

# 国泰君安中证 500 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:上海银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2023年3月17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。

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1月1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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	65
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	66
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	68
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	109
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	109
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	109
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	109
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	109
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	109

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	109
8.12 投资组合报告附注.....	109
§9 基金份额持有人信息.....	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	110
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	111
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.....	112
§10 开放式基金份额变动.....	112
§11 重大事件揭示.....	112
11.1 基金份额持有人大会决议.....	112
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.....	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	113
11.4 基金投资策略的改变.....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	113
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.....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	113
11.8 其他重大事件.....	114
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	116
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.....	116
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	116
§13 备查文件目录.....	116
13.1 备查文件目录.....	116
13.2 存放地点.....	116
13.3 查阅方式.....	117

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,392,254,275.35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500指数增强A	国泰君安中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	014155	014156
报告期末下属分级基金的份额总额	855,925,363.63份	536,328,911.72份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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

	<p>易数据相关因子以及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	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95594
传真	021-38871190	021-68476936
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	谢乐斌	金煜

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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)	中国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	2022年		2021年12月15日(基金合同生效日)-2021年12月31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	国泰君安中证500指数增强A	国泰君安中证500指数增强C
本期已实现收益	-58,980,579.81	-38,870,650.60	2,117,444.15	1,216,752.84
本期利润	-82,898,773.21	-52,702,521.24	10,755,833.57	6,498,554.62
加权平均基金份额本期利润	-0.1090	-0.1167	0.0149	0.0148
本期加权平均净值利润率	-11.72%	-12.57%	1.49%	1.47%
本期基金份额净值增长率	-11.34%	-11.70%	1.49%	1.47%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末	



期末可供分配利润	-85,805,614.26	-55,776,463.74	2,117,788.83	1,217,397.57
期末可供分配基金份额利润	-0.1002	-0.1040	0.0029	0.0028
期末基金资产净值	770,119,749.37	480,552,447.98	731,816,002.77	447,384,542.36
期末基金份额净值	0.8998	0.8960	1.0149	1.0147
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-10.02%	-10.40%	1.49%	1.47%

注：1、上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。

## 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

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	2.88%	0.98%	2.52%	0.97%	0.36%	0.01%
过去六个月	-7.22%	1.06%	-8.66%	1.04%	1.44%	0.02%
过去一年	-11.34%	1.32%	-19.30%	1.31%	7.96%	0.01%
自基金合同生效起至今	-10.02%	1.29%	-18.93%	1.28%	8.91%	0.01%

国泰君安中证500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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	2.78%	0.98%	2.52%	0.97%	0.26%	0.01%
过去六个月	-7.41%	1.06%	-8.66%	1.04%	1.25%	0.02%
过去一年	-11.70%	1.32%	-19.30%	1.31%	7.60%	0.01%
自基金合同生效起至今	-10.40%	1.29%	-18.93%	1.28%	8.53%	0.01%

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



注：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：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：2021年按实际存续期计算。



注：2021年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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 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，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。	2021-12-15	-	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

A股上半年走势波动较大,4月之前从外部因素的角度来看主要有以下几个方面:美联储加息,美债收益率跳升冲击风险资产;俄乌冲突导致多个不同市场剧烈波动,催化大宗商品价格上行;局部新冠疫情,市场避险情绪迅速升温;中概股政策风险影响国际资金对A股的配置。4月底开始,随着疫情防控形势总体向好,复工复产稳步推进,稳增长政策落地逐见成效,A股迎来了一波深V反弹,经济运行积极向好。

从市场风格的角度来看,二季度从市场见底以来,风格从价值转向成长,中大市值公司表现良好。并且行业间分化较大,消费者服务、汽车和食品饮料涨幅居前;房地产、计算机和银行等行业表现较差。从Alpha大类因子的表现来看,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,估值因子一二季度均有强势表现,而成长、盈利质量和分析师情绪因子在反弹行情中不断走强,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。

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。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,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。

本基金今年来保持高仓位稳定运作,在市场风格和行业走势出现较大的变化下,依然维持一贯的投资组合管理体系。今年来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。投资经理在投资组合的配置和交易方面严格遵循量化模型的建议,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。

#### 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500指数增强A基金份额净值为0.8998元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.34%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%；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0.8960元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.70%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，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，在各种不同市场环境进可攻退可守；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。

今年以来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，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持乐观态度。随着7月份中证1000中小盘股股指期货的上市，进一步引导机构资金中长线布局中下盘股，大大增强了中小盘股的配置价值。另一方面，以新能源、半导体和国防军工为代表的新兴产业更符合中国未来经济发展的方向，在政策和业绩的共振下依然是机构资金配置的重点，这几个行业在中证500指数当中的占比均不低。展望2021年下半年，在积极的财政和货币政策的支撑下，A股依然有望延续震荡反弹的格局，价值和成长依然会有阶段性的表现，中小盘股阶段性依然优于大盘股。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，在中证500指数的基础上不断提升业绩表现，坚持长期主义，为客户获取优异稳定的超额回报。

#### 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集合计划资产，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §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	

#### 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500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了国泰君安中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"国泰君安

	<p>中证500指数增强")的财务报表，包括2022年12月31日和2021年12月31日的资产负债表，2022年度和2021年12月15日(基金合同生效日)至2021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。(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500指数增强2022年12月31日和2021年12月31日的财务状况以及2022年度和2021年12月15日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。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。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500指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>国泰君安中证500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</p>

	<p>评估国泰君安中证500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500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500指数增强的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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500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</p>

	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500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。
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	-
会计师事务所的地址	中国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500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	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	82,350,580.82	71,844,463.20
结算备付金		6,469,542.93	10,000,000.00
存出保证金		2,796,309.60	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,162,187,263.14	1,097,949,326.76
其中：股票投资		1,162,187,263.14	1,097,949,326.76
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		1,484,101.69	54,318.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	18,751.70
资产总计		1,255,287,798.18	1,179,866,859.99
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		3,231,908.38	-
应付管理人报酬		969,871.11	509,326.78
应付托管费		145,480.67	76,399.00
应付销售服务费		143,036.49	77,251.30
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	125,304.18	3,337.78
负债合计		4,615,600.83	666,314.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,392,254,275.35	1,161,946,276.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-141,582,078.00	17,254,268.47
净资产合计		1,250,672,197.35	1,179,200,545.13
负债和净资产总计		1,255,287,798.18	1,179,866,859.99

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额1,392,254,275.35份，其中国泰君安中证500指数增强A类基金份额净值0.8998元，基金份额855,925,363.63份；国泰君安中证500指数增强C类基金份额净值0.8960元，基金份额536,328,911.72份。于2021年12月31日，基金份额总额1,161,946,276.66份，其中国泰君安中证500指数增强A类基金份额净值1.0149元，基金份额721,060,040.05份；国泰君安中证500指数增强C类基金份额净值1.0147元，基金份额440,886,236.61份。

2.本财务报表的实际编制期间为2022年度和2021年12月15日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰君安中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日(基 金合同生效日)至2 021年12月31日
一、营业总收入		-120,892,620.88	19,200,967.27
1.利息收入		545,573.68	100,072.50
其中：存款利息收入	7.4.7.9	545,573.68	94,058.80
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		-	6,013.70
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-84,908,003.83	5,180,703.57
其中: 股票投资收益	7.4.7.10	-94,879,690.07	5,180,703.57
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		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-3,320,737.13	-
股利收益	7.4.7.15	13,292,423.37	-
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)	7.4.7.16	-37,750,064.04	13,920,191.20
4.汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.17	1,219,873.31	-
<b>减: 二、营业总支出</b>		14,708,673.57	1,946,579.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,229,421.44	509,326.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,684,413.10	76,399.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,672,640.81	77,251.30
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-



8. 其他费用	7.4.7.19	122,198.22	1,283,602.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-135,601,294.45	17,254,388.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-135,601,294.45	17,254,388.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-135,601,294.45	17,254,388.19

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01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）	1,161,946,276.66	-	17,254,268.47	1,179,200,545.13
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）	1,161,946,276.66	-	17,254,268.47	1,179,200,545.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	230,307,998.69	-	-158,836,346.47	71,471,652.22
（一）、综合收益总额	-	-	-135,601,294.45	-135,601,294.45

（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）	230,307,998.69	-	-23,235,052.02	207,072,946.67
其中：1.基金申购款	949,670,956.86	-	-73,396,743.65	876,274,213.21
2.基金赎回款	-719,362,958.17	-	50,161,691.63	-669,201,266.54
（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）	1,392,254,275.35	-	-141,582,078.00	1,250,672,197.35
项目	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021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	1,160,704,146.7	-	-	1,160,704,146.7

资产（基金净值）	4			4
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,242,129.92	-	17,254,268.47	18,496,398.39
（一）、综合收益总额	-	-	17,254,388.19	17,254,388.19
（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）	1,242,129.92	-	-119.72	1,242,010.20
其中：1.基金申购款	1,242,129.92	-	-119.72	1,242,010.20
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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）	1,161,946,276.66	-	17,254,268.47	1,179,200,545.13

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500指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2021]3391号《关于准予国泰君安中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,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》和《国泰君安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,160,406,264.46元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第1179号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2021年12月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,160,704,146.74份,其中认购资金利息折合297,882.28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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证500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)、备选成份券(包括存托凭证)、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、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500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500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×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500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年度和2021年12月15日(基金合同生效日)至2021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日和2021年12月31日的财务状况以及2022年度和2021年12月15日(基金合同生效日)至2021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。本财务报表的实际编制期间为2022年度和2021年12月15日(基金合同生效日)至2021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

#### 新金融工具准则

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商业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商业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。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

### 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

#### 新金融工具准则

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

新金融工具准则

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或者发行价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利息收入。

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 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外, 财政部于2022年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14号), 中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021年12月15日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息和应收申购款, 金额分别为71,844,463.20元、10,000,000.00元、18,751.70元和54,318.33元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、其他资产-应收利息和应收申购款, 金额分别为71,858,009.40元、10,005,205.50元、0.00元和54,318.33元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为1,097,949,326.76元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为1,097,949,326.76元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为509,326.78元、76,399.00元、77,251.30元和3,337.78元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为509,326.78元、76,399.00元、77,251.30元和3,337.78元。

ii) 于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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	上年度末 2021年12月31日
活期存款	41,351,778.40	11,926,477.37
等于：本金	41,343,156.31	11,926,477.37
加：应计利息	8,622.09	-
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	40,998,802.42	59,917,985.83
等于：本金	40,993,868.82	59,917,985.83
加：应计利息	4,933.60	-
减：坏账准备	-	-
合计	82,350,580.82	71,844,463.20

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	1,185,978,082.75	-	1,162,187,263.14	-23,790,819.61
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	1,185,978,082.75	-	1,162,187,263.14	-23,790,819.61
项目	上年度末 2021年12月31日			

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,084,029,135.56	-	1,097,949,326.76	13,920,191.20
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	1,084,029,135.56	-	1,097,949,326.76	13,920,191.20

### 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	20,012,693.23	-	-	-
--股指期货	20,012,693.23	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,012,693.23	-	-	-
项目	上年度末 2021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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 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
IC2301	IC2301	17.00	19,973,640.00	-39,053.23
合计				-39,053.23
减：可抵销 期货暂收 款				-39,053.23
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

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	18,751.70
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-

合计	-	18,751.70
----	---	-----------

#### 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	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	304.18	-
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	125,000.00	3,337.78
合计	125,304.18	3,337.78

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 国泰君安中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指数增强 A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	721,060,040.05	721,060,040.05
本期申购	520,051,797.65	520,051,797.65
本期赎回（以“-”号填列）	-385,186,474.07	-385,186,474.07
本期末	855,925,363.63	855,925,363.63

##### 7.4.7.7.2 国泰君安中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指数增强 C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	440,886,236.61	440,886,236.61

本期申购	429,619,159.21	429,619,159.21
本期赎回（以“-”号填列）	-334,176,484.10	-334,176,484.10
本期末	536,328,911.72	536,328,911.72

