

# 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13

<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产(基金净值)变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	61

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>65</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 1000 指数增强	
基金主代码	015867	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 08 月 16 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	626,993,226.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015867	015868
报告期末下属分级基金的份额总额	219,879,468.23 份	407,113,758.65 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、股票投资策略</li> <li>2、债券投资策略</li> <li>3、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略</li> <li>4、资产支持证券投资策略</li> <li>5、股指期货投资策略</li> <li>6、国债期货投资策略</li> <li>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</li> </ol>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> <p>本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有	中国农业银行股份有限公司

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	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
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
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）	
	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	25,941,731.15	20,841,808.82
本期利润	31,509,566.63	29,122,141.26
加权平均基金份额本期利润	0.1322	0.1130
本期加权平均净值利润率	13.33%	11.43%

本期基金份额净值增长率	10.50%	10.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	14,835.32	-1,371,340.03
期末可供分配基金份额利润	0.0001	-0.0034
期末基金资产净值	219,894,303.55	405,742,418.62
期末基金份额净值	1.0001	0.9966
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	0.01%	-0.34%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.73%	1.00%	0.59%	0.99%	1.14%	0.01%
过去三个月	-1.59%	0.89%	-3.77%	0.87%	2.18%	0.02%
过去六个月	10.50%	0.87%	4.87%	0.84%	5.63%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.01%	1.00%	-8.84%	1.04%	8.85%	-0.04%

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.69%	1.00%	0.59%	0.99%	1.10%	0.01%
过去三个月	-1.70%	0.89%	-3.77%	0.87%	2.07%	0.02%
过去六个月	10.28%	0.87%	4.87%	0.84%	5.41%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.34%	1.00%	-8.84%	1.04%	8.50%	-0.04%

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



国泰君安中证1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月16日-2023年06月30日)



注：1、本基金于 2022 年 08 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰君安中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月16日-2023年06月30日)



注：1、本基金于 2022 年 08 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

#### § 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 39 只公开募集证券投资基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，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，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理。	2022-08-16	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 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总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 5 次。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

2023 上半年 A 股整体呈现震荡收涨的局面，其中，受益于 AIGC 技术驱动的 TMT 板块显著领涨。风格上来看，小盘风格优于大盘风格，价值风格优于成长风格。上半年受到经济和政策预期不断反复的影响，市场由年初的显著回暖，逐渐演变为对经济复苏强度预期分歧导致的行情震荡。在市场的增量资金没有显著流入的情况下，市场存量博弈特征明显，板块和风格的轮动强度和轮动频率维持在历史高位。

从主要风险因子的走势来看，今年一季度延续了去年的小市值风格，中小盘股表现占优，二季度大小盘股表现较均衡。动量因子在去年四季度开始显著失效，期间股票的反转效应得到强化，然而今年开始动量因子表现有所回升，二季度动量因子持续走强，接近历史平均水平。估值因子在一季度“中国特色估值体系”提出后，表现强势，且走势延续到了二季度。除数字经济等热门主题外，低估值一直是市场的主线，相对而言成长因子和分析师情绪因子持续表现弱势。从 Alpha 大类因子的表现来看，今年高频因子和基本面因子表现都达到了历史平均水平。其中，基本面因子在年报、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，在上半年表现强势。此外，今年一季度

市场交投活跃度逐渐提升，二季度市场主题逐渐分散，市场波动率提升，高频因子的拥挤度开始有所缓解，高频因子的有效性有提升。基本面和高频两种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。得益于基本面量化和高频量价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。随着今年在大幅度扩充有效因子库和有针对性改进模型底层逻辑之后，我们坚信模型能以更有效地方式输出稳定的超额收益。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 1000 指数进行增强。考虑到中证 1000 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。作为宽基指数的增强型量化产品，具有越跌越安全的特点，投资管理人始终保持高仓位运作，一般情况下不主动择时，而专注于以稳健的方式跑赢指数，通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，这样的基金特点更需要投资者坚持长期投资的理念。我们认为中证 1000 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然远大于下挫的空间，我们努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.0001 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.50%，同期业绩比较基准收益率为 4.87%；截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9966 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.28%，同期业绩比较基准收益率为 4.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 A 股市场在上半年的冲高回落后，在下半年将有一段缓慢的磨底期，但是整体是呈现震荡向上的态势。政策层面，积极宽松的货币政策和财政政策，以及定向倾斜的产业政策，将稳固房地产市场，修复制造业的企业利润率，带动数字经济、硬科技新兴产业的投资改善，最终提高 A 股市场的盈利水平。宏观层面，美联储的加息周期即将走向尾声，美元指数和美债利率走弱将有利于外资流入 A 股。预期方面，虽然上半年的经济修复不及预期，整体的市场预期较弱估值水平较低，但是在下半年稳就业，扩内需的定调下，A 股整体的信心有望提升。

虽然今年以来，在地缘政治和人民币贬值等因素的影响下，A 股市场的活跃度和投资情绪一般，但是从中长期的角度来看，我们依然坚定地看好中证 1000 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 PB）的角度来看，中证 1000 指数在历史 14% 的分位数。今年市场中小市值股票表现优异，支撑了我们之前对中证 1000 指数中长期周期的判断，未来随着经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。2). 中证 1000 指数的行业分布非常均衡，且覆盖众多的细分行业龙头股，新兴的科技股，在数字经济、硬科技投资等新兴产业的产业倾斜下，将带动整体的上涨。3) 中证 1000 指数在周期和非周期、价值和成长、新兴行业 and 传统行业等方面的分布均较为平衡，在各种不同市场环境下进可攻退可守。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—上海国泰君安证券资产管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	36,999,417.02	34,006,559.91
结算备付金		7,507,079.05	4,351,911.30
存出保证金		1,557,388.80	1,475,232.00
交易性金融资产	6.4.7.2	578,781,410.88	489,082,299.73
其中：股票投资		578,781,410.88	489,082,299.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		2,347,320.32	169,457.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		627,192,616.07	529,085,459.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		852,860.27	836,295.84

应付管理人报酬		438,161.09	449,025.65
应付托管费		65,724.15	67,353.83
应付销售服务费		108,111.02	79,917.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	91,037.37	151,095.01
负债合计		1,555,893.90	1,583,688.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	626,993,226.88	583,221,036.84
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,356,504.71	-55,719,264.90
净资产合计		625,636,722.17	527,501,771.94
负债和净资产总计		627,192,616.07	529,085,459.95

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 626,993,226.88 份。其中国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.0001 元，基金份额总额 219,879,468.23 份；国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.9966 元，基金份额总额 407,113,758.65 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		64,042,508.67
1. 利息收入		137,331.22



其中：存款利息收入	6.4.7.9	137,331.22
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,561,708.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	45,294,058.54
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.11	914,887.15
股利收益	6.4.7.12	3,352,763.24
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）	6.4.7.13	13,848,167.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	495,300.60
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,410,800.78</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,446,877.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	367,031.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	506,981.47
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		4,643.55
8. 其他费用	6.4.7.15	85,266.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,631,707.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,631,707.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		60,631,707.89

注：本基金合同于 2022 年 08 月 16 日生效，无上年度可比区间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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）	583,221,036.84	-	-55,719,264.90	527,501,771.94
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）	583,221,036.84	-	-55,719,264.90	527,501,771.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,772,190.04	-	54,362,760.19	98,134,950.23
（一）、综合收益总额	-	-	60,631,707.89	60,631,707.89
（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）	43,772,190.04	-	-6,268,947.70	37,503,242.34
其中：1. 基金申购款	550,024,143.14	-	-4,648,039.89	545,376,103.25
2. 基金赎回款	-506,251,953.10	-	-1,620,907.81	-507,872,860.91
（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）	626,993,226.88	-	-1,356,504.71	625,636,722.17

注：本基金合同于 2022 年 08 月 16 日生效，无上年度可比区间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，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【2022】983 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 609,392,211.62 份，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证。《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 8 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券（包括存托凭证、下同）、备选成份券（包括存托凭证、下同）、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证（包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债）、可交换债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等）、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在

扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。

#### 6.4.2 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》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	16,229,560.45
等于：本金	16,224,496.32
加：应计利息	5,064.13
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	20,769,856.57
等于：本金	20,767,555.70
加：应计利息	2,300.87
减：坏账准备	-
合计	36,999,417.02

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。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	578,806,981.99	-	578,781,410.88	-25,571.11
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	578,806,981.99	-	578,781,410.88	-25,571.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 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	12,872,317.24	0.00	-	-
股指期货	12,872,317.24	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,872,317.24	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IM2307	IM2307	1	1,314,960.00	20,387.00
IM2312	IM2312	9	11,663,280.00	85,535.76
合计				105,922.76
减：可抵销期货暂收款				105,922.76
净额				0.00

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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	136.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	19,835.79
其他应付	11,558.10
合计	91,037.37

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	309,802,278.63	309,802,278.63
本期申购	58,585,180.32	58,585,180.32
本期赎回（以“-”号填列）	-148,507,990.72	-148,507,990.72
本期末	219,879,468.23	219,879,468.23

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	273,418,758.21	273,418,758.21
本期申购	491,438,962.82	491,438,962.82
本期赎回（以“-”号填列）	-357,743,962.38	-357,743,962.38
本期末	407,113,758.65	407,113,758.65

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、



份额升降级等原因导致的份额调减。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,790,974.32	-7,608,727.23	-29,399,701.55
本期利润	25,941,731.15	5,567,835.48	31,509,566.63
本期基金份额交易产生的变动数	-1,340,999.82	-754,029.94	-2,095,029.76
其中：基金申购款	320,933.72	-754,710.42	-433,776.70
基金赎回款	-1,661,933.54	680.48	-1,661,253.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,809,757.01	-2,794,921.69	14,835.32

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,606,392.30	-6,713,171.05	-26,319,563.35
本期利润	20,841,808.82	8,280,332.44	29,122,141.26
本期基金份额交易产生的变动数	2,570,411.40	-6,744,329.34	-4,173,917.94
其中：基金申购款	4,713,583.54	-8,927,846.73	-4,214,263.19
基金赎回款	-2,143,172.14	2,183,517.39	40,345.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,805,827.92	-5,177,167.95	-1,371,340.03

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	77,199.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	29,872.03
结算备付金利息收入	30,259.93
其他	-
合计	137,331.22

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	6,458,208,964.40
减：卖出股票成本总额	6,404,515,239.09
减：交易费用	8,399,666.77

买卖股票差价收入	45,294,058.54
----------	---------------

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

##### 6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	1,013,438.83
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	38,696.30
减：交易费用	59,855.38
合计	914,887.15

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,352,763.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,352,763.24

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	13,594,686.75
——股票投资	13,594,686.75
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	253,481.17
——权证投资	-
——期货投资	253,481.17
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	13,848,167.92

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	495,300.60
合计	495,300.60

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,923.56
合计	85,266.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(以下简称 “中国农业银行”)	基金托管人
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	12,934,151,809.07	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	921,987.72	100.00%	0.00	0.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,446,877.47
其中：支付销售机构的客户维护费	971,040.42

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

2、本基金合同于 2022 年 08 月 16 日生效，无上年度可比区间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	367,031.57

注：1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

2、本基金合同于 2022 年 08 月 16 日生效，无上年度可比区间数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	325,044.32	325,044.32
上海国泰君安证券资产管理有限公司	-	55,121.60	55,121.60
合计	-	380,165.92	380,165.92

注：1、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。

其计算公式为：

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

2、本基金合同于 2022 年 08 月 16 日生效，无上年度可比区间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	16,229,560.45	77,199.26
国泰君安证券股份有限公司	20,769,856.57	29,872.03

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

无

**6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688539	高华科技	2023 年 04 月 11 日	6 个月	新股锁定	38.22	43.49	5,334	203,865.48	231,975.66	-

688603	天承科技	2023 年 06 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 06 月 30 日	6 个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688472	阿特斯	2023 年 06 月 02 日	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	2,289	25,407.90	39,004.56	-
301358	湖南裕能	2023 年 02 月 01 日	6 个月	新股锁定	23.77	42.89	748	17,779.96	32,081.72	-
301293	三博脑科	2023 年 04 月 25 日	6 个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301310	鑫宏业	2023 年 05 月 26 日	6 个月	新股锁定	67.28	65.43	345	23,211.60	22,573.35	-
688576	西山科技	2023 年 05 月 30 日	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	171	23,221.80	20,590.11	-
688352	硕中科技	2023 年 04 月 11 日	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	1,303	15,766.30	15,727.21	-
688458	美芯晟	2023 年 05 月 15 日	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	171	12,825.00	15,519.96	-
688552	航天南湖	2023 年 05 月 08 日	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	659	13,951.03	15,486.50	-
301399	英特科技	2023 年 05 月 16 日	6 个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301246	宏源药	2023 年 03 月 10 日	6 个月	新股锁定	50.00	30.71	478	23,900.00	14,679.38	-

	业										
688484	南芯科技	2023 年 03 月 28 日	6 个月	新股锁定	39.99	36.71	390	15,596.10	14,316.90	-	
688593	新相微	2023 年 05 月 25 日	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-	
301387	光大同创	2023 年 04 月 10 日	6 个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-	
688570	天玛智控	2023 年 05 月 29 日	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	542	16,400.92	13,728.86	-	
688581	安杰思	2023 年 05 月 12 日	6 个月	新股锁定	125.80	118.03	114	14,341.20	13,455.42	-	
688433	华曙高科	2023 年 04 月 07 日	6 个月	新股锁定	26.66	31.50	403	10,743.98	12,694.50	-	
301315	威士顿	2023 年 06 月 13 日	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	
301322	绿通科技	2023 年 02 月 27 日	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	216	18,879.84	11,499.84	-	
301439	泓淋电力	2023 年 03 月 10 日	6 个月	新股锁定	19.99	16.90	655	13,093.45	11,069.50	-	
301429	森泰股份	2023 年 04 月 10 日	6 个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-	
688623	双元科技	2023 年 05 月 31 日	6 个月	新股锁定	125.88	86.79	119	14,979.72	10,328.01	-	
688631	莱斯	2023 年 06 月 19 日	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-	



	信息	日								
301376	致欧科技	2023 年 06 月 14 日	6 个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301323	新莱福	2023 年 05 月 29 日	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023 年 06 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南科技	2023 年 06 月 16 日	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023 年 03 月 28 日	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023 年 03 月 28 日	6 个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
301157	华塑科技	2023 年 03 月 01 日	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301345	涛涛车业	2023 年 03 月 10 日	6 个月	新股锁定	73.45	46.64	150	11,017.50	6,996.00	-
001367	海森药业	2023 年 03 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，其他银行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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,999,417.02	-	-	-	36,999,417.02
结算备付金	7,507,079.05	-	-	-	7,507,079.05
存出保证金	1,557,388.80	-	-	-	1,557,388.80
交易性金融资产	-	-	-	578,781,410.88	578,781,410.88
应收申购款	-	-	-	2,347,320.32	2,347,320.32
资产总计	46,063,884.87	-	-	581,128,731.20	627,192,616.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	852,860.27	852,860.27
应付管理人报酬	-	-	-	438,161.09	438,161.09
应付托管费	-	-	-	65,724.15	65,724.15
应付销售服务费	-	-	-	108,111.02	108,111.02
其他负债	-	-	-	91,037.37	91,037.37
负债总计	-	-	-	1,555,893.90	1,555,893.90
利率敏感度缺口	46,063,884.87	-	-	579,572,837.30	625,636,722.17
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2022 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 (2022 年 12 月 31 日：同)

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	578,781,410.88	92.51	489,082,299.73	92.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	578,781,410.88	92.51	489,082,299.73	92.72

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。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。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	578,041,477.99	487,907,465.38

第二层次	76,505.00	844,662.00
第三层次	663,427.89	330,172.35
合计	578,781,410.88	489,082,299.73

