.06
15 8	688183	生益电子	34,653	322,619.43	0.06
15 9	002225	濮耐股份	81,400	313,390.00	0.06
16 0	688509	正元地信	77,441	312,861.64	0.06
16 1	600985	淮北矿业	24,400	312,320.00	0.06
16 2	002249	大洋电机	60,600	310,272.00	0.06
16 3	600143	金发科技	32,000	310,080.00	0.06
16 4	300407	凯发电气	41,900	300,842.00	0.06
16 5	603185	上机数控	2,800	296,380.00	0.06
16 6	002136	安纳达	21,600	293,544.00	0.06
16 7	603909	建发合诚	27,000	288,900.00	0.05

16 8	300375	鹏翎股份	81,600	288,048.00	0.05
16 9	601019	山东出版	45,500	285,740.00	0.05
17 0	002533	金杯电工	45,900	277,695.00	0.05
17 1	300693	盛弘股份	5,100	276,828.00	0.05
17 2	300828	锐新科技	20,050	274,885.50	0.05
17 3	600237	铜峰电子	43,100	274,116.00	0.05
17 4	300386	飞天诚信	28,000	265,160.00	0.05
17 5	603886	元祖股份	13,300	260,946.00	0.05
17 6	688772	珠海冠宇	13,700	255,368.00	0.05
17 7	300493	润欣科技	41,800	254,144.00	0.05
17 8	002603	以岭药业	8,400	251,664.00	0.05
17 9	300150	世纪瑞尔	69,400	250,534.00	0.05
18 0	600280	中央商场	76,100	248,847.00	0.05
18 1	300217	东方电热	43,500	246,645.00	0.05
18 2	600386	北巴传媒	62,104	246,552.88	0.05
18 3	603227	雪峰科技	29,600	245,384.00	0.05
18 4	603861	白云电器	32,800	245,016.00	0.05
18 5	601231	环旭电子	15,000	243,450.00	0.05

18 6	000576	甘化科工	23,900	242,824.00	0.05
18 7	002922	伊戈尔	15,900	242,157.00	0.05
18 8	002869	金溢科技	11,100	238,872.00	0.05
18 9	002572	索菲亚	12,994	235,971.04	0.04
19 0	600885	宏发股份	7,000	233,870.00	0.04
19 1	688138	清溢光电	12,808	233,105.60	0.04
19 2	688029	南微医学	2,729	224,132.77	0.04
19 3	600582	天地科技	41,600	216,320.00	0.04
19 4	002115	三维通信	46,700	211,551.00	0.04
19 5	603259	药明康德	2,600	210,600.00	0.04
19 6	601600	中国铝业	46,600	208,302.00	0.04
19 7	600259	广晟有色	5,100	205,020.00	0.04
19 8	600724	宁波富达	56,100	204,765.00	0.04
19 9	300630	普利制药	8,200	202,212.00	0.04
20 0	688372	伟测科技	2,383	193,499.60	0.04
20 1	603968	醋化股份	8,900	193,397.00	0.04
20 2	300128	锦富技术	51,500	179,220.00	0.03
20 3	002688	金河生物	34,700	178,358.00	0.03

20 4	600982	宁波能源	41,600	178,048.00	0.03
20 5	002281	光迅科技	10,900	171,348.00	0.03
20 6	601012	隆基绿能	4,000	169,040.00	0.03
20 7	603399	吉翔股份	12,200	168,360.00	0.03
20 8	600025	华能水电	25,400	167,640.00	0.03
20 9	002536	飞龙股份	22,000	164,780.00	0.03
21 0	603127	昭衍新药	2,800	163,548.00	0.03
21 1	002422	科伦药业	6,100	162,321.00	0.03
21 2	000926	福星股份	36,100	153,425.00	0.03
21 3	601801	皖新传媒	29,400	153,174.00	0.03
21 4	600461	洪城环境	21,800	151,510.00	0.03
21 5	600023	浙能电力	43,000	150,070.00	0.03
21 6	601598	中国外运	39,000	149,760.00	0.03
21 7	600150	中国船舶	6,700	149,276.00	0.03
21 8	000626	远大控股	15,900	148,824.00	0.03
21 9	600598	北大荒	10,800	148,608.00	0.03
22 0	300531	优博讯	11,600	147,900.00	0.03
22 1	603815	交建股份	19,300	145,715.00	0.03