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2021年12月1日至2021年12月10日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,160,406,264.46元，折合为1,160,406,264.46份基金份额(其中A类基金份额720,467,946.24份，C类基金份额439,938,318.22份)。根据《国泰君安中证500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297,882.28元在本基金成立后，折合为297,882.28份基金份额(其中A类基金份额173,982.48份，C类基金份额123,899.80份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《国泰君安中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《国泰君安中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》及《国泰君安中证500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于2021年12月15日(基金合同生效日)至2021年12月23日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购和赎回业务自2021年12月24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500指数增强A

单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,117,788.83	8,638,173.89	10,755,962.72
本期利润	-58,980,579.81	-23,918,193.40	-82,898,773.21
本期基金份额交易产生的变动数	-10,489,126.67	-3,173,677.10	-13,662,803.77
其中：基金申购款	-33,606,822.79	-5,273,075.01	-38,879,897.80
基金赎回款	23,117,696.12	2,099,397.91	25,217,094.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-67,351,917.65	-18,453,696.61	-85,805,614.26

##### 7.4.7.8.2 国泰君安中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,217,397.57	5,280,908.18	6,498,305.75
本期利润	-38,870,650.60	-13,831,870.64	-52,702,521.24
本期基金份额交易产生的变动数	-6,587,284.74	-2,984,963.51	-9,572,248.25
其中：基金申购款	-29,392,791.34	-5,124,054.51	-34,516,845.85
基金赎回款	22,805,506.60	2,139,091.00	24,944,597.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-44,240,537.77	-11,535,925.97	-55,776,463.74

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	250,315.32	37,239.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	174,820.97	51,613.34
结算备付金利息收入	120,437.39	5,205.50
其他	-	-
合计	545,573.68	94,058.80

#### 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01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	28,238,711,275.14	860,284,492.74
减：卖出股票成本总额	28,296,790,211.69	855,103,789.17

减：交易费用	36,800,753.52	-
买卖股票差价收入	-94,879,690.07	5,180,703.57

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 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01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年12月15日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
期货投资	-3,320,737.13	-

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,292,423.37	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,292,423.37	-

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-37,711,010.81	13,920,191.20
——股票投资	-37,711,010.81	13,920,191.20
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-39,053.23	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-39,053.23	-
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	-37,750,064.04	13,920,191.20

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年12月15日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,219,873.31	-
合计	1,219,873.31	-

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至 2022年12月31日	2021年12月15日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
审计费用	-	-
信息披露费	-	-
汇划手续费	536.00	-
信息披露费	71,662.22	3,337.78
审计费用	50,000.00	-
交易费用	-	1,280,264.22
合计	122,198.22	1,283,602.00

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
上海银行股份有限公司以下简称（“上海银行”）	基金托管人、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国泰君安 证券	56,608,931,439.29	100.00%	2,799,417,417.47	100.00%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
国泰君安 证券	-	-	100,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.5 基金交易

无。

#### 7.4.10.1.6 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01月01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	3,863,860.36	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021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	171,632.97	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01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年12月15日（基金合同 生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,229,421.44	509,326.78
其中：支付销售机构的客户维护费	5,153,958.89	152,356.96

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,684,413.10	76,399.00

注：支付基金托管人上海银行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 X 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01月01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500指数增强 A	国泰君安中证500指数增强 C	合计
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	55,210.74	55,210.74
国泰君安证券	0.00	1,375,622.57	1,375,622.57
上海银行	0.00	919.02	919.02
合计	0.00	1,431,752.33	1,431,752.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年12月15日（基金合同生效日）至2021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500指数增强 A	国泰君安中证500指数增强 C	合计
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	4,846.83	4,846.83

有限公司			
国泰君安 证券	0.00	68,933.09	68,933.09
上海银行	0.00	38.54	38.54
合计	0.00	73,818.46	73,818.46

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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰君安资管，再由国泰君安资管计算并支付给各基金销售机构。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 X 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

国泰君安中证500指数增强A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01 日至2022年12 月31日	2021年12月15日（基金 合同生效日）至2021年1 月31日
基金合同生效日（2021年12月15日）持有的基金份额	0.00	9,999,450.00
报告期初持有的基金份额	9,999,450.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,999,450.00	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.17%	1.39%

国泰君安中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金合同生效日（2021年12月15日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：1、基金管理人投资本集合计划相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关  
规定支付

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母采用基金分级份额计算。

#### 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年12月31日		2021年12月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	41,351,778.40	250,315.32	11,926,477.37	37,239.96
国泰君安证券	40,998,802.42	174,820.97	59,917,985.83	51,613.34

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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
688231	隆达股份	2022-07-13	6个月	新股锁定	39.08	35.14	7,835	306,191.80	275,321.90	-
688403	汇成股份	2022-08-10	6个月	新股锁定	8.88	10.12	18,553	164,750.64	187,756.36	-
688391	钜泉科技	2022-09-05	6个月	新股锁定	115.00	95.83	1,397	160,655.00	133,874.51	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月	新股锁定	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
688292	浩瀚深度	2022-08-09	6个月	新股锁定	16.56	14.67	4,503	74,569.68	66,059.01	-
301095	广立微	2022-07-28	6个月	新股锁定	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022-07-27	6个月	新股锁定	55.67	56.72	875	48,711.25	49,630.00	-
3013	华宝	2022-	6个	新股	237.5	176.9	242	57,47	42,82	-

27	新能	09-08	月	锁定	0	7		5.00	6.74	
3013 56	天振 股份	2022- 11-03	6个 月	新股 锁定	63.00	43.33	614	38,68 2.00	26,60 4.62	-
3011 95	北路 智控	2022- 07-25	6个 月	新股 锁定	71.17	73.04	330	23,48 6.10	24,10 3.20	-
3013 30	熵基 科技	2022- 08-10	6个 月	新股 锁定	43.32	31.31	694	30,06 4.08	21,72 9.14	-
3013 49	信德 新材	2022- 08-30	6个 月	新股 锁定	138.8 8	103.5 2	180	24,99 8.40	18,63 3.60	-
3011 71	易点 天下	2022- 08-10	6个 月	新股 锁定	18.18	17.72	986	17,92 5.48	17,47 1.92	-
3013 63	美好 医疗	2022- 09-28	6个 月	新股 锁定	30.66	37.85	445	13,64 3.70	16,84 3.25	-
3011 15	建科 股份	2022- 08-23	6个 月	新股 锁定	42.05	24.04	685	28,80 4.25	16,46 7.40	-
3012 96	新巨 丰	2022- 08-26	6个 月	新股 锁定	18.19	14.90	1,042	18,95 3.98	15,52 5.80	-
3013 28	维峰 电子	2022- 08-30	6个 月	新股 锁定	78.80	76.96	191	15,05 0.80	14,69 9.36	-
3011 21	紫建 电子	2022- 08-01	6个 月	新股 锁定	61.07	49.77	290	17,71 0.30	14,43 3.30	-
3011 39	元道 通信	2022- 06-30	6个 月	新股 锁定	38.46	25.31	566	21,76 8.36	14,32 5.46	-
3013 96	宏景 科技	2022- 11-04	6个 月	新股 锁定	40.13	31.90	396	15,89 1.48	12,63 2.40	-
3013 38	凯格 精机	2022- 08-08	6个 月	新股 锁定	46.33	48.99	257	11,90 6.81	12,59 0.43	-
3012 80	珠城 科技	2022- 12-19	6个 月	新股 锁定	67.40	44.80	279	18,80 4.60	12,49 9.20	-
3013 66	一博 科技	2022- 09-19	6个 月	新股 锁定	65.35	45.09	268	17,51 3.80	12,08 4.12	-
3011 32	满坤 科技	2022- 08-03	6个 月	新股 锁定	26.80	24.48	468	12,54 2.40	11,45 6.64	-

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	-
301306	西测测试	2022-07-19	6个月	新股锁定	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6个月	新股锁定	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6个月	新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6个月	新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月	新股锁定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	新股锁定	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月	新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	新股锁定	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

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	重大资产重组	46.41	2023-01-10	51.05	155,152	7,262,356.27	7,200,604.32	-

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上海银行股份有限公司，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(2021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期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

行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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	82,350,580.82	-	-	-	82,350,580.82
结算备付金	6,469,542.93	-	-	-	6,469,542.93
存出保证金	2,796,309.60	-	-	-	2,796,309.60
交易性金融资产	-	-	-	1,162,187,263.14	1,162,187,263.14
应收申购款	-	-	-	1,484,101.69	1,484,101.69
资产总计	91,616,433.35	-	-	1,163,671,364.83	1,255,287,798.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,231,908.38	3,231,908.38
应付管理人报酬	-	-	-	969,871.11	969,871.11
应付托管费	-	-	-	145,480.67	145,480.67
应付销售服务费	-	-	-	143,036.49	143,036.49
其他负债	-	-	-	125,304.18	125,304.18
负债总计	-	-	-	4,615,600.83	4,615,600.83
利率敏感度缺口	91,616,433.35	-	-	1,159,055,764.00	1,250,672,197.35
上年度末 2021 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	71,844,463.20	-	-	-	71,844,463.20

结算备付金	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	1,097,949,326.76	1,097,949,326.76
其他资产	-	-	-	18,751.70	18,751.70
应收申购款	-	-	-	54,318.33	54,318.33
资产总计	81,844,463.20	-	-	1,098,022,396.79	1,179,866,859.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	509,326.78	509,326.78
应付托管费	-	-	-	76,399.00	76,399.00
应付销售服务费	-	-	-	77,251.30	77,251.30
其他负债	-	-	-	3,337.78	3,337.78
负债总计	-	-	-	666,314.86	666,314.86
利率敏感度缺口	81,844,463.20	-	-	1,097,356,081.93	1,179,200,545.13

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%(2021年12月31日: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(2021年12月31日：同)

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 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		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,162,187,263.14	92.93	1,097,949,326.76	93.11
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	1,162,187,263.14	92.93	1,097,949,326.76	93.11

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

假设	除业绩比较基准（附注7.4.1）以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	61,633,390.40	-
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-61,633,390.40	-

于2021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	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,153,710,000.39	1,097,949,326.76
第二层次	7,200,604.32	-
第三层次	1,276,658.43	-
合计	1,162,187,263.14	1,097,949,326.76

###### 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01月01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	-	907,243.20	907,243.20
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,781,500.66	1,781,500.66
转出第三层次	-	1,771,768.75	1,771,768.75
当期利得或损失总额	-	359,683.32	359,683.32
其中：计入损益的利得或损失	-	359,683.32	359,683.32
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,276,658.43	1,276,658.43
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	-	-48,649.50	-48,649.50
项目	上年度可比同期 2021年12月15日（基金合同生效日）至2021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	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

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。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

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资	1,276,658.43	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	18.91%~247.56%	负相关



项目	上年度末公允价值	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
-	-	-	-	-	-

#### 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(2021年12月31日：同)。

#### 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

##### (1) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### (2) 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。

##### (3) 财务报表的批准

本财务报表已经本基金的基金管理人批准。

## §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	1,162,187,263.14	92.58
	其中：股票	1,162,187,263.14	92.58
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	88,820,123.75	7.08
8	其他各项资产	4,280,411.29	0.34
9	合计	1,255,287,798.18	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	15,209,322.93	1.22
B	采矿业	76,167,968.80	6.09
C	制造业	576,951,353.10	46.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,814,672.02	2.06
E	建筑业	11,379,114.22	0.91
F	批发和零售业	39,141,285.47	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	16,606,427.12	1.33
H	住宿和餐饮业	2,790,000.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,886,166.53	3.59
J	金融业	69,314,031.24	5.54
K	房地产业	14,135,238.00	1.13
L	租赁和商务服务业	20,257,479.58	1.62
M	科学研究和技术服务业	5,352,842.39	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	78.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,063,173.00	0.16

R	文化、体育和娱乐业	14,736,821.00	1.18
S	综合	-	-
	合计	934,805,973.60	74.74

### 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	-	-
B	采矿业	745,900.00	0.06
C	制造业	156,849,035.25	12.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,769,870.48	0.62
E	建筑业	10,394,318.00	0.83
F	批发和零售业	9,370,037.96	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	4,799,654.00	0.38
H	住宿和餐饮业	1,254,525.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,289,625.52	1.54
J	金融业	4,731,091.38	0.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,203,666.35	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	3,723,160.95	0.30
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	5,250,404.65	0.42
S	综合	-	-
	合计	227,381,289.54	18.18