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	578,781,410.88	92.28
	其中：股票	578,781,410.88	92.28
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	44,506,496.07	7.10
8	其他各项资产	3,904,709.12	0.62
9	合计	627,192,616.07	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,325,417.00	0.37
B	采矿业	14,028,485.32	2.24
C	制造业	332,814,869.39	53.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,418,212.69	3.74
E	建筑业	5,663,813.00	0.91
F	批发和零售业	8,465,925.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,568,815.28	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,355,874.75	6.45
J	金融业	12,089,046.25	1.93
K	房地产业	8,245,561.00	1.32
L	租赁和商务服务业	2,012,070.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	2,810,941.38	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	517,940.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,345,841.60	0.37
R	文化、体育和娱乐业	22,637,974.54	3.62
S	综合	-	-
	合计	480,300,787.20	76.77

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	463,430.00	0.07
B	采矿业	464,727.00	0.07
C	制造业	70,539,907.28	11.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	1,425,759.00	0.23



	业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,438,070.20	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	3,790,297.00	0.61
H	住宿和餐饮业	528,240.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,968,533.94	1.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	712,975.00	0.11
L	租赁和商务服务业	52,480.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,929,312.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	1,096,745.40	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	648,986.86	0.10
R	文化、体育和娱乐业	4,421,160.00	0.71
S	综合	-	-
	合计	98,480,623.68	15.74

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300638	广和通	268,000	6,078,240.00	0.97
2	603103	横店影视	343,605	5,786,308.20	0.92
3	300869	康泰医学	231,092	5,305,872.32	0.85
4	002215	诺普信	680,819	5,112,950.69	0.82
5	603567	珍宝岛	336,200	5,029,552.00	0.80
6	600197	伊力特	181,500	4,931,355.00	0.79
7	603328	依顿电子	575,700	4,766,796.00	0.76
8	600201	生物股份	467,738	4,448,188.38	0.71
9	002335	科华数据	122,500	4,403,875.00	0.70
10	600583	海油工程	751,400	4,395,690.00	0.70
11	601137	博威合金	282,300	4,392,588.00	0.70
12	600531	豫光金铅	683,900	4,308,570.00	0.69
13	000550	江铃汽车	300,600	4,160,304.00	0.66

14	600098	广州发展	670,700	4,144,926.00	0.66
15	688173	希荻微	178,651	4,087,534.88	0.65
16	603171	税友股份	99,700	3,986,006.00	0.64
17	002664	信质集团	276,800	3,897,344.00	0.62
18	300232	洲明科技	426,200	3,895,468.00	0.62
19	002746	仙坛股份	493,406	3,888,039.28	0.62
20	300319	麦捷科技	452,100	3,869,976.00	0.62
21	600562	国睿科技	238,000	3,855,600.00	0.62
22	603989	艾华集团	182,030	3,833,551.80	0.61
23	002649	博彦科技	261,200	3,690,756.00	0.59
24	300775	三角防务	109,200	3,688,776.00	0.59
25	600578	京能电力	929,515	3,634,403.65	0.58
26	300457	赢合科技	201,200	3,553,192.00	0.57
27	600977	中国电影	251,400	3,532,170.00	0.56
28	600577	精达股份	791,400	3,339,708.00	0.53
29	300443	金雷股份	93,300	3,307,485.00	0.53
30	002641	公元股份	582,500	3,285,300.00	0.53
31	601908	京运通	539,900	3,266,395.00	0.52
32	601619	嘉泽新能	717,500	3,264,625.00	0.52
33	600267	海正药业	286,700	3,262,646.00	0.52
34	300735	光弘科技	304,000	3,252,800.00	0.52
35	001696	宗申动力	458,500	3,246,180.00	0.52
36	000966	长源电力	580,500	3,239,190.00	0.52
37	300672	国科微	38,527	3,211,225.45	0.51
38	603719	良品铺子	127,600	3,191,276.00	0.51
39	601921	浙版传媒	366,200	3,182,278.00	0.51
40	600129	太极集团	53,400	3,176,766.00	0.51
41	603305	旭升集团	113,600	3,166,032.00	0.51
42	601702	华峰铝业	230,479	3,152,952.72	0.50
43	000860	顺鑫农业	92,150	3,104,533.50	0.50
44	603208	江山欧派	84,360	3,072,391.20	0.49
45	000030	富奥股份	604,300	3,045,672.00	0.49
46	600635	大众公用	915,292	3,038,769.44	0.49
47	002053	云南能投	270,200	3,031,644.00	0.48
48	603197	保隆科技	55,500	3,010,875.00	0.48
49	002498	汉缆股份	750,495	3,009,484.95	0.48
50	688711	宏微科技	49,883	2,910,174.22	0.47
51	688425	铁建重工	603,440	2,902,546.40	0.46
52	300768	迪普科技	174,703	2,894,828.71	0.46
53	002948	青岛银行	921,850	2,885,390.50	0.46
54	601311	骆驼股份	308,990	2,867,427.20	0.46
55	002967	广电计量	139,603	2,804,624.27	0.45
56	688676	金盘科技	92,344	2,797,099.76	0.45

57	601019	山东出版	304,002	2,787,698.34	0.45
58	300674	宇信科技	155,800	2,754,544.00	0.44
59	601801	皖新传媒	290,200	2,724,978.00	0.44
60	600864	哈投股份	532,000	2,718,520.00	0.43
61	300693	盛弘股份	73,393	2,709,669.56	0.43
62	002171	楚江新材	380,000	2,705,600.00	0.43
63	002020	京新药业	210,500	2,698,610.00	0.43
64	300900	广联航空	92,332	2,660,084.92	0.43
65	603566	普莱柯	113,935	2,648,988.75	0.42
66	688318	财富趋势	26,172	2,616,414.84	0.42
67	603179	新泉股份	59,300	2,602,677.00	0.42
68	000517	荣安地产	853,200	2,602,260.00	0.42
69	601222	林洋能源	315,300	2,582,307.00	0.41
70	002206	海利得	480,100	2,573,336.00	0.41
71	002158	汉钟精机	103,000	2,570,880.00	0.41
72	002011	盾安环境	185,400	2,564,082.00	0.41
73	300109	新开源	100,400	2,496,948.00	0.40
74	601126	四方股份	164,361	2,496,643.59	0.40
75	688088	虹软科技	57,929	2,476,464.75	0.40
76	002990	盛视科技	66,500	2,447,200.00	0.39
77	601519	大智慧	338,700	2,425,092.00	0.39
78	601369	陕鼓动力	265,600	2,419,616.00	0.39
79	002701	奥瑞金	536,100	2,417,811.00	0.39
80	603881	数据港	105,760	2,389,118.40	0.38
81	000875	吉电股份	442,300	2,383,997.00	0.38
82	603466	风语筑	170,600	2,371,340.00	0.38
83	300130	新国都	83,512	2,365,894.96	0.38
84	000737	北方铜业	438,200	2,361,898.00	0.38
85	002234	民和股份	127,700	2,325,417.00	0.37
86	002612	朗姿股份	96,200	2,287,636.00	0.37
87	603985	恒润股份	109,000	2,285,730.00	0.37
88	300702	天宇股份	93,720	2,274,584.40	0.36
89	000685	中山公用	298,680	2,261,007.60	0.36
90	300133	华策影视	317,800	2,253,202.00	0.36
91	600502	安徽建工	422,905	2,232,938.40	0.36
92	603345	安井食品	15,200	2,231,360.00	0.36
93	603916	苏博特	167,920	2,223,260.80	0.36
94	600363	联创光电	59,600	2,211,160.00	0.35
95	002635	安洁科技	159,253	2,197,691.40	0.35
96	688389	普门科技	93,468	2,195,563.32	0.35
97	002108	沧州明珠	484,400	2,194,332.00	0.35
98	002314	南山控股	664,700	2,193,510.00	0.35
99	301087	可孚医疗	43,730	2,155,889.00	0.34

