

国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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:2024 年 07 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	779,251,349.36 份
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	1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	
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	327,460,558.29 份	451,790,791.07 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 04 月 01 日-2024 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
1. 本期已实现收益	-5,481,645.20	-8,056,380.23
2. 本期利润	-15,943,554.21	-24,517,219.76
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0481	-0.0474
4. 期末基金资产净值	272,327,095.79	372,914,705.78
5. 期末基金份额净值	0.8316	0.8254

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.46%	1.47%	-9.51%	1.42%	4.05%	0.05%
过去六个月	-10.42%	1.91%	-15.97%	1.87%	5.55%	0.04%
过去一年	-16.85%	1.49%	-24.61%	1.47%	7.76%	0.02%
自基金合同 生效起至今	-16.84%	1.28%	-31.27%	1.29%	14.43%	-0.01%

国泰君安中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
----	------------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

过去三个月	-5.55%	1.47%	-9.51%	1.42%	3.96%	0.05%
过去六个月	-10.60%	1.91%	-15.97%	1.87%	5.37%	0.04%
过去一年	-17.18%	1.49%	-24.61%	1.47%	7.43%	0.02%
自基金合同生效起至今	-17.46%	1.28%	-31.27%	1.29%	13.81%	-0.01%

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

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-2024年06月30日)



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-2024年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	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，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化	2022-08-16	-	13 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。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，兼任量化投资部（公募）总经理。

	投资部总经理，兼任量化投资部（公募）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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。

本报告期内，本管理人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 0 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在市场方面，二季度投资者的风险偏好降至冰点，投资者在不确定性笼罩下寻求避风港，红利及大型垄断性国企成为资金青睐的对象，展现出显著的超额收益。相对而言，小盘股受业绩的不确定性和“国九条”的情绪冲击，经历了两波大幅回撤。虽然“国九条”短期内对中小市值公司造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施就如“刮骨疗伤”，短期的阵痛反而有利于资本市场中长期的健康发展。直至二季度末，中证 1000 指数表现一般（跌幅 10.02%），差于中证 500 指数（跌幅 6.50%）和沪深 300 指数（跌幅 2.14%），但好于中证 2000 指数（跌幅 13.75%）。展望第三季度，在市场情绪回稳和盈利预期修复下，以及中央经济工作会议积极定调，近期市场已接近底部，整体回调的空间不大，建议投资者在当下对于像中证 1000 这样的市场主要宽基指数要体现出更多的耐心和更积极的态度，中证 1000 指数在当下市场风格的影响下短期跌幅较大，但是长期投资逻辑并未发生改变。

在行业方面，受益于利率环境和资本市场改革的支持，银行股在二季度持续领涨，表现突出。公用事业和煤炭行业也展现出较强的抗跌性。相反，传媒、商贸零售和社会服务行业则遭遇了较大的挑战，自 4 月初以来持续下跌，面临多重不利因素影响。展望下一阶段，市场仍将受到财报季节和宏观经济政策走向的影响，本基金将密切关注行业轮动和风险偏好的变化，以及可能带来的投资机会与挑战。

从主要风险因子的走势来看，多数风险因子在 2024 年第二季度延续之前的走势。大盘风格和价值风格表现继续优于成长风格和中小盘风格，其中大盘价值指数在第二季度仍然表现相对较好，高股息为代表的防御风格总体表现依然优于其他风格指数。动量因子在第二季度继续表现强劲，成长相对于价值表现较差，分析师情绪因子相较 2023 年出现明显提升。Alpha 表现方面，二季度整体基本面因子表现较好，其中财务质量和估值类因子表现强劲。受制于市场风险事件以及投资者情绪恶化，A 股二季度呈现出极端缩量的行情，实时量价因子受此影响表现一般。鉴于今年市场环境的复杂性，我们特别重视提升业绩稳定性。展望未来，随着经济进一步复苏以及政策进一步发力，资本市场信心和活跃度有望逐步恢复，我们认为基本面和量价模型会有较好的发挥空间，同时我们也将根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳重求胜的风格下追求更好的超额收益率。

从中证 1000 指数当前的估值水平来看，截至一季度末其加权 PE 和整体 PE 分别在 30 倍和 32 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，整体 PE 在历史上的分位数低于 18.6%，而用 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 5.5% 之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。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。我们认为做为一个高成长性、盈利增长潜力巨大，行业分布均匀的中小盘宽基指数，中证 1000 指数依然是当前市场环境下成长和进攻性资产的选择。