### 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	002422	科伦药业	552,841	14,711,099.01	1.18
2	600699	均胜电子	1,017,800	14,300,090.00	1.14
3	000729	燕京啤酒	1,346,460	14,299,405.20	1.14
4	601168	西部矿业	1,336,106	13,628,281.20	1.09
5	300009	安科生物	1,450,587	13,577,494.32	1.09
6	000728	国元证券	2,103,312	13,313,964.96	1.06
7	300861	美畅股份	266,680	13,109,988.80	1.05
8	300115	长盈精密	1,262,000	13,036,460.00	1.04
9	600143	金发科技	1,329,600	12,883,824.00	1.03
10	600549	厦门钨业	652,770	12,761,653.50	1.02
11	601231	环旭电子	782,600	12,701,598.00	1.02
12	002444	巨星科技	654,000	12,412,920.00	0.99
13	600160	巨化股份	795,860	12,343,788.60	0.99
14	603939	益丰药房	180,526	11,524,779.84	0.92
15	600398	海澜之家	2,125,261	11,263,883.30	0.90
16	002048	宁波华翔	794,621	11,045,231.90	0.88
17	000975	银泰黄金	994,600	10,980,384.00	0.88
18	601108	财通证券	1,540,260	10,966,651.20	0.88
19	601666	平煤股份	998,400	10,792,704.00	0.86
20	300144	宋城演艺	738,420	10,780,932.00	0.86
21	600415	小商品城	2,044,200	10,711,608.00	0.86
22	601139	深圳燃气	1,630,305	10,662,194.70	0.85
23	300866	安克创新	178,200	10,561,914.00	0.84
24	300073	当升科技	184,500	10,405,800.00	0.83

25	601598	中国外运	2,685,500	10,312,320.00	0.82
26	002250	联化科技	663,300	10,281,150.00	0.82
27	000400	许继电气	505,900	10,102,823.00	0.81
28	002273	水晶光电	845,686	9,970,637.94	0.80
29	688819	天能股份	270,487	9,937,692.38	0.79
30	300017	网宿科技	1,776,000	9,910,080.00	0.79
31	002705	新宝股份	586,300	9,761,895.00	0.78
32	002281	光迅科技	619,660	9,741,055.20	0.78
33	000778	新兴铸管	2,642,000	9,643,300.00	0.77
34	603613	国联股份	109,004	9,640,313.76	0.77
35	000739	普洛药业	443,145	9,545,343.30	0.76
36	600580	卧龙电驱	750,700	9,353,722.00	0.75
37	600598	北大荒	667,000	9,177,920.00	0.73
38	601198	东兴证券	1,181,200	9,118,864.00	0.73
39	600985	淮北矿业	698,475	8,940,480.00	0.71
40	600497	驰宏锌锗	1,750,700	8,858,542.00	0.71
41	000012	南玻A	1,311,854	8,802,540.34	0.70
42	002249	大洋电机	1,705,200	8,730,624.00	0.70
43	600582	天地科技	1,667,765	8,672,378.00	0.69
44	600959	江苏有线	2,891,290	8,587,131.30	0.69
45	600380	健康元	737,951	8,331,466.79	0.67
46	600885	宏发股份	247,385	8,265,132.85	0.66
47	601992	金隅集团	3,154,400	8,012,176.00	0.64
48	603355	莱克电气	282,100	7,910,084.00	0.63
49	600298	安琪酵母	164,300	7,429,646.00	0.59
50	603317	天味食品	268,392	7,375,412.16	0.59
51	600038	中直股份	155,152	7,200,604.32	0.58
52	600909	华安证券	1,567,400	7,194,366.00	0.58
53	300630	普利制药	289,300	7,134,138.00	0.57
54	600259	广晟有色	176,622	7,100,204.40	0.57
55	000738	航发控制	276,700	7,094,588.00	0.57

56	002572	索菲亚	380,450	6,908,972.00	0.55
57	000883	湖北能源	1,618,700	6,798,540.00	0.54
58	601058	赛轮轮胎	675,721	6,770,724.42	0.54
59	600873	梅花生物	657,100	6,689,278.00	0.53
60	000807	云铝股份	586,100	6,517,432.00	0.52
61	600170	上海建工	2,497,300	6,492,980.00	0.52
62	603233	大参林	154,080	6,101,568.00	0.49
63	601607	上海医药	341,500	6,088,945.00	0.49
64	002299	圣农发展	254,597	6,031,402.93	0.48
65	600967	内蒙一机	725,500	5,992,630.00	0.48
66	002683	广东宏大	221,100	5,960,856.00	0.48
67	600968	海油发展	2,040,090	5,875,459.20	0.47
68	603719	良品铺子	155,843	5,745,931.41	0.46
69	002384	东山精密	230,300	5,695,319.00	0.46
70	000598	兴蓉环境	1,135,090	5,550,590.10	0.44
71	601665	齐鲁银行	1,310,324	5,464,051.08	0.44
72	000513	丽珠集团	165,200	5,365,696.00	0.43
73	603127	昭衍新药	90,879	5,308,242.39	0.42
74	002465	海格通信	651,618	5,291,138.16	0.42
75	002831	裕同科技	155,200	5,132,464.00	0.41
76	601717	郑煤机	449,900	5,020,884.00	0.40
77	300058	蓝色光标	982,791	4,963,094.55	0.40
78	002294	信立泰	150,800	4,953,780.00	0.40
79	600377	宁沪高速	578,196	4,752,771.12	0.38
80	600637	东方明珠	699,500	4,651,675.00	0.37
81	600705	中航产融	1,417,900	4,650,712.00	0.37
82	600271	航天信息	446,599	4,649,095.59	0.37
83	000785	居然之家	1,107,067	4,527,904.03	0.36
84	688772	珠海冠宇	242,357	4,517,534.48	0.36
85	002867	周大生	321,300	4,507,839.00	0.36
86	002563	森马服饰	839,200	4,397,408.00	0.35

87	600567	山鹰国际	1,741,900	4,319,912.00	0.35
88	600782	新钢股份	1,049,731	4,293,399.79	0.34
89	000050	深天马A	493,328	4,272,220.48	0.34
90	002595	豪迈科技	183,400	4,245,710.00	0.34
91	688029	南微医学	51,547	4,233,555.11	0.34
92	002557	洽洽食品	84,200	4,210,000.00	0.34
93	600282	南钢股份	1,321,500	4,162,725.00	0.33
94	600535	天士力	371,334	3,995,553.84	0.32
95	600808	马钢股份	1,369,110	3,847,199.10	0.31
96	600517	国网英大	781,300	3,781,492.00	0.30
97	600060	海信视像	278,041	3,764,675.14	0.30
98	000553	安道麦A	405,400	3,668,870.00	0.29
99	000887	中鼎股份	240,472	3,479,629.84	0.28
100	300724	捷佳伟创	29,788	3,396,427.76	0.27
101	002673	西部证券	554,900	3,379,341.00	0.27
102	002025	航天电器	50,783	3,364,373.75	0.27
103	603345	安井食品	20,600	3,334,728.00	0.27
104	002416	爱施德	343,394	3,255,375.12	0.26
105	002409	雅克科技	64,358	3,241,712.46	0.26
106	300308	中际旭创	119,750	3,236,842.50	0.26
107	688777	中控技术	35,153	3,192,946.99	0.26
108	600208	新湖中宝	1,213,900	3,083,306.00	0.25
109	601696	中银证券	287,800	3,042,046.00	0.24
110	000987	越秀资本	501,270	3,002,607.30	0.24
111	600718	东软集团	290,900	2,894,455.00	0.23
112	002625	光启技术	166,200	2,828,724.00	0.23
113	601699	潞安环能	167,600	2,824,060.00	0.23
114	600258	首旅酒店	112,500	2,790,000.00	0.22
115	600970	中材国际	325,136	2,770,158.72	0.22
116	002739	万达电影	196,000	2,744,000.00	0.22
117	603658	安图生物	43,300	2,678,105.00	0.21

118	000683	远兴能源	339,900	2,664,816.00	0.21
119	002396	星网锐捷	132,800	2,544,448.00	0.20
120	002244	滨江集团	286,900	2,533,327.00	0.20
121	002078	太阳纸业	218,700	2,519,424.00	0.20
122	688122	西部超导	26,523	2,511,462.87	0.20
123	600500	中化国际	377,100	2,492,631.00	0.20
124	603605	珀莱雅	14,798	2,478,369.04	0.20
125	002203	海亮股份	210,577	2,379,520.10	0.19
126	300136	信维通信	140,400	2,318,004.00	0.19
127	600648	外高桥	187,600	2,241,820.00	0.18
128	600801	华新水泥	150,925	2,236,708.50	0.18
129	600325	华发股份	244,500	2,215,170.00	0.18
130	600528	中铁工业	281,070	2,144,564.10	0.17
131	300244	迪安诊断	82,100	2,063,173.00	0.16
132	000997	新大陆	149,200	1,941,092.00	0.16
133	002368	太极股份	68,800	1,935,344.00	0.15
134	600299	安迪苏	231,010	1,908,142.60	0.15
135	600376	首开股份	329,500	1,874,855.00	0.15
136	300003	乐普医疗	78,104	1,794,048.88	0.14
137	600195	中牧股份	148,300	1,723,246.00	0.14
138	001914	招商积余	107,600	1,654,888.00	0.13
139	600642	申能股份	300,215	1,648,180.35	0.13
140	688088	虹软科技	71,797	1,616,150.47	0.13
141	002653	海思科	70,800	1,575,300.00	0.13
142	300001	特锐德	102,000	1,551,420.00	0.12
143	600859	王府井	54,256	1,526,763.84	0.12
144	600507	方大特钢	241,400	1,453,228.00	0.12
145	600901	江苏金租	257,400	1,410,552.00	0.11
146	300568	星源材质	65,000	1,381,900.00	0.11
147	000039	中集集团	186,900	1,315,776.00	0.11
148	000961	中南建设	600,500	1,315,095.00	0.11



149	603228	景旺电子	59,852	1,211,404.48	0.10
150	002958	青农商行	395,100	1,141,839.00	0.09
151	603866	桃李面包	73,374	1,129,959.60	0.09
152	600126	杭钢股份	261,566	1,080,267.58	0.09
153	603218	日月股份	48,300	980,490.00	0.08
154	601555	东吴证券	147,840	965,395.20	0.08
155	600927	永安期货	59,700	962,364.00	0.08
156	002081	金螳螂	198,050	960,542.50	0.08
157	600027	华电国际	155,322	913,293.36	0.07
158	000402	金融街	168,100	882,525.00	0.07
159	000156	华数传媒	113,300	848,617.00	0.07
160	601872	招商轮船	143,500	802,165.00	0.06
161	600820	隧道股份	151,900	800,513.00	0.06
162	600739	辽宁成大	63,300	796,947.00	0.06
163	600153	建发股份	55,700	760,305.00	0.06
164	688779	长远锂科	49,639	724,233.01	0.06
165	600765	中航重机	23,200	721,288.00	0.06
166	000401	冀东水泥	86,400	711,072.00	0.06
167	002128	电投能源	54,700	674,998.00	0.05
168	601577	长沙银行	94,800	640,848.00	0.05
169	603596	伯特利	8,000	638,400.00	0.05
170	600409	三友化工	93,000	614,730.00	0.05
171	600201	生物股份	67,800	610,878.00	0.05
172	600566	济川药业	22,200	604,284.00	0.05
173	601000	唐山港	217,900	597,046.00	0.05
174	688390	固德威	1,800	581,562.00	0.05
175	600895	张江高科	50,800	576,072.00	0.05
176	600339	中油工程	170,200	507,196.00	0.04
177	002385	大北农	55,900	497,510.00	0.04
178	600755	厦门国贸	69,000	492,660.00	0.04
179	600998	九州通	35,900	468,136.00	0.04