100	603229	奥翔药业	102,060	2,141,218.80	0.34
101	603027	千禾味业	99,600	2,103,552.00	0.34
102	600266	城建发展	413,100	2,098,548.00	0.34
103	600986	浙文互联	322,000	2,060,800.00	0.33
104	600248	陕建股份	429,900	2,050,623.00	0.33
105	002913	奥士康	53,500	2,042,630.00	0.33
106	600572	康恩贝	296,800	2,033,080.00	0.32
107	600789	鲁抗医药	315,200	2,023,584.00	0.32
108	600125	铁龙物流	334,882	2,022,687.28	0.32
109	300777	中简科技	42,700	2,018,002.00	0.32
110	600933	爱柯迪	86,300	2,009,927.00	0.32
111	603983	丸美股份	61,400	1,986,290.00	0.32
112	600403	大有能源	481,612	1,979,425.32	0.32
113	002351	漫步者	93,900	1,941,852.00	0.31
114	000672	上峰水泥	210,740	1,924,056.20	0.31
115	301155	海力风电	24,800	1,911,584.00	0.31
116	301089	拓新药业	30,620	1,896,602.80	0.30
117	002402	和而泰	111,200	1,888,176.00	0.30
118	002636	金安国纪	203,700	1,880,151.00	0.30
119	600872	中炬高新	50,200	1,846,858.00	0.30
120	301239	普瑞眼科	18,700	1,834,096.00	0.29
121	002017	东信和平	139,764	1,832,306.04	0.29
122	301039	中集车辆	137,200	1,815,156.00	0.29
123	600850	电科数字	76,000	1,792,840.00	0.29
124	002085	万丰奥威	255,900	1,773,387.00	0.28
125	300910	瑞丰新材	34,600	1,740,380.00	0.28
126	002895	川恒股份	88,200	1,737,540.00	0.28
127	603919	金徽酒	73,300	1,721,084.00	0.28
128	002539	云图控股	190,600	1,711,588.00	0.27
129	002651	利君股份	219,100	1,702,407.00	0.27
130	002747	埃斯顿	60,800	1,702,400.00	0.27
131	002859	洁美科技	61,400	1,700,780.00	0.27
132	002727	一心堂	63,400	1,673,760.00	0.27
133	605020	永和股份	64,200	1,657,002.00	0.26
134	002139	拓邦股份	124,700	1,627,335.00	0.26
135	603636	南威软件	110,500	1,621,035.00	0.26
136	603505	金石资源	66,960	1,563,516.00	0.25
137	002130	沃尔核材	191,000	1,550,920.00	0.25
138	600971	恒源煤电	196,400	1,529,956.00	0.24
139	002984	森麒麟	47,700	1,500,642.00	0.24
140	603601	再升科技	350,760	1,497,745.20	0.24
141	605123	派克新材	13,684	1,486,766.60	0.24
142	300068	南都电源	76,345	1,478,039.20	0.24

143	000061	农产品	243,200	1,456,768.00	0.23
144	002324	普利特	101,800	1,452,686.00	0.23
145	300827	上能电气	39,477	1,423,145.85	0.23
146	002541	鸿路钢构	48,400	1,394,404.00	0.22
147	002768	国恩股份	56,946	1,377,523.74	0.22
148	601567	三星医疗	104,600	1,321,098.00	0.21
149	000650	仁和药业	213,400	1,310,276.00	0.21
150	600993	马应龙	46,800	1,301,508.00	0.21
151	300065	海兰信	104,600	1,295,994.00	0.21
152	603236	移远通信	22,200	1,281,162.00	0.20
153	300079	数码视讯	209,500	1,277,950.00	0.20
154	300134	大富科技	123,200	1,262,800.00	0.20
155	600320	振华重工	337,500	1,258,875.00	0.20
156	000686	东北证券	178,900	1,241,566.00	0.20
157	688518	联赢激光	44,374	1,236,259.64	0.20
158	300348	长亮科技	117,900	1,230,876.00	0.20
159	601001	晋控煤业	130,900	1,225,224.00	0.20
160	002737	葵花药业	49,800	1,212,132.00	0.19
161	300633	开立医疗	22,100	1,204,450.00	0.19
162	600458	时代新材	100,454	1,204,443.46	0.19
163	000801	四川九洲	164,600	1,201,580.00	0.19
164	300502	新易盛	17,600	1,196,272.00	0.19
165	688018	乐鑫科技	9,200	1,194,344.00	0.19
166	000032	深桑达 A	35,900	1,181,110.00	0.19
167	300206	理邦仪器	76,800	1,158,144.00	0.19
168	002312	川发龙蟒	138,300	1,124,379.00	0.18
169	601918	新集能源	262,700	1,116,475.00	0.18
170	688139	海尔生物	21,442	1,103,619.74	0.18
171	002697	红旗连锁	186,700	1,090,328.00	0.17
172	002611	东方精工	189,500	1,087,730.00	0.17
173	601882	海天精工	32,600	1,085,580.00	0.17
174	600750	江中药业	49,000	1,074,570.00	0.17
175	600223	福瑞达	104,400	1,071,144.00	0.17
176	000048	京基智农	54,800	1,069,696.00	0.17
177	603733	仙鹤股份	50,600	1,055,010.00	0.17
178	000950	重药控股	156,200	1,051,226.00	0.17
179	000528	柳工	132,800	1,049,120.00	0.17
180	002583	海能达	171,300	995,253.00	0.16
181	002097	山河智能	149,400	993,510.00	0.16
182	600312	平高电气	79,800	988,722.00	0.16
183	002467	二六三	194,800	968,156.00	0.15
184	002698	博实股份	54,300	949,707.00	0.15
185	300738	奥飞数据	92,520	943,704.00	0.15

186	600420	国药现代	81,400	919,006.00	0.15
187	300332	天壕环境	79,800	915,306.00	0.15
188	300567	精测电子	9,596	913,059.40	0.15
189	688408	中信博	10,635	896,849.55	0.14
190	002367	康力电梯	98,000	894,740.00	0.14
191	300803	指南针	17,238	837,594.42	0.13
192	600966	博汇纸业	140,948	834,412.16	0.13
193	003006	百亚股份	47,400	819,072.00	0.13
194	603010	万盛股份	73,700	801,119.00	0.13
195	600037	歌华有线	95,300	791,943.00	0.13
196	002782	可立克	51,100	781,319.00	0.12
197	601101	昊华能源	134,200	781,044.00	0.12
198	601890	亚星锚链	67,200	778,176.00	0.12
199	600120	浙江东方	194,614	745,371.62	0.12
200	002815	崇达技术	58,200	724,590.00	0.12
201	002446	盛路通信	76,100	719,145.00	0.11
202	603416	信捷电气	17,067	705,037.77	0.11
203	603323	苏农银行	162,400	683,704.00	0.11
204	000603	盛达资源	54,700	661,323.00	0.11
205	300811	铂科新材	11,100	659,784.00	0.11
206	002317	众生药业	38,100	647,319.00	0.10
207	002741	光华科技	37,500	633,000.00	0.10
208	300183	东软载波	38,000	627,380.00	0.10
209	000426	兴业银锡	70,200	623,376.00	0.10
210	603071	物产环能	36,800	610,512.00	0.10
211	688100	威胜信息	20,100	599,181.00	0.10
212	003040	楚天龙	32,044	581,278.16	0.09
213	600477	杭萧钢构	136,400	557,876.00	0.09
214	002344	海宁皮城	117,400	555,302.00	0.09
215	300226	上海钢联	17,137	555,238.80	0.09
216	600908	无锡银行	102,920	551,651.20	0.09
217	000597	东北制药	104,430	541,991.70	0.09
218	300666	江丰电子	7,800	530,088.00	0.08
219	002006	精工科技	24,300	524,151.00	0.08
220	002573	清新环境	94,000	517,940.00	0.08
221	603997	继峰股份	35,500	507,650.00	0.08
222	603053	成都燃气	49,900	502,493.00	0.08
223	300894	火星人	19,500	498,030.00	0.08
224	300382	斯莱克	35,500	468,245.00	0.07
225	002946	新乳业	32,100	460,635.00	0.07
226	002239	奥特佳	169,400	452,298.00	0.07
227	603308	应流股份	23,500	430,050.00	0.07
228	603187	海容冷链	21,100	421,789.00	0.07