22 2	300144	宋城演艺	9,800	143,080.00	0.03
22 3	300801	泰和科技	6,700	141,906.00	0.03
22 4	002196	方正电机	19,500	141,570.00	0.03
22 5	603158	腾龙股份	19,800	140,382.00	0.03
22 6	300121	阳谷华泰	13,500	139,860.00	0.03
22 7	688126	沪硅产业	7,800	137,358.00	0.03
22 8	300341	麦克奥迪	15,500	136,555.00	0.03
22 9	688082	盛美上海	1,676	133,912.40	0.03
23 0	300403	汉字集团	22,300	131,570.00	0.02
23 1	603012	创力集团	24,300	130,734.00	0.02
23 2	600233	圆通速递	6,300	126,567.00	0.02
23 3	002480	新筑股份	24,200	123,420.00	0.02
23 4	600132	重庆啤酒	900	114,642.00	0.02
23 5	000063	中兴通讯	4,300	111,198.00	0.02
23 6	002273	水晶光电	9,400	110,826.00	0.02
23 7	300691	联合光电	8,715	108,327.45	0.02
23 8	300516	久之洋	4,400	107,096.00	0.02
23 9	600497	驰宏锌锗	20,800	105,248.00	0.02

24 0	300388	节能国祯	16,700	103,206.00	0.02
24 1	600438	通威股份	2,600	100,308.00	0.02
24 2	603195	公牛集团	700	100,282.00	0.02
24 3	300697	电工合金	10,000	98,000.00	0.02
24 4	600600	青岛啤酒	900	96,750.00	0.02
24 5	000883	湖北能源	21,300	89,460.00	0.02
24 6	002328	新朋股份	17,800	89,000.00	0.02
24 7	300520	科大国创	5,600	88,816.00	0.02
24 8	603787	新日股份	4,800	86,880.00	0.02
24 9	600875	东方电气	4,000	84,080.00	0.02
25 0	601138	工业富联	9,100	83,538.00	0.02
25 1	688143	长盈通	1,938	82,675.08	0.02
25 2	002250	联化科技	5,300	82,150.00	0.02
25 3	600406	国电南瑞	3,300	80,520.00	0.02
25 4	603019	中科曙光	3,600	79,704.00	0.02
25 5	600784	鲁银投资	13,000	78,780.00	0.01
25 6	300320	海达股份	6,900	70,794.00	0.01
25 7	002479	富春环保	15,400	66,836.00	0.01

25 8	600425	青松建化	15,600	57,564.00	0.01
25 9	600398	海澜之家	10,700	56,710.00	0.01
26 0	600495	晋西车轴	15,000	53,250.00	0.01
26 1	600027	华电国际	8,600	50,568.00	0.01
26 2	300272	开能健康	9,700	50,537.00	0.01
26 3	300444	双杰电气	11,600	50,112.00	0.01
26 4	300017	网宿科技	8,700	48,546.00	0.01
26 5	000728	国元证券	7,600	48,108.00	0.01
26 6	603233	大参林	1,200	47,520.00	0.01
26 7	603768	常青股份	3,100	46,221.00	0.01
26 8	688313	仕佳光子	4,899	44,335.95	0.01
26 9	603719	良品铺子	1,200	44,244.00	0.01
27 0	600606	绿地控股	12,300	36,654.00	0.01
27 1	600826	兰生股份	3,700	34,003.00	0.01
27 2	601668	中国建筑	6,100	33,123.00	0.01
27 3	002661	克明食品	2,800	32,984.00	0.01
27 4	600819	耀皮玻璃	6,400	29,568.00	0.01
27 5	002048	宁波华翔	1,900	26,410.00	0.01

27 6	603618	杭电股份	4,900	25,774.00	0.00
27 7	300040	九洲集团	4,100	23,862.00	0.00
27 8	601618	中国中冶	6,600	20,988.00	0.00
27 9	301356	天振股份	405	17,548.65	0.00
28 0	300008	天海防务	3,500	13,755.00	0.00
28 1	688123	聚辰股份	134	13,560.80	0.00
28 2	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
28 3	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
28 4	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
28 5	688063	派能科技	13	4,103.45	0.00
28 6	688687	凯因科技	143	3,253.25	0.00
28 7	688668	鼎通科技	37	2,442.00	0.00
28 8	688596	正帆科技	37	1,256.15	0.00
28 9	601136	首创证券	39	679.38	0.00
29 0	688590	新致软件	45	431.10	0.00
29 1	688621	阳光诺和	3	307.20	0.00
29 2	600961	株冶集团	40	284.00	0.00
29 3	600722	金牛化工	47	229.36	0.00

29 4	002073	软控股份	34	209.10	0.00
29 5	300857	协创数据	8	153.84	0.00
29 6	300279	和晶科技	3	14.82	0.00
29 7	600067	冠城大通	1	3.10	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	688063	派能科技	14,613,883.33	2.77
2	688499	利元亨	13,512,457.01	2.56
3	688556	高测股份	13,108,382.51	2.48
4	603529	爱玛科技	12,954,522.40	2.46
5	603876	鼎胜新材	12,911,098.00	2.45
6	688518	联赢激光	12,686,746.50	2.41
7	600525	长园集团	12,609,394.80	2.39
8	688599	天合光能	12,562,505.13	2.38
9	603920	世运电路	12,343,756.63	2.34
10	000758	中色股份	12,290,520.17	2.33
11	600731	湖南海利	12,190,261.70	2.31
12	300725	药石科技	12,189,966.00	2.31
13	002675	东诚药业	12,139,933.00	2.30
14	600114	东睦股份	11,950,178.00	2.27
15	600795	国电电力	11,889,616.00	2.25
16	600732	爱旭股份	11,797,154.00	2.24
17	300438	鹏辉能源	11,768,049.65	2.23
18	300856	科思股份	11,696,310.50	2.22
19	601908	京运通	11,612,336.69	2.20