180	603816	顾家家居	8,860	378,410.60	0.03
181	002372	伟星新材	17,499	373,428.66	0.03
182	601098	中南传媒	36,400	363,272.00	0.03
183	601611	中国核建	46,700	354,920.00	0.03
184	000898	鞍钢股份	119,000	317,730.00	0.03
185	300682	朗新科技	13,904	305,609.92	0.02
186	002603	以岭药业	9,800	293,608.00	0.02
187	002507	涪陵榨菜	10,800	278,316.00	0.02
188	002925	盈趣科技	14,887	245,933.24	0.02
189	000970	中科三环	17,100	233,244.00	0.02
190	000878	云南铜业	19,432	228,326.00	0.02
191	000060	中金岭南	52,900	216,890.00	0.02
192	601106	中国一重	68,300	200,119.00	0.02
193	688521	芯原股份	4,287	188,928.09	0.02
194	002353	杰瑞股份	4,900	136,759.00	0.01
195	000869	张裕A	4,400	133,056.00	0.01
196	002399	海普瑞	10,200	131,070.00	0.01
197	000783	长江证券	24,100	128,453.00	0.01
198	603589	口子窖	2,200	126,874.00	0.01
199	002745	木林森	15,399	124,885.89	0.01
200	600863	内蒙华电	34,000	118,660.00	0.01
201	300088	长信科技	19,700	117,609.00	0.01
202	300373	扬杰科技	1,900	99,940.00	0.01
203	600315	上海家化	2,912	92,747.20	0.01
204	600021	上海电力	9,200	92,092.00	0.01
205	300888	稳健医疗	1,200	85,800.00	0.01
206	002221	东华能源	9,200	70,196.00	0.01
207	000932	华菱钢铁	13,400	62,980.00	0.01
208	601997	贵阳银行	11,200	61,488.00	0.00
209	601828	美凯龙	11,700	54,873.00	0.00
210	002408	齐翔腾达	7,700	54,208.00	0.00

211	002056	横店东磁	2,700	50,598.00	0.00
212	688301	奕瑞科技	109	49,908.92	0.00
213	600563	法拉电子	300	47,964.00	0.00
214	600350	山东高速	8,300	47,227.00	0.00
215	300012	华测检测	2,000	44,600.00	0.00
216	601077	渝农商行	12,600	44,478.00	0.00
217	002948	青岛银行	13,200	44,352.00	0.00
218	600026	中远海能	3,500	42,175.00	0.00
219	603883	老百姓	958	38,770.26	0.00
220	603456	九洲药业	900	38,187.00	0.00
221	600008	首创环保	10,997	31,121.51	0.00
222	601298	青岛港	5,500	30,855.00	0.00
223	600827	百联股份	2,400	29,088.00	0.00
224	000937	冀中能源	3,900	24,804.00	0.00
225	600131	国网信通	1,500	22,440.00	0.00
226	600787	中储股份	4,400	21,868.00	0.00
227	000830	鲁西化工	1,700	21,063.00	0.00
228	688063	派能科技	21	6,628.65	0.00
229	688208	道通科技	149	4,700.95	0.00
230	300776	帝尔激光	34	4,284.00	0.00
231	000999	华润三九	15	702.15	0.00
232	000703	恒逸石化	25	175.75	0.00
233	000750	国海证券	50	166.50	0.00
234	002266	浙富控股	20	78.20	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	600501	航天晨光	1,060,851	11,648,143.98	0.93
2	600114	东睦股份	1,327,936	11,287,456.00	0.90

3	603708	家家悦	689,200	8,677,028.00	0.69
4	603328	依顿电子	1,159,500	7,525,155.00	0.60
5	000589	贵州轮胎	1,519,766	7,279,679.14	0.58
6	300352	北信源	1,627,800	6,641,424.00	0.53
7	300207	欣旺达	312,700	6,613,605.00	0.53
8	300194	福安药业	1,810,300	6,517,080.00	0.52
9	002463	沪电股份	531,670	6,326,873.00	0.51
10	600210	紫江企业	1,242,900	6,214,500.00	0.50
11	000543	皖能电力	1,290,226	5,780,212.48	0.46
12	688778	厦钨新能	73,154	5,682,602.72	0.45
13	600133	东湖高新	981,200	5,396,600.00	0.43
14	688658	悦康药业	278,012	5,371,191.84	0.43
15	600525	长园集团	1,138,920	5,330,145.60	0.43
16	002540	亚太科技	1,004,100	5,090,787.00	0.41
17	601886	江河集团	645,700	4,997,718.00	0.40
18	603565	中谷物流	330,100	4,799,654.00	0.38
19	002664	信质集团	342,190	4,479,267.10	0.36
20	000931	中关村	720,600	4,431,690.00	0.35
21	601319	中国人保	810,800	4,232,376.00	0.34
22	300624	万兴科技	130,100	3,819,736.00	0.31
23	603136	天目湖	137,133	3,723,160.95	0.30
24	600963	岳阳林纸	669,158	3,646,911.10	0.29
25	600797	浙大网新	594,000	3,474,900.00	0.28
26	301096	百诚医药	46,500	3,176,415.00	0.25
27	000936	华西股份	605,400	3,069,378.00	0.25
28	600073	上海梅林	368,100	2,926,395.00	0.23
29	603612	索通发展	111,500	2,901,230.00	0.23
30	300002	神州泰岳	660,951	2,868,527.34	0.23
31	300232	洲明科技	516,106	2,833,421.94	0.23
32	301039	中集车辆	346,700	2,763,199.00	0.22
33	002938	鹏鼎控股	96,300	2,642,472.00	0.21

34	002746	仙坛股份	266,200	2,438,392.00	0.19
35	603920	世运电路	156,808	2,254,899.04	0.18
36	601595	上海电影	204,100	2,238,977.00	0.18
37	600105	永鼎股份	644,200	2,196,722.00	0.18
38	300725	药石科技	26,802	2,157,561.00	0.17
39	603876	鼎胜新材	50,400	2,068,416.00	0.17
40	603305	旭升集团	58,237	1,877,560.88	0.15
41	601019	山东出版	296,900	1,864,532.00	0.15
42	600343	航天动力	212,719	1,861,291.25	0.15
43	300377	赢时胜	210,700	1,729,847.00	0.14
44	000922	佳电股份	191,300	1,715,961.00	0.14
45	603299	苏盐井神	162,000	1,615,140.00	0.13
46	002338	奥普光电	69,100	1,540,239.00	0.12
47	002004	华邦健康	298,300	1,521,330.00	0.12
48	000823	超声电子	159,030	1,477,388.70	0.12
49	002036	联创电子	111,700	1,381,729.00	0.11
50	002600	领益智造	303,800	1,379,252.00	0.11
51	603886	元祖股份	65,100	1,277,262.00	0.10
52	600754	锦江酒店	21,500	1,254,525.00	0.10
53	603890	春秋电子	133,400	1,219,276.00	0.10
54	601949	中国出版	228,700	1,141,213.00	0.09
55	600685	中船防务	53,900	1,118,964.00	0.09
56	600479	千金药业	115,460	1,108,416.00	0.09
57	600929	雪天盐业	131,800	1,055,718.00	0.08
58	600207	安彩高科	167,848	1,049,050.00	0.08
59	000756	新华制药	34,100	1,026,410.00	0.08
60	002276	万马股份	111,700	921,525.00	0.07
61	600732	爱旭股份	23,700	896,334.00	0.07
62	300748	金力永磁	29,700	869,022.00	0.07
63	600236	桂冠电力	150,800	868,608.00	0.07
64	603609	禾丰股份	67,200	795,648.00	0.06

65	688128	中国电研	44,963	767,968.04	0.06
66	003040	楚天龙	37,800	659,232.00	0.05
67	600219	南山铝业	186,700	610,509.00	0.05
68	002662	京威股份	173,600	571,144.00	0.05
69	600710	苏美达	95,892	563,844.96	0.05
70	300341	麦克奥迪	61,000	537,410.00	0.04
71	600391	航发科技	29,500	524,215.00	0.04
72	601825	沪农商行	84,700	498,036.00	0.04
73	601899	紫金矿业	42,100	421,000.00	0.03
74	002270	华明装备	49,800	383,460.00	0.03
75	000758	中色股份	68,400	324,900.00	0.03
76	688138	清溢光电	16,185	294,567.00	0.02
77	002074	国轩高科	9,600	276,768.00	0.02
78	688231	隆达股份	7,835	275,321.90	0.02
79	603960	克来机电	14,500	257,085.00	0.02
80	002100	天康生物	23,500	195,285.00	0.02
81	688403	汇成股份	18,553	187,756.36	0.02
82	002421	达实智能	47,000	162,620.00	0.01
83	000550	江铃汽车	12,000	161,160.00	0.01
84	000682	东方电子	17,300	139,092.00	0.01
85	688391	钜泉科技	1,397	133,874.51	0.01
86	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.01
87	603108	润达医疗	7,500	75,825.00	0.01
88	601985	中国核电	12,000	72,000.00	0.01
89	002055	得润电子	7,800	67,236.00	0.01
90	688292	浩瀚深度	4,503	66,059.01	0.01
91	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
92	603227	雪峰科技	6,800	56,372.00	0.00
93	000950	重药控股	10,500	53,340.00	0.00
94	300130	新国都	4,400	53,108.00	0.00
95	301308	江波龙	875	49,630.00	0.00

96	002946	新乳业	3,700	48,951.00	0.00
97	000576	甘化科工	4,700	47,752.00	0.00
98	002376	新北洋	7,000	46,830.00	0.00
99	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
100	603968	醋化股份	1,900	41,287.00	0.00
101	002545	东方铁塔	4,900	40,621.00	0.00
102	688599	天合光能	521	33,218.96	0.00
103	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
104	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
105	603301	振德医疗	600	22,830.00	0.00
106	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
107	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
108	301171	易点天下	986	17,471.92	0.00
109	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
110	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
111	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
112	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
113	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
114	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
115	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00

11 6	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
11 7	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
11 8	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
11 9	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
12 0	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
12 1	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
12 2	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
12 3	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
12 4	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
12 5	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
12 6	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
12 7	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
12 8	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
12 9	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
13 0	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
13 1	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
13 2	603529	爱玛科技	40	1,834.80	0.00
13 3	688518	联赢激光	45	1,314.45	0.00



13 4	000063	中兴通讯	47	1,215.42	0.00
13 5	601136	首创证券	39	679.38	0.00
13 6	300602	飞荣达	45	647.55	0.00
13 7	688366	昊海生科	6	585.24	0.00
13 8	002533	金杯电工	36	217.80	0.00
13 9	002085	万丰奥威	22	130.90	0.00
14 0	300134	大富科技	15	116.40	0.00
14 1	601801	皖新传媒	15	78.15	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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603127	昭衍新药	128,661,575.90	10.91
2	600160	巨化股份	124,767,454.22	10.58
3	600968	海油发展	115,101,273.70	9.76
4	300073	当升科技	114,764,943.41	9.73
5	600582	天地科技	112,585,302.58	9.55
6	300308	中际旭创	108,315,688.48	9.19
7	300769	德方纳米	107,805,804.57	9.14
8	601958	金钼股份	107,645,661.48	9.13
9	603613	国联股份	107,579,448.31	9.12
10	603456	九洲药业	107,052,197.20	9.08
11	300363	博腾股份	104,091,275.82	8.83
12	600256	广汇能源	103,625,600.56	8.79

13	600704	物产中大	100,297,171.46	8.51
14	600909	华安证券	97,985,963.25	8.31
15	600497	驰宏锌锗	96,495,263.24	8.18
16	600325	华发股份	94,319,999.64	8.00
17	002815	崇达技术	93,737,400.87	7.95
18	600732	爱旭股份	91,178,693.17	7.73
19	600415	小商品城	90,693,105.05	7.69
20	603317	天味食品	90,578,261.53	7.68
21	600380	健康元	87,640,411.83	7.43
22	000060	中金岭南	87,110,863.25	7.39
23	601992	金隅集团	86,936,640.50	7.37
24	002497	雅化集团	83,632,248.00	7.09
25	600765	中航重机	83,192,074.21	7.05
26	000937	冀中能源	81,793,751.84	6.94
27	688777	中控技术	81,554,795.47	6.92
28	000729	燕京啤酒	81,244,477.13	6.89
29	600037	歌华有线	80,590,788.44	6.83
30	600718	东软集团	80,485,569.79	6.83
31	603290	斯达半导	80,150,497.18	6.80
32	000738	航发控制	79,024,839.23	6.70
33	601872	招商轮船	78,989,193.01	6.70
34	000970	中科三环	78,956,301.10	6.70
35	601717	郑煤机	78,682,343.79	6.67
36	600879	航天电子	78,680,302.68	6.67
37	600027	华电国际	77,483,590.35	6.57
38	600236	桂冠电力	76,885,429.70	6.52
39	600141	兴发集团	76,509,139.39	6.49
40	002384	东山精密	76,330,947.21	6.47
41	002249	大洋电机	76,148,361.81	6.46
42	300724	捷佳伟创	75,930,599.04	6.44
43	600967	内蒙一机	75,785,910.64	6.43