229	301267	华夏眼科	6,868	418,604.60	0.07
230	300101	振芯科技	21,400	414,946.00	0.07
231	600682	南京新百	49,600	397,296.00	0.06
232	600586	金晶科技	47,500	366,700.00	0.06
233	003012	东鹏控股	43,100	348,679.00	0.06
234	300762	上海瀚讯	28,900	340,153.00	0.05
235	603396	金辰股份	5,100	334,560.00	0.05
236	002677	浙江美大	31,200	330,408.00	0.05
237	688037	芯源微	1,900	324,805.00	0.05
238	300767	震安科技	12,775	323,974.00	0.05
239	688007	光峰科技	14,900	310,665.00	0.05
240	300294	博雅生物	8,424	305,622.72	0.05
241	600717	天津港	65,900	291,937.00	0.05
242	300634	彩讯股份	11,000	290,400.00	0.05
243	688383	新益昌	2,051	285,540.22	0.05
244	600888	新疆众和	32,700	258,984.00	0.04
245	300755	华致酒行	11,500	258,405.00	0.04
246	688127	蓝特光学	14,609	257,556.67	0.04
247	300298	三诺生物	9,300	251,472.00	0.04
248	603877	太平鸟	9,879	249,741.12	0.04
249	603063	禾望电气	8,100	249,075.00	0.04
250	605589	圣泉集团	10,900	236,966.00	0.04
251	300770	新媒股份	5,100	233,886.00	0.04
252	688148	芳源股份	17,500	213,500.00	0.03
253	300180	华峰超纤	56,834	205,170.74	0.03
254	603920	世运电路	9,908	193,503.24	0.03
255	600662	外服控股	32,600	186,472.00	0.03
256	600990	四创电子	5,825	184,303.00	0.03
257	000555	神州信息	14,000	172,200.00	0.03
258	600284	浦东建设	27,180	166,341.60	0.03
259	002987	京北方	7,100	155,632.00	0.02
260	000758	中色股份	32,300	152,456.00	0.02
261	300131	英唐智控	29,000	152,250.00	0.02
262	600761	安徽合力	7,000	139,510.00	0.02
263	300747	锐科激光	4,500	137,160.00	0.02
264	002706	良信股份	11,900	133,875.00	0.02
265	688526	科前生物	5,487	130,535.73	0.02
266	688508	芯朋微	2,227	129,143.73	0.02
267	600773	西藏城投	10,100	127,260.00	0.02
268	002283	天润工业	19,800	127,116.00	0.02
269	300236	上海新阳	3,100	122,915.00	0.02
270	600639	浦东金桥	9,500	117,895.00	0.02
271	002126	银轮股份	6,000	106,200.00	0.02

272	300263	隆华科技	12,300	102,336.00	0.02
273	002044	美年健康	13,100	93,141.00	0.01
274	605111	新洁能	2,130	92,697.60	0.01
275	300224	正海磁材	5,800	74,588.00	0.01
276	002023	海特高新	7,300	67,160.00	0.01
277	603690	至纯科技	1,920	66,892.80	0.01
278	688368	晶丰明源	500	63,605.00	0.01
279	603533	掌阅科技	1,900	52,668.00	0.01
280	002320	海峡股份	7,400	44,696.00	0.01
281	600729	重庆百货	1,300	40,872.00	0.01
282	300579	数字认证	1,412	40,806.80	0.01
283	600797	浙大网新	5,700	40,698.00	0.01
284	600997	开滦股份	6,800	40,596.00	0.01
285	003031	中瓷电子	300	39,936.00	0.01
286	000902	新洋丰	3,800	39,064.00	0.01
287	002489	浙江永强	9,500	38,475.00	0.01
288	000718	苏宁环球	12,800	34,944.00	0.01
289	603032	德新科技	1,000	34,540.00	0.01
290	600483	福能股份	2,900	33,495.00	0.01
291	603098	森特股份	1,600	32,800.00	0.01
292	000951	中国重汽	1,900	32,015.00	0.01
293	605222	起帆电缆	1,500	30,990.00	0.00
294	600876	凯盛新能	1,900	30,324.00	0.00
295	605009	豪悦护理	600	28,800.00	0.00
296	688023	安恒信息	138	24,109.98	0.00
297	603915	国茂股份	1,100	23,298.00	0.00
298	600017	日照港	7,700	23,023.00	0.00
299	002918	蒙娜丽莎	1,400	21,616.00	0.00
300	002929	润建股份	400	17,364.00	0.00
301	002135	东南网架	2,400	15,504.00	0.00
302	688680	海优新材	122	14,862.04	0.00
303	301050	雷电微力	200	12,986.00	0.00
304	688608	恒玄科技	47	5,688.41	0.00
305	688198	佰仁医疗	48	5,093.28	0.00
306	688001	华兴源创	127	4,498.34	0.00
307	301047	义翘神州	40	3,428.00	0.00
308	688083	中望软件	20	2,897.80	0.00
309	688046	药康生物	149	2,889.11	0.00
310	688699	明微电子	32	1,610.24	0.00
311	688330	宏力达	42	1,473.36	0.00
312	001269	欧晶科技	20	1,470.60	0.00
313	688700	东威科技	11	1,097.03	0.00
314	300036	超图软件	43	1,019.53	0.00



315	688161	威高骨科	23	996.13	0.00
316	300663	科蓝软件	47	638.73	0.00
317	600720	祁连山	50	568.50	0.00
318	002287	奇正藏药	12	286.80	0.00
319	300327	中颖电子	10	279.60	0.00
320	600869	远东股份	36	198.72	0.00
321	688085	三友医疗	6	157.56	0.00
322	002839	张家港行	37	156.51	0.00
323	600400	红豆股份	46	150.88	0.00
324	601515	东风股份	20	87.60	0.00
325	600688	上海石化	26	80.86	0.00
326	688337	普源精电	1	60.26	0.00
327	002421	达实智能	3	10.56	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601003	柳钢股份	923,900	3,732,556.00	0.60
2	002454	松芝股份	342,801	2,903,524.47	0.46
3	000997	新大陆	147,000	2,778,300.00	0.44
4	600229	城市传媒	295,000	2,513,400.00	0.40
5	300014	亿纬锂能	40,700	2,462,350.00	0.39
6	002154	报喜鸟	418,200	2,308,464.00	0.37
7	002531	天顺风能	145,800	2,220,534.00	0.35
8	300719	安达维尔	149,800	2,115,176.00	0.34
9	601966	玲珑轮胎	91,100	2,024,242.00	0.32
10	600020	中原高速	539,500	1,979,965.00	0.32
11	600488	津药药业	343,600	1,931,032.00	0.31
12	300759	康龙化成	50,400	1,929,312.00	0.31
13	600829	人民同泰	235,400	1,657,216.00	0.26
14	300872	天阳科技	106,480	1,654,699.20	0.26
15	300857	协创数据	60,848	1,599,085.44	0.26
16	603218	日月股份	82,100	1,559,079.00	0.25
17	300368	汇金股份	223,500	1,484,040.00	0.24
18	600031	三一重工	87,600	1,456,788.00	0.23
19	300870	欧陆通	24,000	1,438,320.00	0.23
20	002422	科伦药业	47,700	1,415,736.00	0.23
21	002997	瑞鹄模具	46,100	1,370,553.00	0.22
22	600760	中航沈飞	29,700	1,336,500.00	0.21
23	002919	名臣健康	29,200	1,316,920.00	0.21
24	002449	国星光电	147,900	1,314,831.00	0.21