以分散化投资为主的量化投资在今年超大盘股引领的防御性行情下，阶段性面临一定的挑战，也本没有一种投资方法论可以通吃所有风格的行情，但是量化投资从投资理念和投资逻辑来讲并未发生本质性改变，以博取 Alpha 为主要目的的宽基增强型产品在当前市场点位仍具有很高的性价比。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本

基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，力求以较为稳定的方式增强中证 1000 指数。另外一方面，由于本基金采用的基本面量化信号和实时量价信号在逻辑和数值层面均有较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha，更有效发挥两者的协同和共振效应，并根据市场的流动性和波动率进行及时优化。我们的投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期持有。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跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.8316 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.46%，同期业绩比较基准收益率为-9.51%；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 0.8254 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.55%，同期业绩比较基准收益率为-9.51%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	594,467,956.44	91.21
	其中：股票	594,467,956.44	91.21
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	54,518,446.35	8.36
8	其他资产	2,771,991.03	0.43
9	合计	651,758,393.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,845,243.00	0.44
B	采矿业	13,363,330.00	2.07
C	制造业	335,462,655.82	51.99
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	13,514,903.10	2.09
E	建筑业	3,482,669.28	0.54
F	批发和零售业	9,880,454.06	1.53
G	交通运输、仓储和邮 政业	20,302,668.60	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	65,568,295.71	10.16
J	金融业	2,895,039.60	0.45
K	房地产业	3,048,249.32	0.47
L	租赁和商务服务业	2,702,723.00	0.42
M	科学研究和技术服务 业	7,850,321.10	1.22
N	水利、环境和公共设 施管理业	2,702,802.00	0.42
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	3,367,916.14	0.52
S	综合	-	-
	合计	486,987,270.73	75.47

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,094,280.00	0.63
C	制造业	72,741,854.26	11.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,986,199.00	1.70
E	建筑业	2,157,838.00	0.33
F	批发和零售业	1,029,019.20	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	2,233,110.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,356,662.56	0.52
J	金融业	2,667,230.70	0.41
K	房地产业	5,118,630.24	0.79
L	租赁和商务服务业	2,780,135.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	52,681.95	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	19,872.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	243,172.80	0.04
	合计	107,480,685.71	16.66

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002468	申通快递	679,276	5,705,918.40	0.88
2	688088	虹软科技	190,524	5,498,522.64	0.85

3	002020	京新药业	515,800	5,400,426.00	0.84
4	300735	光弘科技	247,700	5,350,320.00	0.83
5	600602	云赛智联	475,000	5,244,000.00	0.81
6	300229	拓尔思	384,900	5,169,207.00	0.80
7	688586	中航装备	549,143	5,107,029.90	0.79
8	600596	新安股份	663,007	5,038,853.20	0.78
9	002245	蔚蓝锂芯	648,900	5,028,975.00	0.78
10	002292	奥飞娱乐	833,800	4,986,124.00	0.77

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000830	鲁西化工	291,500	3,378,485.00	0.52
2	002241	歌尔股份	153,400	2,992,834.00	0.46
3	003816	中国广核	557,900	2,583,077.00	0.40
4	002422	科伦药业	83,200	2,523,456.00	0.39
5	000930	中粮科技	501,100	2,520,533.00	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IM2407	IM2407	16	15,545,600.00	-453,026.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-453,026.00
股指期货投资本期收益 (元)					-874,767.46
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-433,460.28

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,865,472.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	906,519.03
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,771,991.03

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	337,093,076.51	711,200,432.96
报告期期间基金总申购份额	13,655,309.07	49,257,614.43
减：报告期期间基金总赎回份 额	23,287,827.29	308,667,256.32
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	327,460,558.29	451,790,791.07

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	8,314,279.78
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	8,314,279.78
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2024-06-05	2,000,000.00	- 1,749,000.00	-
2	赎回	2024-06-28	6,314,279.78	- 5,164,449.43	-
合计			8,314,279.78	- 6,913,449.43	

注：基金管理人投资本基金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。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240628	156,618,	-	-	156,618,	20.10%

		-	861.29			861.29	
		20240630					
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、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。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二四年七月十九日