44	601615	明阳智能	75,323,784.10	6.39
45	002422	科伦药业	74,475,017.13	6.32
46	000728	国元证券	74,253,145.16	6.30
47	600705	中航产融	73,770,491.24	6.26
48	600155	华创阳安	73,328,244.07	6.22
49	000598	兴蓉环境	73,224,607.08	6.21
50	600782	新钢股份	73,084,922.88	6.20
51	002756	永兴材料	72,832,113.26	6.18
52	300009	安科生物	72,759,521.75	6.17
53	000686	东北证券	72,742,250.14	6.17
54	600079	人福医药	72,560,096.46	6.15
55	601016	节能风电	72,519,549.38	6.15
56	000513	丽珠集团	72,058,584.68	6.11
57	000559	万向钱潮	71,347,806.86	6.05
58	000988	华工科技	70,684,326.58	5.99
59	002705	新宝股份	70,517,324.10	5.98
60	600699	均胜电子	70,515,013.94	5.98
61	300630	普利制药	70,175,673.70	5.95
62	601456	国联证券	70,007,098.62	5.94
63	601991	大唐发电	69,495,947.26	5.89
64	600737	中粮糖业	69,370,303.70	5.88
65	688099	晶晨股份	68,808,251.19	5.84
66	300037	新宙邦	68,723,360.96	5.83
67	688006	杭可科技	68,720,110.18	5.83
68	000031	大悦城	68,682,067.98	5.82
69	601598	中国外运	68,278,986.98	5.79
70	688122	西部超导	68,274,047.13	5.79
71	600580	卧龙电驱	67,589,956.16	5.73
72	300170	汉得信息	67,420,898.58	5.72
73	600233	圆通速递	66,562,039.32	5.64
74	002004	华邦健康	66,471,249.90	5.64

75	000563	陕国投A	66,083,365.22	5.60
76	002507	涪陵榨菜	65,870,691.48	5.59
77	600392	盛和资源	65,656,244.51	5.57
78	300017	网宿科技	65,594,599.11	5.56
79	002240	盛新锂能	65,424,590.32	5.55
80	000012	南玻A	65,408,789.56	5.55
81	002399	海普瑞	65,371,863.86	5.54
82	600315	上海家化	65,175,238.85	5.53
83	601077	渝农商行	64,807,596.61	5.50
84	688559	海目星	64,806,523.80	5.50
85	000983	山西焦煤	64,039,683.18	5.43
86	600959	江苏有线	63,894,596.00	5.42
87	000553	安道麦A	63,501,937.17	5.39
88	600282	南钢股份	63,208,065.80	5.36
89	002946	新乳业	62,788,972.53	5.32
90	688390	固德威	62,711,833.75	5.32
91	002124	天邦食品	62,587,061.27	5.31
92	002273	水晶光电	61,913,664.91	5.25
93	300699	光威复材	61,830,097.63	5.24
94	002385	大北农	61,680,494.00	5.23
95	600039	四川路桥	60,943,739.26	5.17
96	600549	厦门钨业	60,865,236.66	5.16
97	600060	海信视像	60,811,474.04	5.16
98	688518	联赢激光	60,348,762.56	5.12
99	600026	中远海能	60,165,890.40	5.10
100	002505	鹏都农牧	59,513,492.80	5.05
101	600839	四川长虹	59,509,209.00	5.05
102	002690	美亚光电	59,468,776.35	5.04
103	002180	纳思达	59,432,597.76	5.04
104	000778	新兴铸管	59,227,859.50	5.02
105	002191	劲嘉股份	59,046,605.50	5.01

106	002683	广东宏大	58,820,400.14	4.99
107	600438	通威股份	58,512,841.70	4.96
108	600863	内蒙华电	57,605,219.12	4.89
109	600521	华海药业	57,131,170.74	4.84
110	002444	巨星科技	57,028,409.83	4.84
111	600885	宏发股份	56,979,291.62	4.83
112	601928	凤凰传媒	56,923,641.78	4.83
113	601179	中国西电	56,700,429.43	4.81
114	600811	东方集团	56,602,856.12	4.80
115	600673	东阳光	56,284,862.78	4.77
116	600066	宇通客车	56,223,281.48	4.77
117	002562	兄弟科技	55,523,526.93	4.71
118	000543	皖能电力	55,398,005.35	4.70
119	600901	江苏金租	55,253,131.19	4.69
120	600522	中天科技	55,119,325.28	4.67
121	688819	天能股份	55,060,384.29	4.67
122	605117	德业股份	54,989,584.77	4.66
123	000878	云南铜业	54,842,699.64	4.65
124	600597	光明乳业	54,823,764.40	4.65
125	600787	中储股份	54,556,191.10	4.63
126	000629	钒钛股份	54,239,981.27	4.60
127	002250	联化科技	53,921,602.95	4.57
128	600500	中化国际	53,785,166.63	4.56
129	600525	长园集团	53,289,646.28	4.52
130	603355	莱克电气	53,032,715.34	4.50
131	603259	药明康德	53,026,750.92	4.50
132	300244	迪安诊断	52,954,832.53	4.49
133	600728	佳都科技	52,822,523.42	4.48
134	600348	华阳股份	52,748,547.48	4.47
135	600208	新湖中宝	52,045,251.00	4.41
136	600873	梅花生物	51,803,828.90	4.39

137	601162	天风证券	51,681,038.05	4.38
138	600166	福田汽车	51,414,076.47	4.36
139	300136	信维通信	51,399,450.20	4.36
140	300182	捷成股份	51,334,090.52	4.35
141	002057	中钢天源	51,282,605.00	4.35
142	002468	申通快递	51,150,851.91	4.34
143	601555	东吴证券	50,484,536.56	4.28
144	600546	山煤国际	50,129,187.88	4.25
145	688005	容百科技	49,938,123.74	4.23
146	000519	中兵红箭	49,669,880.00	4.21
147	002500	山西证券	49,577,517.17	4.20
148	601611	中国核建	49,394,748.94	4.19
149	300118	东方日升	49,263,028.31	4.18
150	002409	雅克科技	49,249,888.08	4.18
151	688050	爱博医疗	49,203,860.10	4.17
152	688009	中国通号	49,022,612.66	4.16
153	603659	璞泰来	48,874,120.97	4.14
154	600717	天津港	48,817,271.15	4.14
155	002583	海能达	48,770,224.09	4.14
156	000975	银泰黄金	48,653,712.00	4.13
157	600435	北方导航	48,635,137.37	4.12
158	000887	中鼎股份	48,214,147.62	4.09
159	002152	广电运通	48,077,959.73	4.08
160	000402	金融街	48,042,155.38	4.07
161	600649	城投控股	47,941,272.04	4.07
162	601298	青岛港	47,932,892.59	4.06
163	603379	三美股份	47,882,855.75	4.06
164	601778	晶科科技	47,625,635.28	4.04
165	600201	生物股份	47,414,282.70	4.02
166	002390	信邦制药	47,284,098.15	4.01
167	600563	法拉电子	47,237,075.76	4.01

168	600867	通化东宝	46,621,878.41	3.95
169	600008	首创环保	46,597,481.78	3.95
170	603233	大参林	46,324,911.53	3.93
171	000960	锡业股份	46,220,463.00	3.92
172	002081	金螳螂	46,123,961.10	3.91
173	600499	科达制造	46,121,256.58	3.91
174	603198	迎驾贡酒	46,107,322.94	3.91
175	603719	良品铺子	46,029,518.47	3.90
176	601108	财通证券	45,949,975.34	3.90
177	601866	中远海发	45,863,853.54	3.89
178	300866	安克创新	45,587,092.39	3.87
179	000997	新大陆	45,539,047.15	3.86
180	000750	国海证券	45,482,278.12	3.86
181	601860	紫金银行	45,458,360.36	3.86
182	300217	东方电热	45,305,045.70	3.84
183	002739	万达电影	45,231,830.40	3.84
184	601168	西部矿业	45,175,226.92	3.83
185	688516	奥特维	45,115,820.16	3.83
186	300001	特锐德	44,990,352.00	3.82
187	600298	安琪酵母	44,944,820.40	3.81
188	000021	深科技	44,907,741.48	3.81
189	600398	海澜之家	44,752,458.30	3.80
190	002948	青岛银行	44,499,962.90	3.77
191	600572	康恩贝	44,397,034.02	3.77
192	601699	潞安环能	44,357,595.40	3.76
193	688123	聚辰股份	44,262,392.11	3.75
194	002048	宁波华翔	44,234,895.21	3.75
195	002920	德赛西威	44,163,015.43	3.75
196	300861	美畅股份	44,080,485.98	3.74
197	600259	广晟有色	44,038,375.37	3.73
198	002419	天虹股份	43,810,605.00	3.72

199	603345	安井食品	43,496,335.32	3.69
200	601128	常熟银行	43,280,825.96	3.67
201	002294	信立泰	43,020,443.81	3.65
202	603228	景旺电子	42,709,703.92	3.62
203	002745	木林森	42,425,102.37	3.60
204	601058	赛轮轮胎	42,216,521.95	3.58
205	000733	振华科技	42,164,032.00	3.58
206	600409	三友化工	42,068,795.25	3.57
207	603866	桃李面包	41,979,768.61	3.56
208	002958	青农商行	41,919,291.74	3.55
209	600985	淮北矿业	41,841,827.77	3.55
210	603392	万泰生物	41,482,614.89	3.52
211	300775	三角防务	41,394,141.39	3.51
212	600795	国电电力	41,118,675.00	3.49
213	002831	裕同科技	40,972,415.60	3.47
214	000630	铜陵有色	40,938,927.72	3.47
215	600862	中航高科	40,853,208.22	3.46
216	000739	普洛药业	40,610,825.15	3.44
217	000709	河钢股份	40,574,575.90	3.44
218	600038	中直股份	40,431,709.41	3.43
219	688556	高测股份	40,290,224.87	3.42
220	600114	东睦股份	40,033,322.16	3.39
221	688063	派能科技	40,025,966.32	3.39
222	688202	美迪西	40,005,256.36	3.39
223	688499	利元亨	39,995,752.99	3.39
224	600339	中油工程	39,942,526.50	3.39
225	000009	中国宝安	39,899,991.34	3.38
226	002460	赣锋锂业	39,855,983.59	3.38
227	300212	易华录	39,757,333.80	3.37
228	300759	康龙化成	39,604,356.33	3.36
229	688521	芯原股份	39,506,140.95	3.35



230	688599	天合光能	39,403,223.43	3.34
231	300223	北京君正	39,234,907.92	3.33
232	600501	航天晨光	39,064,130.02	3.31
233	000959	首钢股份	38,989,343.57	3.31
234	002128	电投能源	38,954,688.30	3.30
235	601339	百隆东方	38,953,639.22	3.30
236	300772	运达股份	38,933,964.00	3.30
237	002673	西部证券	38,883,462.17	3.30
238	600623	华谊集团	38,872,869.41	3.30
239	601139	深圳燃气	38,815,899.15	3.29
240	601828	美凯龙	38,712,194.15	3.28
241	600988	赤峰黄金	38,706,305.28	3.28
242	600739	辽宁成大	38,613,949.50	3.27
243	002268	电科网安	38,585,239.76	3.27
244	603605	珀莱雅	38,342,141.22	3.25
245	002572	索菲亚	38,293,092.09	3.25
246	600428	中远海特	38,067,852.81	3.23
247	002212	天融信	38,020,244.66	3.22
248	688029	南微医学	37,941,692.99	3.22
249	002985	北摩高科	37,702,371.29	3.20
250	300390	天华超净	37,648,691.92	3.19
251	600820	隧道股份	37,585,319.00	3.19
252	300450	先导智能	37,503,869.87	3.18
253	300409	道氏技术	37,412,960.00	3.17
254	601933	永辉超市	37,252,240.52	3.16
255	002532	天山铝业	37,088,239.00	3.15
256	605358	立昂微	37,057,901.75	3.14
257	600487	亨通光电	36,825,667.70	3.12
258	000589	贵州轮胎	36,750,089.26	3.12
259	002042	华孚时尚	36,647,172.34	3.11
260	600528	中铁工业	36,486,906.28	3.09