25	688029	南微医学	16,110	1,313,931.60	0.21
26	301111	粤万年青	59,800	1,170,884.00	0.19
27	600469	风神股份	173,200	1,115,408.00	0.18
28	300228	富瑞特装	174,200	1,114,880.00	0.18
29	002971	和远气体	43,200	1,108,080.00	0.18
30	600050	中国联通	229,400	1,101,120.00	0.18
31	002593	日上集团	277,000	1,071,990.00	0.17
32	002559	亚威股份	117,200	1,040,736.00	0.17
33	600166	福田汽车	299,700	1,018,980.00	0.16
34	002869	金溢科技	46,100	1,013,278.00	0.16
35	000919	金陵药业	129,400	1,011,908.00	0.16
36	600035	楚天高速	244,200	996,336.00	0.16
37	002275	桂林三金	53,700	967,137.00	0.15
38	603158	腾龙股份	118,000	903,880.00	0.14
39	603708	家家悦	71,900	901,626.00	0.14
40	000531	穗恒运 A	124,400	899,412.00	0.14
41	603228	景旺电子	34,700	890,055.00	0.14
42	000949	新乡化纤	270,400	867,984.00	0.14
43	600329	达仁堂	18,200	816,998.00	0.13
44	688006	杭可科技	26,800	816,596.00	0.13
45	603676	卫信康	58,900	813,998.00	0.13
46	002739	万达电影	63,500	796,290.00	0.13
47	600337	美克家居	242,300	787,475.00	0.13
48	300041	回天新材	64,300	758,740.00	0.12
49	603628	清源股份	47,200	747,176.00	0.12
50	600558	大西洋	180,923	718,264.31	0.11
51	600748	上实发展	180,500	712,975.00	0.11
52	600664	哈药股份	211,100	694,519.00	0.11
53	688150	莱特光电	29,863	668,931.20	0.11
54	688510	航亚科技	33,200	660,348.00	0.11
55	600611	大众交通	217,100	642,616.00	0.10
56	688138	清溢光电	30,100	635,411.00	0.10
57	301103	何氏眼科	14,900	625,204.00	0.10
58	600824	益民集团	171,800	611,608.00	0.10
59	002170	芭田股份	88,700	609,369.00	0.10
60	688208	道通科技	19,807	600,350.17	0.10
61	002566	益盛药业	72,000	599,040.00	0.10
62	300200	高盟新材	67,600	575,276.00	0.09
63	300194	福安药业	145,400	564,152.00	0.09
64	002563	森马服饰	89,300	555,446.00	0.09
65	600315	上海家化	18,792	545,155.92	0.09
66	002104	恒宝股份	62,000	539,400.00	0.09
67	300421	力星股份	45,020	537,538.80	0.09

68	600728	佳都科技	77,400	536,382.00	0.09
69	002179	中航光电	11,700	530,595.00	0.08
70	601007	金陵饭店	62,000	528,240.00	0.08
71	600642	申能股份	75,300	526,347.00	0.08
72	002273	水晶光电	43,200	515,808.00	0.08
73	301052	果麦文化	10,400	512,928.00	0.08
74	000738	航发控制	21,000	512,400.00	0.08
75	002384	东山精密	18,900	489,510.00	0.08
76	600571	信雅达	52,700	481,678.00	0.08
77	002029	七匹狼	74,500	473,075.00	0.08
78	600054	黄山旅游	36,500	467,200.00	0.07
79	002299	圣农发展	24,200	463,430.00	0.07
80	601999	出版传媒	67,300	450,910.00	0.07
81	600498	烽火通信	19,600	399,252.00	0.06
82	600862	中航高科	15,700	397,367.00	0.06
83	600489	中金黄金	34,200	353,286.00	0.06
84	603199	九华旅游	9,300	321,315.00	0.05
85	300292	吴通控股	82,200	320,580.00	0.05
86	603508	思维列控	18,695	318,749.75	0.05
87	002033	丽江股份	28,330	308,230.40	0.05
88	600756	浪潮软件	17,500	290,850.00	0.05
89	603309	维力医疗	18,100	280,007.00	0.04
90	000852	石化机械	36,000	258,840.00	0.04
91	002419	天虹股份	42,300	247,455.00	0.04
92	000739	普洛药业	13,800	244,812.00	0.04
93	603808	歌力思	18,100	237,653.00	0.04
94	688539	高华科技	5,334	231,975.66	0.04
95	000301	东方盛虹	19,100	225,762.00	0.04
96	600637	东方明珠	28,800	225,216.00	0.04
97	002107	沃华医药	37,294	224,509.88	0.04
98	000417	合肥百货	47,700	223,236.00	0.04
99	688357	建龙微纳	3,433	222,080.77	0.04
100	000425	徐工机械	31,900	215,963.00	0.03
101	300110	华仁药业	52,200	210,366.00	0.03
102	300219	鸿利智汇	26,000	191,100.00	0.03
103	600019	宝钢股份	33,400	187,708.00	0.03
104	601600	中国铝业	34,100	187,209.00	0.03
105	002203	海亮股份	15,400	184,954.00	0.03
106	603587	地素时尚	12,600	184,464.00	0.03
107	000534	万泽股份	10,800	181,116.00	0.03
108	603283	赛腾股份	3,900	173,550.00	0.03
109	603166	福达股份	24,600	165,804.00	0.03
110	300434	金石亚药	11,300	153,002.00	0.02

111	300667	必创科技	7,700	151,613.00	0.02
112	601107	四川成渝	36,400	148,148.00	0.02
113	002093	国脉科技	16,900	142,636.00	0.02
114	000751	锌业股份	42,000	138,600.00	0.02
115	600418	江淮汽车	10,400	130,936.00	0.02
116	003029	吉大正元	4,000	129,800.00	0.02
117	603367	辰欣药业	8,200	124,476.00	0.02
118	002169	智光电气	14,700	121,863.00	0.02
119	002745	木林森	13,100	120,520.00	0.02
120	600968	海油发展	36,300	111,441.00	0.02
121	002600	领益智造	15,500	107,105.00	0.02
122	600570	恒生电子	2,300	101,867.00	0.02
123	603383	顶点软件	1,800	99,756.00	0.02
124	600301	华锡有色	5,300	95,135.00	0.02
125	600757	长江传媒	9,200	79,120.00	0.01
126	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
127	002580	圣阳股份	8,100	76,059.00	0.01
128	002912	中新赛克	1,300	57,213.00	0.01
129	002056	横店东磁	3,100	56,451.00	0.01
130	300337	银邦股份	8,100	54,027.00	0.01
131	002712	思美传媒	8,000	52,480.00	0.01
132	601686	友发集团	7,500	51,300.00	0.01
133	601098	中南传媒	3,800	44,080.00	0.01
134	002303	美盈森	12,400	40,052.00	0.01
135	688472	阿特斯	2,289	39,004.56	0.01
136	688468	科美诊断	3,700	35,150.00	0.01
137	603507	振江股份	900	32,634.00	0.01
138	301358	湖南裕能	748	32,081.72	0.01
139	000045	深纺织 A	2,500	27,500.00	0.00
140	688576	西山科技	210	25,779.45	0.00
141	603096	新经典	1,200	24,432.00	0.00
142	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
143	600794	保税科技	6,600	23,232.00	0.00
144	301310	鑫宏业	345	22,573.35	0.00
145	603317	天味食品	1,500	21,915.00	0.00
146	600582	天地科技	3,700	21,571.00	0.00
147	300560	中富通	1,100	20,350.00	0.00
148	688352	颀中科技	1,303	15,727.21	0.00
149	688458	美芯晟	171	15,519.96	0.00
150	688552	航天南湖	659	15,486.50	0.00
151	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
152	301246	宏源药业	478	14,679.38	0.00
153	688484	南芯科技	390	14,316.90	0.00