20	300014	亿纬锂能	11,593,717.00	2.20
21	600481	双良节能	11,585,924.00	2.20
22	300567	精测电子	11,474,599.92	2.18
23	688559	海目星	11,400,397.47	2.16
24	603612	索通发展	11,394,159.69	2.16
25	601567	三星医疗	11,293,775.00	2.14
26	300134	大富科技	11,240,339.00	2.13
27	000811	冰轮环境	10,984,864.00	2.08
28	600933	爱柯迪	10,891,186.00	2.06
29	600872	中炬高新	10,860,591.00	2.06
30	300502	新易盛	10,840,709.00	2.06
31	688106	金宏气体	10,806,132.40	2.05
32	300777	中简科技	10,751,687.44	2.04
33	688202	美迪西	10,620,959.97	2.01
34	605196	华通线缆	10,608,560.00	2.01

注：本项“买入金额”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。

8.4.2 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	688063	派能科技	12,973,809.58	2.46
2	300014	亿纬锂能	11,896,870.12	2.26
3	603529	爱玛科技	11,369,132.04	2.16
4	688599	天合光能	11,168,290.96	2.12
5	688499	利元亨	11,139,777.81	2.11
6	300856	科思股份	11,110,463.00	2.11
7	688617	惠泰医疗	11,071,244.20	2.10
8	000758	中色股份	10,744,360.45	2.04
9	688518	联赢激光	10,735,015.07	2.04

10	600933	爱柯迪	10,708,386.00	2.03
11	300438	鹏辉能源	10,675,347.00	2.02
12	600795	国电电力	10,646,024.00	2.02
13	300134	大富科技	10,609,149.00	2.01
14	300604	长川科技	10,301,799.56	1.95
15	300634	彩讯股份	10,263,605.00	1.95
16	600481	双良节能	10,259,409.00	1.94
17	600525	长园集团	10,190,521.00	1.93
18	603920	世运电路	10,159,196.47	1.93
19	688556	高测股份	10,158,678.42	1.93
20	002594	比亚迪	10,092,922.00	1.91

注：本项“卖出金额”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。

8.4.3 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	4,974,381,901.40
卖出股票收入（成交）总额	4,438,866,645.63

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,475,232.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	169,457.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,644,689.01

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
国泰君安中证1000指数增强A	3,627	85,415.57	7,936,000.36	2.56%	301,866,278.27	97.44%
国泰君安中证1000指数增强C	2,821	96,922.64	36,614,389.73	13.39%	236,804,368.48	86.61%
合计	6,448	90,449.91	44,550,390.09	7.64%	538,670,646.75	92.36%

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）。

9.2 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	国泰君安中证1000 指数增强A	2,039,907.06	0.66%
	国泰君安中证1000 指数增强C	54,781.60	0.02%
	合计	2,094,688.66	0.36%

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）。

9.3 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	国泰君安中证1000 指数增强A	0~10
	国泰君安中证1000 指数增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	国泰君安中证1000 指数增强A	>100
	国泰君安中证1000 指数增强C	0
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证1000指数	国泰君安中证1000指数
--	--------------	--------------

	增强A	增强C
基金合同生效日(2022年08月16日)基金份额总额	332,110,120.07	277,282,091.55
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	11,264,407.67	35,580,765.23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	33,572,249.11	39,444,098.57
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	309,802,278.63	273,418,758.21

注：本报告期期间为基金合同生效日起至报告期期末。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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无发生重大人事变动。

2、2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
东财证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	9,411,604,212.72	100.00%	670,908.08	100.00%	-

11.8 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	国泰君安中证1000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	2022-07-28
2	国泰君安中证1000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	2022-07-28
3	国泰君安中证1000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	2022-07-28
4	国泰君安中证1000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	2022-07-28
5	国泰君安中证1000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	2022-07-28
6	国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报	2022-07-28
7	国泰君安中证1000指数增强	中国证券报、证监会指定网	2022-07-28

	型证券投资基金基金份额发售公告	站、公司官网	
8	关于国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-08-13
9	国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-08-17
10	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华宝证券开展费率优惠活动的公告	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	2022-09-28
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下产品开展直销APP费率优惠活动的公告	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	2022-11-02
12	国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-11-14
13	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平安银行股份有限公司行E通平台开展费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-11-25

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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>。

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站www.gtjazg.com查阅，还可拨打本公司客服电话（95521）查询相关信息。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二三年三月三十一日