261	603939	益丰药房	36,323,770.40	3.08
262	603236	移远通信	36,117,135.96	3.06
263	002056	横店东磁	36,031,018.59	3.06
264	002466	天齐锂业	35,985,273.04	3.05
265	000932	华菱钢铁	35,972,315.46	3.05
266	300890	翔丰华	35,904,833.96	3.04
267	300332	天壕环境	35,869,356.00	3.04
268	300763	锦浪科技	35,614,918.74	3.02
269	300146	汤臣倍健	35,611,680.85	3.02
270	000700	模塑科技	35,504,901.20	3.01
271	600941	中国移动	35,491,386.61	3.01
272	000656	金科股份	35,459,226.40	3.01
273	601696	中银证券	35,358,425.00	3.00
274	300634	彩讯股份	35,317,608.87	3.00
275	000783	长江证券	35,004,305.43	2.97
276	300347	泰格医药	34,943,327.91	2.96
277	000987	越秀资本	34,897,185.83	2.96
278	000930	中粮科技	34,814,243.00	2.95
279	002375	亚厦股份	34,801,669.08	2.95
280	603077	和邦生物	34,690,380.31	2.94
281	600089	特变电工	34,679,591.16	2.94
282	002465	海格通信	34,536,073.90	2.93
283	600801	华新水泥	34,446,029.49	2.92
284	300750	宁德时代	34,420,986.93	2.92
285	300457	赢合科技	34,331,517.64	2.91
286	002624	完美世界	34,286,478.86	2.91
287	300751	迈为股份	34,233,434.66	2.90
288	002416	爱施德	34,177,069.44	2.90
289	600808	马钢股份	34,139,484.84	2.90
290	000883	湖北能源	34,094,576.00	2.89
291	601098	中南传媒	33,809,709.53	2.87

292	300661	圣邦股份	33,762,226.98	2.86
293	688008	澜起科技	33,714,242.71	2.86
294	603920	世运电路	33,708,223.46	2.86
295	002410	广联达	33,523,429.67	2.84
296	002511	中顺洁柔	33,281,663.30	2.82
297	688680	海优新材	33,259,141.89	2.82
298	600170	上海建工	33,084,043.40	2.81
299	300088	长信科技	32,847,104.00	2.79
300	688208	道通科技	32,825,202.33	2.78
301	000401	冀东水泥	32,811,928.00	2.78
302	600710	苏美达	32,797,458.46	2.78
303	002299	圣农发展	32,788,831.73	2.78
304	600888	新疆众和	32,693,406.00	2.77
305	600583	海油工程	32,675,655.85	2.77
306	002557	洽洽食品	32,555,648.28	2.76
307	601665	齐鲁银行	32,305,420.12	2.74
308	002049	紫光国微	32,248,920.64	2.73
309	000961	中南建设	32,174,842.00	2.73
310	688012	中微公司	32,155,155.54	2.73
311	601198	东兴证券	32,061,073.00	2.72
312	688800	瑞可达	31,965,578.16	2.71
313	600643	爱建集团	31,804,792.76	2.70
314	002821	凯莱英	31,719,685.88	2.69
315	600617	国新能源	31,557,280.61	2.68
316	688536	思瑞浦	31,508,395.44	2.67
317	002407	多氟多	31,505,628.90	2.67
318	600210	紫江企业	31,467,503.00	2.67
319	002439	启明星辰	31,432,819.00	2.67
320	601000	唐山港	31,429,419.10	2.67
321	601908	京运通	31,428,586.52	2.67
322	300134	大富科技	31,428,441.36	2.67

323	600120	浙江东方	31,408,647.12	2.66
324	603328	依顿电子	31,372,363.00	2.66
325	600271	航天信息	31,365,182.76	2.66
326	002281	光迅科技	31,346,126.31	2.66
327	300568	星源材质	31,288,911.86	2.65
328	003035	南网能源	31,259,038.78	2.65
329	600021	上海电力	31,234,755.00	2.65
330	002594	比亚迪	31,144,462.00	2.64
331	600143	金发科技	30,835,153.54	2.61
332	002850	科达利	30,810,031.00	2.61
333	600598	北大荒	30,747,604.05	2.61
334	600639	浦东金桥	30,642,481.12	2.60
335	600299	安迪苏	30,601,385.09	2.60
336	002146	荣盛发展	30,569,258.04	2.59
337	688088	虹软科技	30,420,256.85	2.58
338	002597	金禾实业	30,228,115.22	2.56
339	300115	长盈精密	30,219,492.28	2.56
340	002353	杰瑞股份	30,181,067.82	2.56
341	600329	达仁堂	30,085,396.59	2.55
342	600373	中文传媒	29,994,711.48	2.54
343	600498	烽火通信	29,808,999.08	2.53
344	300896	爱美客	29,780,399.75	2.53
345	300179	四方达	29,652,542.00	2.51
346	000718	苏宁环球	29,570,174.20	2.51
347	600105	永鼎股份	29,537,779.40	2.50
348	300825	阿尔特	29,487,466.20	2.50
349	600390	五矿资本	29,383,007.20	2.49
350	300316	晶盛机电	29,270,105.00	2.48
351	600578	京能电力	29,035,657.00	2.46
352	688200	华峰测控	29,006,187.06	2.46
353	000541	佛山照明	28,736,932.00	2.44

354	600566	济川药业	28,590,826.22	2.42
355	300418	昆仑万维	28,578,047.35	2.42
356	603589	口子窖	28,533,024.10	2.42
357	603517	绝味食品	28,495,521.21	2.42
358	688508	芯朋微	28,423,526.33	2.41
359	000758	中色股份	28,337,444.49	2.40
360	300474	景嘉微	28,326,186.40	2.40
361	300352	北信源	28,120,955.20	2.38
362	001914	招商积余	28,113,810.45	2.38
363	300482	万孚生物	28,069,464.65	2.38
364	600872	中炬高新	28,029,537.63	2.38
365	000898	鞍钢股份	27,984,300.58	2.37
366	600064	南京高科	27,941,551.64	2.37
367	600067	冠城大通	27,850,203.62	2.36
368	601666	平煤股份	27,714,859.00	2.35
369	000027	深圳能源	27,639,524.20	2.34
370	600297	广汇汽车	27,490,082.00	2.33
371	601118	海南橡胶	27,473,863.70	2.33
372	600372	中航电子	27,472,999.22	2.33
373	688778	厦钨新能	27,418,787.49	2.33
374	600648	外高桥	27,399,294.22	2.32
375	000690	宝新能源	27,358,814.00	2.32
376	000785	居然之家	27,325,055.71	2.32
377	002625	光启技术	27,198,595.53	2.31
378	600126	杭钢股份	27,187,766.00	2.31
379	600875	东方电气	27,182,794.62	2.31
380	300401	花园生物	26,927,774.00	2.28
381	600073	上海梅林	26,925,330.30	2.28
382	600970	中材国际	26,818,683.18	2.27
383	601187	厦门银行	26,802,537.00	2.27
384	601117	中国化学	26,752,166.71	2.27

385	600642	申能股份	26,692,766.93	2.26
386	601975	招商南油	26,633,399.32	2.26
387	002545	东方铁塔	26,576,460.84	2.25
388	688298	东方生物	26,516,906.50	2.25
389	002675	东诚药业	26,436,725.26	2.24
390	603766	隆鑫通用	26,385,979.98	2.24
391	002301	齐心集团	26,356,535.00	2.24
392	601969	海南矿业	26,229,828.49	2.22
393	300072	海新能科	26,229,138.77	2.22
394	688321	微芯生物	26,227,862.41	2.22
395	300253	卫宁健康	26,083,937.35	2.21
396	002019	亿帆医药	26,062,377.00	2.21
397	300832	新产业	26,054,756.80	2.21
398	600662	外服控股	26,035,283.55	2.21
399	601001	晋控煤业	25,854,349.10	2.19
400	000703	恒逸石化	25,796,961.00	2.19
401	603876	鼎胜新材	25,663,343.07	2.18
402	000488	晨鸣纸业	25,613,528.76	2.17
403	002563	森马服饰	25,598,127.09	2.17
404	600758	辽宁能源	25,496,390.00	2.16
405	601228	广州港	25,479,679.53	2.16
406	002291	遥望科技	25,397,046.94	2.15
407	000039	中集集团	25,355,646.00	2.15
408	603118	共进股份	25,324,716.32	2.15
409	000567	海德股份	25,266,079.89	2.14
410	002010	传化智联	25,259,328.05	2.14
411	000301	东方盛虹	25,029,620.00	2.12
412	600486	扬农化工	24,544,031.00	2.08
413	300130	新国都	24,527,029.37	2.08
414	300725	药石科技	24,516,985.16	2.08
415	002966	苏州银行	24,107,311.77	2.04

416	600258	首旅酒店	24,055,945.34	2.04
417	601231	环旭电子	23,886,190.55	2.03
418	601808	中海油服	23,719,146.39	2.01
419	600755	厦门国贸	23,632,132.00	2.00

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603127	昭衍新药	121,271,579.45	10.28
2	600256	广汇能源	116,766,322.04	9.90
3	600160	巨化股份	114,836,512.60	9.74
4	601958	金钼股份	112,495,121.88	9.54
5	600968	海油发展	112,232,013.07	9.52
6	300073	当升科技	108,816,471.95	9.23
7	603613	国联股份	108,759,397.04	9.22
8	603456	九洲药业	108,487,699.87	9.20
9	300363	博腾股份	107,393,415.18	9.11
10	300769	德方纳米	107,318,281.89	9.10
11	600582	天地科技	106,278,723.43	9.01
12	300308	中际旭创	103,518,388.90	8.78
13	600497	驰宏锌锗	101,799,427.61	8.63
14	600704	物产中大	100,095,355.24	8.49
15	002815	崇达技术	97,134,375.55	8.24
16	600325	华发股份	96,692,758.52	8.20
17	600909	华安证券	91,086,294.93	7.72
18	600732	爱旭股份	89,854,064.58	7.62
19	000060	中金岭南	87,626,299.29	7.43
20	601872	招商轮船	87,506,993.69	7.42

21	601615	明阳智能	87,421,372.43	7.41
22	600765	中航重机	86,596,460.52	7.34
23	603317	天味食品	83,846,564.30	7.11
24	000937	冀中能源	83,080,115.49	7.05
25	600380	健康元	82,973,353.77	7.04
26	603290	斯达半导	82,141,214.61	6.97
27	600415	小商品城	81,395,143.33	6.90
28	600037	歌华有线	81,120,359.42	6.88
29	600027	华电国际	81,062,145.87	6.87
30	002497	雅化集团	80,989,891.73	6.87
31	688777	中控技术	80,313,400.95	6.81
32	600879	航天电子	79,264,447.78	6.72
33	002384	东山精密	78,732,833.51	6.68
34	600141	兴发集团	77,787,133.78	6.60
35	601992	金隅集团	77,705,243.57	6.59
36	601717	郑煤机	77,321,160.47	6.56
37	000970	中科三环	76,238,564.95	6.47
38	000598	兴蓉环境	75,452,304.33	6.40
39	300724	捷佳伟创	74,952,185.35	6.36
40	600236	桂冠电力	74,700,508.79	6.33
41	600079	人福医药	73,940,082.05	6.27
42	600155	华创阳安	73,579,623.77	6.24
43	601016	节能风电	73,571,778.58	6.24
44	002756	永兴材料	73,547,534.42	6.24
45	600782	新钢股份	73,179,020.23	6.21
46	000031	大悦城	73,119,017.31	6.20
47	000738	航发控制	73,040,321.00	6.19
48	300037	新宙邦	73,026,635.62	6.19
49	000686	东北证券	72,975,723.13	6.19
50	601991	大唐发电	72,777,964.95	6.17
51	000988	华工科技	72,758,582.36	6.17