154	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
155	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
156	688570	天玛智控	542	13,728.86	0.00
157	688581	安杰思	114	13,455.42	0.00
158	688433	华曙高科	403	12,694.50	0.00
159	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
160	301322	绿通科技	216	11,499.84	0.00
161	301439	泓淋电力	655	11,069.50	0.00
162	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
163	688623	双元科技	119	10,328.01	0.00
164	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
165	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
166	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
167	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
168	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
169	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
170	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
171	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
172	688200	华峰测控	49	7,497.00	0.00
173	301345	涛涛车业	150	6,996.00	0.00
174	688228	开普云	115	5,906.40	0.00
175	688622	禾信仪器	122	4,331.00	0.00
176	605117	德业股份	20	2,991.00	0.00
177	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
178	301029	怡合达	40	1,787.20	0.00
179	688569	铁科轨道	37	1,556.59	0.00
180	300642	透景生命	50	1,008.50	0.00
181	603338	浙江鼎力	13	728.13	0.00
182	002915	中欣氟材	40	668.40	0.00
183	688588	凌志软件	38	590.90	0.00
184	603960	克来机电	30	559.50	0.00
185	688223	晶科能源	17	239.02	0.00
186	600200	江苏吴中	10	72.10	0.00
187	688049	炬芯科技	1	36.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600583	海油工程	21,529,911.00	4.08

2	002635	安洁科技	21,137,667.96	4.01
3	002017	东信和平	20,944,599.18	3.97
4	600850	电科数字	20,164,459.30	3.82
5	002463	沪电股份	19,979,480.50	3.79
6	601921	浙版传媒	19,054,073.44	3.61
7	603328	依顿电子	18,843,358.00	3.57
8	600458	时代新材	18,709,771.82	3.55
9	603171	税友股份	18,610,782.00	3.53
10	600572	康恩贝	18,326,561.00	3.47
11	601137	博威合金	18,284,933.00	3.47
12	600267	海正药业	17,843,907.00	3.38
13	688318	财富趋势	17,774,873.28	3.37
14	688408	中信博	17,411,510.47	3.30
15	000758	中色股份	17,281,502.00	3.28
16	600776	东方通信	16,998,294.94	3.22
17	002727	一心堂	16,711,010.26	3.17
18	300900	广联航空	16,509,167.43	3.13
19	600037	歌华有线	16,442,779.73	3.12
20	300101	振芯科技	16,208,403.00	3.07
21	600531	豫光金铅	16,178,806.00	3.07
22	300803	指南针	16,111,918.86	3.05
23	000860	顺鑫农业	15,982,866.50	3.03
24	002421	达实智能	15,937,047.00	3.02
25	605123	派克新材	15,902,309.16	3.01
26	601126	四方股份	15,847,438.00	3.00
27	600502	安徽建工	15,584,103.65	2.95
28	002664	信质集团	15,566,174.48	2.95
29	600197	伊力特	15,519,614.00	2.94
30	600977	中国电影	15,444,756.00	2.93
31	600789	鲁抗医药	15,414,527.00	2.92
32	002020	京新药业	15,391,718.00	2.92
33	603027	千禾味业	15,161,534.00	2.87
34	002204	大连重工	15,128,200.80	2.87
35	300616	尚品宅配	14,945,510.94	2.83
36	000597	东北制药	14,895,498.00	2.82
37	600990	四创电子	14,836,273.87	2.81
38	300319	麦捷科技	14,767,265.08	2.80
39	301039	中集车辆	14,745,952.00	2.80
40	603636	南威软件	14,668,869.00	2.78
41	002746	仙坛股份	14,660,140.36	2.78
42	300602	飞荣达	14,609,787.00	2.77
43	002139	拓邦股份	14,527,148.00	2.75
44	002130	沃尔核材	14,431,886.89	2.74

45	002544	普天科技	14,277,498.00	2.71
46	603505	金石资源	14,234,039.00	2.70
47	002649	博彦科技	14,024,107.00	2.66
48	600797	浙大网新	13,916,088.88	2.64
49	601619	嘉泽新能	13,907,011.00	2.64
50	603396	金辰股份	13,884,891.14	2.63
51	601567	三星医疗	13,801,666.00	2.62
52	300183	东软载波	13,763,492.00	2.61
53	688676	金盘科技	13,744,997.91	2.61
54	603338	浙江鼎力	13,656,367.00	2.59
55	000030	富奥股份	13,642,011.00	2.59
56	002085	万丰奥威	13,619,907.00	2.58
57	002697	红旗连锁	13,608,676.00	2.58
58	601519	大智慧	13,410,247.00	2.54
59	002335	科华数据	13,340,279.00	2.53
60	603718	海利生物	13,327,922.00	2.53
61	601222	林洋能源	13,313,700.41	2.52
62	603305	旭升集团	13,252,427.64	2.51
63	300679	电连技术	13,139,874.19	2.49
64	603533	掌阅科技	13,136,386.00	2.49
65	300377	赢时胜	13,087,972.85	2.48
66	603103	横店影视	13,046,844.45	2.47
67	002737	葵花药业	13,046,334.00	2.47
68	605589	圣泉集团	13,042,847.00	2.47
69	002038	双鹭药业	12,998,551.00	2.46
70	601908	京运通	12,978,548.00	2.46
71	002126	银轮股份	12,946,666.94	2.45
72	603229	奥翔药业	12,913,975.60	2.45
73	000582	北部湾港	12,896,380.56	2.44
74	002206	海利得	12,869,873.00	2.44
75	002435	长江健康	12,800,647.10	2.43
76	600682	南京新百	12,770,893.00	2.42
77	603088	宁波精达	12,728,660.00	2.41
78	002158	汉钟精机	12,705,104.55	2.41
79	300133	华策影视	12,651,446.00	2.40
80	605168	三人行	12,531,246.33	2.38
81	002651	利君股份	12,521,455.00	2.37
82	002938	鹏鼎控股	12,504,609.89	2.37
83	600577	精达股份	12,489,110.76	2.37
84	000928	中钢国际	12,439,102.00	2.36
85	600391	航发科技	12,435,344.00	2.36
86	688578	艾力斯	12,432,311.38	2.36
87	600184	光电股份	12,291,253.58	2.33

88	603299	苏盐井神	12,186,989.00	2.31
89	600098	广州发展	12,160,162.00	2.31
90	300527	中船应急	12,127,684.84	2.30
91	002567	唐人神	12,076,046.62	2.29
92	603601	再升科技	12,066,807.29	2.29
93	600114	东睦股份	12,020,619.37	2.28
94	000550	江铃汽车	11,989,056.00	2.27
95	688148	芳源股份	11,968,703.28	2.27
96	688711	宏微科技	11,961,908.55	2.27
97	601019	山东出版	11,909,678.34	2.26
98	002367	康力电梯	11,872,286.00	2.25
99	600685	中船防务	11,810,806.00	2.24
100	002449	国星光电	11,794,414.77	2.24
101	600578	京能电力	11,767,114.40	2.23
102	603306	华懋科技	11,722,585.00	2.22
103	300768	迪普科技	11,720,603.91	2.22
104	603118	共进股份	11,649,243.90	2.21
105	688223	晶科能源	11,613,291.00	2.20
106	002675	东诚药业	11,608,614.62	2.20
107	002239	奥特佳	11,598,067.00	2.20
108	603236	移远通信	11,583,102.62	2.20
109	000517	荣安地产	11,488,009.00	2.18
110	688559	海目星	11,468,465.88	2.17
111	688023	安恒信息	11,360,424.15	2.15
112	000823	超声电子	11,308,114.80	2.14
113	600073	上海梅林	11,281,794.00	2.14
114	300767	震安科技	11,253,712.80	2.13
115	002215	诺普信	11,047,453.77	2.09
116	002389	航天彩虹	11,025,936.93	2.09
117	002061	浙江交科	10,916,362.00	2.07
118	688425	铁建重工	10,907,198.00	2.07
119	000682	东方电子	10,853,930.00	2.06
120	600657	信达地产	10,836,484.78	2.05
121	002006	精工科技	10,752,214.98	2.04
122	002402	和而泰	10,752,144.00	2.04
123	002233	塔牌集团	10,700,167.00	2.03
124	300130	新国都	10,692,970.68	2.03
125	002641	公元股份	10,673,077.00	2.02
126	003032	传智教育	10,651,099.00	2.02
127	300226	上海钢联	10,634,763.12	2.02
128	600211	西藏药业	10,612,081.00	2.01
129	300777	中简科技	10,579,861.65	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。