52	600718	东软集团	72,730,946.76	6.17
53	601456	国联证券	72,039,404.40	6.11
54	600967	内蒙一机	70,936,175.16	6.02
55	000559	万向钱潮	70,617,663.87	5.99
56	600705	中航产融	70,486,859.68	5.98
57	600737	中粮糖业	70,451,252.10	5.97
58	688122	西部超导	70,425,337.56	5.97
59	688006	杭可科技	70,076,006.98	5.94
60	000729	燕京啤酒	69,932,659.64	5.93
61	601077	渝农商行	69,365,336.41	5.88
62	600282	南钢股份	68,413,409.90	5.80
63	300170	汉得信息	67,025,769.64	5.68
64	688099	晶晨股份	66,766,444.95	5.66
65	600233	圆通速递	66,555,500.58	5.64
66	600315	上海家化	66,540,530.85	5.64
67	000513	丽珠集团	66,221,463.17	5.62
68	002240	盛新锂能	65,626,258.01	5.57
69	000563	陕国投A	65,599,313.99	5.56
70	002249	大洋电机	65,512,522.71	5.56
71	688559	海目星	65,367,956.10	5.54
72	000983	山西焦煤	64,958,314.92	5.51
73	600392	盛和资源	64,742,995.00	5.49
74	300630	普利制药	64,526,747.10	5.47
75	002004	华邦健康	64,336,078.67	5.46
76	002399	海普瑞	64,261,021.18	5.45
77	002124	天邦食品	63,741,779.23	5.41
78	300699	光威复材	63,689,717.87	5.40
79	601598	中国外运	63,114,250.26	5.35
80	600026	中远海能	62,906,829.26	5.33
81	002422	科伦药业	62,827,318.29	5.33
82	000728	国元证券	62,579,620.20	5.31

83	002946	新乳业	62,410,543.62	5.29
84	688390	固德威	61,913,672.99	5.25
85	688518	联赢激光	61,836,500.18	5.24
86	300009	安科生物	61,751,571.34	5.24
87	002385	大北农	61,459,834.00	5.21
88	688005	容百科技	61,392,813.68	5.21
89	002191	劲嘉股份	60,946,845.95	5.17
90	600863	内蒙华电	60,379,105.94	5.12
91	002690	美亚光电	60,229,470.26	5.11
92	000629	钒钛股份	60,174,652.74	5.10
93	600039	四川路桥	60,042,364.80	5.09
94	002507	涪陵榨菜	60,003,382.80	5.09
95	600673	东阳光	59,877,477.28	5.08
96	002505	鹏都农牧	59,843,058.50	5.07
97	600546	山煤国际	59,768,866.70	5.07
98	000553	安道麦A	59,440,295.14	5.04
99	600438	通威股份	59,297,206.70	5.03
100	600580	卧龙电驱	59,264,393.59	5.03
101	002705	新宝股份	59,121,530.61	5.01
102	601928	凤凰传媒	58,861,262.29	4.99
103	002180	纳思达	58,832,361.57	4.99
104	600060	海信视像	58,391,078.28	4.95
105	600521	华海药业	58,376,473.00	4.95
106	600839	四川长虹	57,792,591.33	4.90
107	600522	中天科技	57,533,601.76	4.88
108	000012	南玻A	57,217,366.93	4.85
109	300136	信维通信	56,956,071.30	4.83
110	002562	兄弟科技	56,521,930.44	4.79
111	600811	东方集团	56,359,803.45	4.78
112	600699	均胜电子	56,197,186.20	4.77
113	300244	迪安诊断	56,089,671.47	4.76

114	600787	中储股份	56,000,025.05	4.75
115	603659	璞泰来	55,787,585.08	4.73
116	600066	宇通客车	55,616,784.56	4.72
117	600597	光明乳业	55,538,266.35	4.71
118	000960	锡业股份	55,521,783.20	4.71
119	300017	网宿科技	55,354,071.45	4.69
120	000878	云南铜业	55,062,056.73	4.67
121	601179	中国西电	54,614,143.34	4.63
122	002273	水晶光电	54,458,781.55	4.62
123	600901	江苏金租	54,350,417.08	4.61
124	600959	江苏有线	53,837,077.90	4.57
125	603259	药明康德	53,747,641.71	4.56
126	600348	华阳股份	53,742,436.02	4.56
127	002468	申通快递	53,275,752.60	4.52
128	300118	东方日升	53,200,375.46	4.51
129	600728	佳都科技	52,934,529.36	4.49
130	300182	捷成股份	52,620,737.20	4.46
131	605117	德业股份	52,535,529.01	4.46
132	002683	广东宏大	52,237,017.14	4.43
133	000543	皖能电力	52,187,238.48	4.43
134	600201	生物股份	51,848,593.82	4.40
135	600166	福田汽车	51,666,269.76	4.38
136	601128	常熟银行	51,635,865.78	4.38
137	002057	中钢天源	51,634,762.25	4.38
138	600500	中化国际	51,541,227.46	4.37
139	000887	中鼎股份	51,411,633.24	4.36
140	600867	通化东宝	51,087,144.01	4.33
141	002152	广电运通	51,019,980.96	4.33
142	688516	奥特维	50,738,715.54	4.30
143	600008	首创环保	50,710,546.76	4.30
144	601162	天风证券	50,522,455.66	4.28

145	002583	海能达	50,302,154.66	4.27
146	601778	晶科科技	50,052,270.72	4.24
147	603198	迎驾贡酒	49,902,281.53	4.23
148	600885	宏发股份	49,901,128.74	4.23
149	688050	爱博医疗	49,504,524.57	4.20
150	601339	百隆东方	49,445,181.78	4.19
151	600717	天津港	49,372,927.41	4.19
152	603379	三美股份	49,201,653.00	4.17
153	601611	中国核建	49,108,415.13	4.16
154	600435	北方导航	49,012,979.92	4.16
155	601555	东吴证券	48,999,233.24	4.16
156	002500	山西证券	48,769,212.04	4.14
157	688009	中国通号	48,581,105.50	4.12
158	600208	新湖中宝	48,529,925.28	4.12
159	601298	青岛港	48,461,843.08	4.11
160	000519	中兵红箭	48,253,456.54	4.09
161	600649	城投控股	48,186,788.13	4.09
162	002419	天虹股份	47,707,916.02	4.05
163	600525	长园集团	47,605,690.02	4.04
164	600549	厦门钨业	47,542,170.67	4.03
165	300217	东方电热	47,002,253.20	3.99
166	002390	信邦制药	46,936,789.15	3.98
167	600873	梅花生物	46,904,649.90	3.98
168	000630	铜陵有色	46,577,914.00	3.95
169	603355	莱克电气	46,553,889.68	3.95
170	600862	中航高科	46,327,722.56	3.93
171	000402	金融街	46,258,905.52	3.92
172	000778	新兴铸管	46,201,618.74	3.92
173	300775	三角防务	46,032,897.54	3.90
174	000750	国海证券	45,931,370.01	3.90
175	000733	振华科技	45,790,925.30	3.88

176	601866	中远海发	45,659,111.63	3.87
177	002409	雅克科技	45,564,372.65	3.86
178	000021	深科技	45,465,954.87	3.86
179	600563	法拉电子	45,461,608.51	3.86
180	002081	金螳螂	45,134,279.21	3.83
181	688819	天能股份	44,986,043.11	3.81
182	601860	紫金银行	44,691,804.66	3.79
183	002948	青岛银行	44,413,877.40	3.77
184	688123	聚辰股份	44,319,777.05	3.76
185	002920	德赛西威	44,283,474.30	3.76
186	600499	科达制造	44,239,344.40	3.75
187	600572	康恩贝	43,784,842.44	3.71
188	000997	新大陆	43,465,018.11	3.69
189	300001	特锐德	42,869,598.96	3.64
190	002042	华孚时尚	42,746,331.83	3.63
191	601699	潞安环能	42,654,850.30	3.62
192	002444	巨星科技	42,615,318.15	3.61
193	603392	万泰生物	42,488,075.62	3.60
194	600487	亨通光电	41,883,403.67	3.55
195	002739	万达电影	41,831,880.85	3.55
196	603345	安井食品	41,768,668.06	3.54
197	603719	良品铺子	41,487,147.63	3.52
198	002250	联化科技	41,480,259.48	3.52
199	688556	高测股份	41,409,511.13	3.51
200	000009	中国宝安	41,170,263.64	3.49
201	000656	金科股份	41,110,400.27	3.49
202	600409	三友化工	41,017,550.36	3.48
203	688202	美迪西	41,011,402.29	3.48
204	300751	迈为股份	40,863,296.74	3.47
205	600795	国电电力	40,783,637.40	3.46
206	688063	派能科技	40,633,591.20	3.45

207	600820	隧道股份	40,520,589.23	3.44
208	000709	河钢股份	40,475,394.94	3.43
209	002745	木林森	40,470,704.71	3.43
210	000932	华菱钢铁	40,290,065.86	3.42
211	002958	青农商行	40,168,963.33	3.41
212	688599	天合光能	40,076,148.58	3.40
213	688521	芯原股份	40,025,409.82	3.39
214	603866	桃李面包	40,015,429.59	3.39
215	600623	华谊集团	39,703,953.34	3.37
216	300772	运达股份	39,678,947.01	3.36
217	002460	赣锋锂业	39,537,044.76	3.35
218	300759	康龙化成	39,382,276.37	3.34
219	002624	完美世界	39,379,927.96	3.34
220	300409	道氏技术	39,352,428.00	3.34
221	000975	银泰黄金	39,278,236.20	3.33
222	601828	美凯龙	39,271,405.67	3.33
223	002294	信立泰	39,200,726.80	3.32
224	600988	赤峰黄金	39,157,323.44	3.32
225	002128	电投能源	39,150,357.00	3.32
226	603233	大参林	39,118,739.02	3.32
227	600339	中油工程	39,098,486.30	3.32
228	002410	广联达	38,982,150.87	3.31
229	000959	首钢股份	38,859,746.63	3.30
230	002821	凯莱英	38,836,959.11	3.29
231	300390	天华超净	38,715,975.00	3.28
232	300088	长信科技	38,699,885.02	3.28
233	300212	易华录	38,503,090.77	3.27
234	688499	利元亨	38,481,387.94	3.26
235	002268	电科网安	38,410,635.64	3.26
236	603228	景旺电子	38,407,611.87	3.26
237	300450	先导智能	38,375,553.22	3.25

238	600739	辽宁成大	38,286,931.59	3.25
239	002212	天融信	38,149,309.91	3.24
240	600808	马钢股份	37,545,322.26	3.18
241	300223	北京君正	37,321,667.63	3.16
242	600428	中远海特	37,277,076.25	3.16
243	002532	天山铝业	37,104,122.00	3.15
244	603236	移远通信	37,066,407.14	3.14
245	600259	广晟有色	36,999,447.05	3.14
246	002985	北摩高科	36,918,153.23	3.13
247	600298	安琪酵母	36,852,265.68	3.13
248	002831	裕同科技	36,722,341.29	3.11
249	300763	锦浪科技	36,467,767.53	3.09
250	603605	珀莱雅	36,410,640.40	3.09
251	300634	彩讯股份	36,208,768.92	3.07
252	002049	紫光国微	36,197,618.95	3.07
253	600583	海油工程	36,179,465.50	3.07
254	000700	模塑科技	36,125,971.40	3.06
255	002375	亚厦股份	35,950,211.69	3.05
256	600941	中国移动	35,938,726.64	3.05
257	300146	汤臣倍健	35,909,342.91	3.05
258	002048	宁波华翔	35,848,816.55	3.04
259	601168	西部矿业	35,811,884.44	3.04
260	605358	立昂微	35,583,047.43	3.02
261	688029	南微医学	35,397,981.60	3.00
262	002056	横店东磁	35,367,363.83	3.00
263	601098	中南传媒	35,245,655.47	2.99
264	300890	翔丰华	35,010,724.00	2.97
265	002466	天齐锂业	34,960,901.95	2.96
266	601933	永辉超市	34,756,972.52	2.95
267	300332	天壕环境	34,685,596.00	2.94
268	002673	西部证券	34,522,761.04	2.93

269	300750	宁德时代	34,502,061.30	2.93
270	300661	圣邦股份	34,416,245.60	2.92
271	603077	和邦生物	34,309,484.15	2.91
272	600528	中铁工业	34,274,042.68	2.91
273	000783	长江证券	34,266,504.09	2.91
274	601108	财通证券	34,127,179.66	2.89
275	688508	芯朋微	34,115,063.23	2.89
276	300866	安克创新	34,043,953.02	2.89
277	600888	新疆众和	33,923,583.24	2.88
278	688008	澜起科技	33,912,381.11	2.88
279	600089	特变电工	33,902,830.30	2.88
280	002511	中顺洁柔	33,836,781.65	2.87
281	300347	泰格医药	33,659,900.60	2.85
282	601058	赛轮轮胎	33,456,261.74	2.84
283	000930	中粮科技	33,426,934.00	2.83
284	300418	昆仑万维	32,901,282.84	2.79
285	300474	景嘉微	32,765,403.00	2.78
286	688680	海优新材	32,732,716.94	2.78
287	600398	海澜之家	32,730,223.68	2.78
288	002146	荣盛发展	32,700,164.39	2.77
289	000739	普洛药业	32,620,318.00	2.77
290	688536	思瑞浦	32,613,080.29	2.77
291	688208	道通科技	32,538,848.86	2.76
292	600801	华新水泥	32,527,497.30	2.76
293	600170	上海建工	32,456,558.29	2.75
294	002572	索菲亚	32,455,324.47	2.75
295	600617	国新能源	32,338,751.87	2.74
296	688800	瑞可达	32,317,926.18	2.74
297	002597	金禾实业	32,270,492.18	2.74
298	300457	赢合科技	32,235,283.01	2.73
299	601696	中银证券	32,183,250.00	2.73



300	688012	中微公司	32,129,139.45	2.72
301	600985	淮北矿业	32,087,255.64	2.72
302	002407	多氟多	31,843,145.19	2.70
303	600021	上海电力	31,829,499.17	2.70
304	003035	南网能源	31,823,534.03	2.70
305	000401	冀东水泥	31,781,203.00	2.70
306	603920	世运电路	31,746,131.82	2.69
307	600643	爱建集团	31,742,984.12	2.69
308	603589	口子窖	31,620,209.00	2.68
309	600373	中文传媒	31,605,782.79	2.68
310	002439	启明星辰	31,594,801.96	2.68
311	600710	苏美达	31,543,575.97	2.67
312	600639	浦东金桥	31,515,478.24	2.67
313	000987	越秀资本	31,452,875.38	2.67
314	002850	科达利	31,336,740.40	2.66
315	600038	中直股份	31,302,782.31	2.65
316	601908	京运通	31,194,219.00	2.65
317	600120	浙江东方	31,139,111.02	2.64
318	603517	绝味食品	31,112,858.23	2.64
319	300896	爱美客	31,070,443.27	2.63
320	300134	大富科技	31,017,389.10	2.63
321	002416	爱施德	30,886,617.40	2.62
322	601000	唐山港	30,780,659.00	2.61
323	300179	四方达	30,698,067.00	2.60
324	002594	比亚迪	30,627,699.09	2.60
325	600329	达仁堂	30,337,927.20	2.57
326	000589	贵州轮胎	30,288,302.60	2.57
327	000718	苏宁环球	30,279,780.41	2.57
328	000961	中南建设	30,195,843.00	2.56
329	688200	华峰测控	30,173,054.42	2.56
330	300316	晶盛机电	29,972,485.32	2.54

331	300568	星源材质	29,967,136.12	2.54
332	600390	五矿资本	29,863,271.10	2.53
333	002557	洽洽食品	29,833,560.46	2.53
334	601689	拓普集团	29,533,105.43	2.50
335	300861	美畅股份	29,519,339.92	2.50
336	002465	海格通信	29,419,455.08	2.49
337	600498	烽火通信	29,300,409.46	2.48
338	000758	中色股份	29,168,342.90	2.47
339	688550	瑞联新材	29,092,683.38	2.47
340	002353	杰瑞股份	29,040,030.00	2.46
341	600578	京能电力	28,950,889.00	2.46
342	600299	安迪苏	28,817,677.14	2.44
343	688088	虹软科技	28,502,103.10	2.42
344	600642	申能股份	28,494,002.62	2.42
345	000898	鞍钢股份	28,396,838.17	2.41
346	300482	万孚生物	28,289,995.13	2.40
347	000541	佛山照明	28,247,916.40	2.40
348	601139	深圳燃气	28,138,587.74	2.39
349	600566	济川药业	28,014,301.87	2.38
350	600064	南京高科	27,960,283.26	2.37
351	000690	宝新能源	27,938,458.08	2.37
352	600114	东睦股份	27,908,606.08	2.37
353	002675	东诚药业	27,833,357.53	2.36
354	600875	东方电气	27,696,814.00	2.35
355	300825	阿尔特	27,681,630.73	2.35
356	002299	圣农发展	27,643,720.00	2.34
357	600297	广汇汽车	27,565,468.26	2.34
358	601001	晋控煤业	27,507,486.24	2.33
359	000785	居然之家	27,406,458.33	2.32
360	600372	中航电子	27,342,074.00	2.32
361	000027	深圳能源	27,292,980.34	2.31

362	600126	杭钢股份	27,281,520.16	2.31
363	000883	湖北能源	27,278,904.00	2.31
364	603766	隆鑫通用	27,257,400.51	2.31
365	600501	航天晨光	27,214,568.46	2.31
366	300253	卫宁健康	27,151,848.45	2.30
367	002291	遥望科技	27,061,139.41	2.29
368	601118	海南橡胶	26,981,865.30	2.29
369	601187	厦门银行	26,977,455.94	2.29
370	601975	招商南油	26,863,071.26	2.28
371	601665	齐鲁银行	26,756,372.99	2.27
372	002938	鹏鼎控股	26,662,020.00	2.26
373	601117	中国化学	26,600,646.24	2.26
374	603712	七一二	26,562,857.45	2.25
375	000567	海德股份	26,546,141.93	2.25
376	300401	花园生物	26,457,939.74	2.24
377	600188	兖矿能源	26,433,613.54	2.24
378	002301	齐心集团	26,331,507.82	2.23
379	600872	中炬高新	26,290,865.45	2.23
380	600067	冠城大通	26,239,848.38	2.23
381	600105	永鼎股份	26,232,181.25	2.22
382	002545	东方铁塔	26,168,391.20	2.22
383	600271	航天信息	26,164,442.17	2.22
384	601969	海南矿业	26,086,029.39	2.21
385	300832	新产业	26,071,188.77	2.21
386	600529	山东药玻	25,963,291.03	2.20
387	300130	新国都	25,864,073.40	2.19
388	603939	益丰药房	25,841,984.10	2.19
389	300072	海新能科	25,826,912.94	2.19
390	600662	外服控股	25,819,730.85	2.19
391	001914	招商积余	25,818,085.50	2.19
392	600153	建发股份	25,792,431.30	2.19

393	688321	微芯生物	25,744,999.11	2.18
394	600758	辽宁能源	25,674,479.00	2.18
395	002019	亿帆医药	25,623,634.56	2.17
396	601228	广州港	25,364,404.89	2.15
397	600210	紫江企业	25,272,431.75	2.14
398	000703	恒逸石化	25,132,312.00	2.13
399	000488	晨鸣纸业	24,994,472.84	2.12
400	300696	爱乐达	24,810,700.26	2.10
401	002966	苏州银行	24,718,827.05	2.10
402	603118	共进股份	24,700,920.46	2.09
403	002625	光启技术	24,677,125.48	2.09
404	600648	外高桥	24,429,854.56	2.07
405	600535	天士力	24,381,754.36	2.07
406	000301	东方盛虹	24,357,243.48	2.07
407	601668	中国建筑	24,354,451.00	2.07
408	002010	传化智联	24,333,642.81	2.06
409	300681	英搏尔	24,290,145.52	2.06
410	600073	上海梅林	24,253,789.44	2.06
411	600919	江苏银行	24,115,399.00	2.05
412	600118	中国卫星	23,989,307.22	2.03
413	000039	中集集团	23,973,867.24	2.03
414	601198	东兴证券	23,972,719.00	2.03
415	000002	万科A	23,951,143.40	2.03
416	300317	珈伟新能	23,886,921.90	2.03
417	600970	中材国际	23,841,290.44	2.02
418	603328	依顿电子	23,825,665.00	2.02
419	603067	振华股份	23,785,234.40	2.02
420	600131	国网信通	23,782,163.00	2.02

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	28,398,739,158.88
卖出股票收入（成交）总额	28,238,711,275.14

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投资。

### 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

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。

### 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	2,796,309.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,484,101.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,280,411.29

**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**

本基金本报告期末前十名指数投资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**

本基金本报告期末前五名积极投资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	持有份额	占总份	

	户数 (户)			份额 比例		额比例
国泰君安中证500指数增强A	46 2,6 10	1,850.21	110,395,734.14	12.9 0%	745,529,629.49	87.10%
国泰君安中证500指数增强C	6,3 45	84,527.80	195,575,549.77	36.4 7%	340,753,361.95	63.53%
合计	46 8,9 55	2,968.84	305,971,283.91	21.9 8%	1,086,282,991.44	78.02%

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500指数增强A	2,662,438.68	0.31%
	国泰君安中证500指数增强C	5,073,460.90	0.95%
	合计	7,735,899.58	0.56%

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500指数增强A	0
	国泰君安中证500指数增强C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证500指数增强A	>100
	国泰君安中证500指数增强C	50~100
	合计	>100

### §10 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
基金合同生效日(2021年12月15日)基金份额总额	720,641,928.72	440,062,218.02
本报告期期初基金份额总额	721,060,040.05	440,886,236.61
本报告期基金总申购份额	520,051,797.65	429,619,159.21
减：本报告期基金总赎回份额	385,186,474.07	334,176,484.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	855,925,363.63	536,328,911.72

### §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重大人事变动如下：



2022年1月17日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，谢乐斌同志担任公司董事长，江伟同志不再担任公司董事长。

2022年3月12日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》，谢乐斌同志担任公司董事和董事长，江伟同志不再担任公司董事和董事长职务。陶耿同志担任公司董事和副董事长；王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇同志担任公司董事，蒋忆明、喻健同志不再兼任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为谢乐斌、陶耿、王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇。

2022年3月30日，本基金管理人发布了《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告》，董博阳同志担任公司监事，傅南平同志不再担任公司监事职务；王红莲同志担任公司职工监事。

2022年4月8日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，吕巍同志担任公司合规总监、督察长，叶明同志不再担任公司合规总监。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：  
无。

### 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

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币50,000.00元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

### 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	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		额的比例		比例	
国泰君安	2	56,608,931,439.29	100.00%	3,863,860.36	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	关于调整旗下基金对账单服务规则的公告	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	2022-01-19
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-19
3	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金开放日常赎回业务的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告	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	2022-03-12
5	关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-30
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-04-08
7	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
9	国泰君安中证500指数增强	证监会指定网站、公司官网	2022-07-21

	型证券投资基金2022年第二季度报告		
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告	上海证券报	2022-07-21
11	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金2022年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2022-08-31
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2022年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2022-08-31
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
14	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金2022年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-10-26
15	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2022年3季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2022-10-26
16	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
17	关于调整旗下部分开放式基金在部分销售机构最低申购金额、最低追加申购金额、最低赎回份额和最低持有限额的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-11-17
18	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	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

	的公告		
19	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2022-12-14
20	国泰君安中证500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	2022-12-14
21	国泰君安中证500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	2022-12-14

## §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、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、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

二〇二三年三月三十一日