7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	002463	沪电股份	24,551,679.50	4.65
2	002017	东信和平	20,131,480.68	3.82
3	600458	时代新材	19,612,654.20	3.72
4	000758	中色股份	19,412,011.56	3.68
5	600850	电科数字	19,184,269.53	3.64
6	002635	安洁科技	19,178,982.01	3.64
7	601921	浙版传媒	18,190,593.86	3.45
8	002421	达实智能	17,831,485.81	3.38
9	603328	依顿电子	17,829,397.00	3.38
10	600776	东方通信	17,533,878.41	3.32
11	300616	尚品宅配	17,174,601.28	3.26
12	600583	海油工程	17,067,471.00	3.24
13	600037	歌华有线	17,029,056.00	3.23
14	300803	指南针	16,991,224.02	3.22
15	600572	康恩贝	16,806,833.54	3.19
16	600797	浙大网新	16,754,303.32	3.18
17	688408	中信博	16,354,217.60	3.10
18	600114	东睦股份	16,303,773.80	3.09
19	301039	中集车辆	16,290,352.00	3.09
20	300602	飞荣达	16,288,885.05	3.09
21	688318	财富趋势	16,035,850.45	3.04
22	000860	顺鑫农业	15,983,916.99	3.03
23	601137	博威合金	15,829,172.32	3.00
24	002727	一心堂	15,711,648.54	2.98
25	300101	振芯科技	15,624,648.50	2.96
26	300377	赢时胜	15,144,112.45	2.87
27	002139	拓邦股份	15,106,152.00	2.86
28	600391	航发科技	15,048,660.00	2.85
29	601567	三星医疗	14,978,316.00	2.84
30	002204	大连重工	14,962,151.76	2.84
31	600267	海正药业	14,690,007.00	2.78
32	002544	普天科技	14,675,431.10	2.78
33	600685	中船防务	14,630,020.00	2.77
34	600990	四创电子	14,596,333.56	2.77
35	603171	税友股份	14,537,868.00	2.76
36	002697	红旗连锁	14,499,744.00	2.75
37	605123	派克新材	14,434,056.18	2.74

38	603533	掌阅科技	14,353,772.00	2.72
39	601126	四方股份	14,336,137.59	2.72
40	300183	东软载波	14,283,848.00	2.71
41	603636	南威软件	14,132,615.15	2.68
42	000597	东北制药	14,099,438.12	2.67
43	603299	苏盐井神	14,060,974.00	2.67
44	002085	万丰奥威	14,036,191.00	2.66
45	002664	信质集团	13,987,542.80	2.65
46	300900	广联航空	13,965,579.00	2.65
47	002020	京新药业	13,960,213.80	2.65
48	300679	电连技术	13,881,617.51	2.63
49	002126	银轮股份	13,868,177.78	2.63
50	000928	中钢国际	13,834,651.00	2.62
51	002938	鹏鼎控股	13,751,270.06	2.61
52	002675	东诚药业	13,680,513.73	2.59
53	603305	旭升集团	13,661,880.54	2.59
54	688148	芳源股份	13,638,681.31	2.59
55	603396	金辰股份	13,514,329.73	2.56
56	600073	上海梅林	13,482,392.28	2.56
57	603505	金石资源	13,478,507.00	2.56
58	000682	东方电子	13,414,248.00	2.54
59	002130	沃尔核材	13,411,755.63	2.54
60	600789	鲁抗医药	13,372,552.00	2.54
61	603338	浙江鼎力	13,369,310.99	2.53
62	603718	海利生物	13,237,170.00	2.51
63	605589	圣泉集团	13,229,311.30	2.51
64	688559	海目星	13,197,891.59	2.50
65	002746	仙坛股份	13,157,282.00	2.49
66	002038	双鹭药业	13,146,650.00	2.49
67	600502	安徽建工	13,116,557.00	2.49
68	688578	艾力斯	13,045,125.23	2.47
69	603027	千禾味业	13,026,985.40	2.47
70	300527	中船应急	13,009,871.85	2.47
71	603118	共进股份	12,880,919.70	2.44
72	000823	超声电子	12,797,729.07	2.43
73	000582	北部湾港	12,778,424.20	2.42
74	300319	麦捷科技	12,735,042.00	2.41
75	002435	长江健康	12,714,714.54	2.41
76	603088	宁波精达	12,696,681.20	2.41
77	600184	光电股份	12,535,511.75	2.38
78	002567	唐人神	12,532,046.24	2.38
79	605168	三人行	12,469,262.01	2.36
80	600210	紫江企业	12,421,216.00	2.35

81	002004	华邦健康	12,412,798.00	2.35
82	002649	博彦科技	12,304,332.00	2.33
83	600531	豫光金铅	12,290,639.00	2.33
84	600682	南京新百	12,240,529.00	2.32
85	002737	葵花药业	12,231,797.00	2.32
86	600017	日照港	12,166,029.60	2.31
87	000030	富奥股份	12,135,839.00	2.30
88	002206	海利得	12,098,314.00	2.29
89	688223	晶科能源	11,684,005.06	2.21
90	600977	中国电影	11,678,553.00	2.21
91	600105	永鼎股份	11,598,939.00	2.20
92	688023	安恒信息	11,593,869.66	2.20
93	003012	东鹏控股	11,496,052.00	2.18
94	688676	金盘科技	11,483,011.58	2.18
95	002006	精工科技	11,482,769.00	2.18
96	601222	林洋能源	11,459,785.65	2.17
97	600657	信达地产	11,436,819.92	2.17
98	600211	西藏药业	11,381,908.80	2.16
99	002036	联创电子	11,357,506.18	2.15
100	603306	华懋科技	11,272,357.00	2.14
101	300767	震安科技	11,224,633.61	2.13
102	002174	游族网络	11,212,030.00	2.13
103	002662	京威股份	11,196,151.50	2.12
104	002367	康力电梯	11,114,054.00	2.11
105	002239	奥特佳	11,099,039.70	2.10
106	300133	华策影视	10,993,259.00	2.08
107	002651	利君股份	10,958,533.00	2.08
108	601949	中国出版	10,955,376.00	2.08
109	002061	浙江交科	10,928,393.00	2.07
110	603960	克来机电	10,900,116.46	2.07
111	000423	东阿阿胶	10,804,911.00	2.05
112	301015	百洋医药	10,801,513.25	2.05
113	601519	大智慧	10,783,314.00	2.04
114	300777	中简科技	10,732,252.00	2.03
115	002484	江海股份	10,597,971.00	2.01
116	002233	塔牌集团	10,593,031.00	2.01
117	000517	荣安地产	10,589,345.52	2.01
118	003032	传智教育	10,587,951.00	2.01
119	002389	航天彩虹	10,571,958.47	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,480,619,663.49
卖出股票收入（成交）总额	6,458,208,964.40

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体横店影视股份有限公司，2023 年 4 月因信披违规，被上海证券交易所处以书面警示的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,557,388.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,347,320.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,904,709.12

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安 中证 1000 指 数增强 A	4,499	48,872.96	2,229,514.11	1.01%	217,649,954.12	98.99%
国泰君安 中证 1000 指 数增强 C	5,823	69,914.78	250,170,435.30	61.45%	156,943,323.35	38.55%
合计	10,322	60,743.39	252,399,949.41	40.26%	374,593,277.47	59.74%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	2,183,487.74	0.9930%
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	372,853.04	0.0916%
	合计	2,556,340.78	0.4077%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 08 月 16 日）基金份额总额	332,110,120.07	277,282,091.55
本报告期期初基金份额总额	309,802,278.63	273,418,758.21
本报告期基金总申购份额	58,585,180.32	491,438,962.82
减：本报告期基金总赎回份额	148,507,990.72	357,743,962.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	219,879,468.23	407,113,758.65

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

本基金管理人于 2023 年 04 月 08 日发布公告，上海国泰君安证券资产管理有限公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 04 月 06 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	12,934,151,809.07	100.00%	921,987.72	100.00%	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-01-20
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年 4 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	2023-01-20
3	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	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	2023-04-08
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网	2023-04-17



	直销 APP 费率优惠活动的公告	站、公司官网	
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 1 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	2023-04-22
8	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.gtjazg.com>。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日